

# 华宝致远混合型证券投资基金（QDII） 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：交通银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	43
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	43
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	44

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	53
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	59
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	59
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	59
7.11 投资组合报告附注.....	59
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</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 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝致远混合型证券投资基金（QDII）	
基金简称	华宝致远混合	
基金主代码	008253	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 27 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	74,742,359.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华宝致远混合 A	华宝致远混合 C
下属分级基金的交易代码	008253	008254
报告期末下属分级基金的份额总额	61,097,570.16 份	13,644,789.53 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、政策形势、证券市场走势以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，从而决定在美国和中国香港特别行政区的资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将依靠定量与定性相结合的方法，自下而上地精选个股。定量的方法包括分析相关的财务指标和市场指标，选择财务健康，成长性好，估值合理的股票。具体分析的指标为：</p> <p>1) 成长指标：预测未来两年主营业务收入、主营业务利润复合增长率等；</p> <p>2) 盈利指标：毛利率、净利率、净资产收益率等；</p> <p>3) 价值指标：PE、PB、PEG、PS 等。</p> <p>定性的方法则是结合本基金研究团队的案头研究和实地调研，深入分析企业的基本面和长期发展前景，及短期重大影响事件，精选符合以下一项或数项定性判断标准的股票：</p> <p>1) 公司的商业模式比较独特，难于被竞争对手复制；</p> <p>2) 公司产品或服务的用户粘性高，用户不易被竞争对手抢夺；</p> <p>3) 公司管理层的战略思考和执行能力突出，能够在不确定的竞争环境中不断做出正确的战略方向选择；</p> <p>4) 公司治理结构健全、信息披露透明，与投资者沟通坦诚、顺畅。</p>

	<p>本基金可以同时投资美国和中国香港特别行政区挂牌交易的股票，不同市场均有其自身的市场特征，因此在个股选择上也会考虑这些特征，采取差异化的投资策略。本基金会根据不同市场发展的不同阶段，及时调整投资策略，尽可能最大化组合的投资收益。</p> <p>3、债券及货币市场工具投资策略</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p>
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×65%+经人民币汇率调整的标普 500 指数收益率×15%+境内银行活期存款利率（税后）×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于美国和中国香港特别行政区证券市场挂牌交易的股票，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	陆志俊
	联系电话	021-38505888	95559
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	95559
传真		021-38505777	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		XIAOYI HELEN HUANG	任德奇

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Hongkong and Shanghai B anking Corporation Limited
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行 大厦
办公地址		-	香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座 六楼
邮政编码		-	无

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

## 2.6 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)		
	华宝致远混合 A	华宝致远混合 C	
本期已实现收益	1,845,541.21	-12,931.89	
本期利润	-688,664.72	-1,238,587.20	
加权平均基金份额本期利润	-0.0117	-0.1094	
本期加权平均净值利润率	-0.86%	-8.17%	
本期基金份额净值增长率	1.50%	1.31%	
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	7,368,497.18	1,540,257.50
	期末可供分配基金份额利润	0.1206	0.1129
	期末基金资产净值	83,479,998.44	18,525,377.21

期末基金份额净值	1.3663	1.3577
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	36.63%	35.77%

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝致远混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.53%	0.95%	0.76%	0.50%	1.77%	0.45%
过去三个月	4.11%	0.99%	1.03%	0.58%	3.08%	0.41%
过去六个月	1.50%	1.70%	5.24%	0.81%	-3.74%	0.89%
过去一年	27.82%	1.72%	9.16%	0.80%	18.66%	0.92%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	36.63%	1.60%	4.41%	1.03%	32.22%	0.57%

华宝致远混合 C



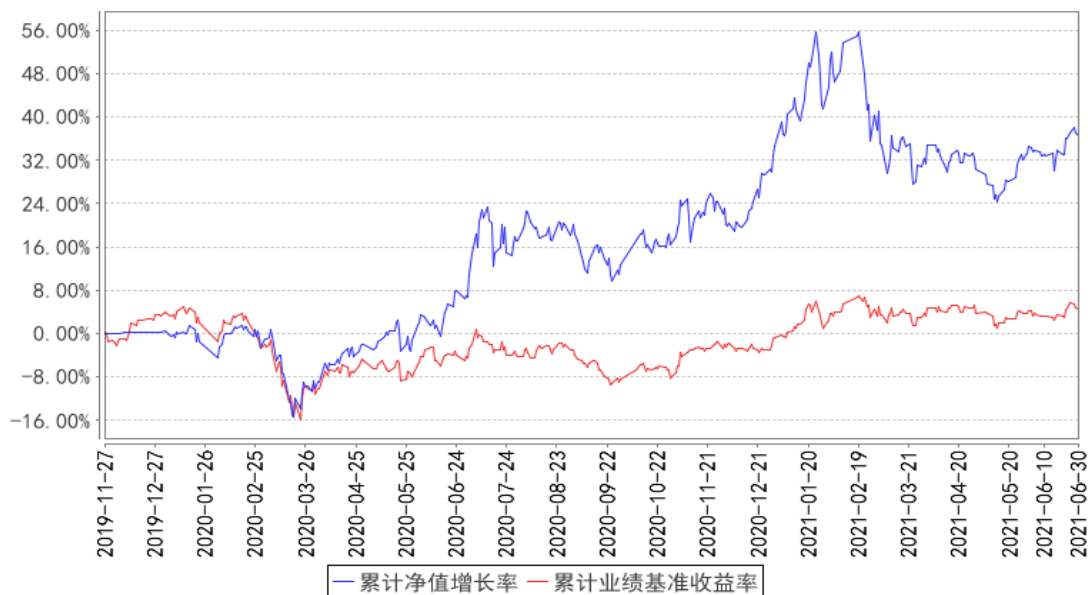
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.50%	0.95%	0.76%	0.50%	1.74%	0.45%
过去三个月	4.01%	0.99%	1.03%	0.58%	2.98%	0.41%
过去六个月	1.31%	1.69%	5.24%	0.81%	-3.93%	0.88%
过去一年	27.32%	1.71%	9.16%	0.80%	18.16%	0.91%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	35.77%	1.60%	4.41%	1.03%	31.36%	0.57%

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）。

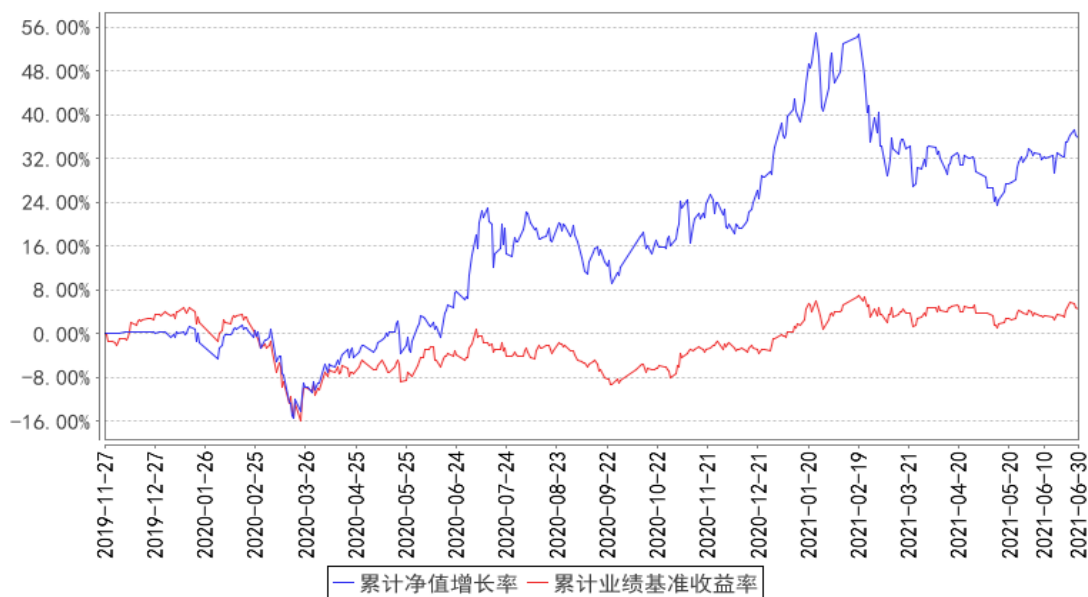
2、本基金业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生指数收益率\*65%+境内银行活期存款利率(税后)\*20%+经人民币汇率调整的标普 500 指数收益率\*15%。

### 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

华宝致远混合A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



华宝致远混合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：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2020年5月27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		
周晶	本基金基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理、首席策略分析师	2019 年 11 月 27 日	-	16 年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005 年至 2007 年任华宝基金管理有限公司内控审计风险管理部主管。2011 年再次加入华宝基金管理有限公司，现任公司总经理助理、国际业务部总经理、首席策略分析师。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝成熟市场动量优选证券投资基金基金经理。2014 年 9 月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。2015 年 9 月至 2017 年 8 月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 6 月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 4 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 3 月起任华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 10 月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 11 月起任华宝致远混合型证券投资基金（QDII）基金经理。2020 年 11 月起任华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金基金经理。
申晟	本基金的基金经理助理	2020 年 9 月 11 日	-	5 年	硕士。曾在平安证券股份有限公司任股权事业部项目经理。2017 年 4 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任国际业务部商务发展经理、高级商务发展经理、基金经理助理。2020 年 9 月起任华宝海外中国成长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、华宝致远混合型证券投资基金（QDII）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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝致远混合型证券投资基金（QDII）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，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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝致远混合型证券投资基金（QDII）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。

### 4.3.2 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

本基金主要投资于港股和美股市场，成立于 19 年 11 月 27 日，于 2020 年五月底完成建仓。

2021 年上半年港股呈现大幅震荡走势。21 年伊始，出于对疫情之后全球经济复苏的乐观预期，港股延续去年年末强势，继续走出上涨行情，风格上而言，受益于全球充沛流动性的成长股走势仍然明显好于价值股。这段时期内，本基金继续延续去年年底以来的港股成长股重仓配置策略，取得了不错的业绩。但春节后，市场风格发生了根本性的变化。随着疫情在欧美国家顺利推广，投资者对今年全球经济复苏的幅度预期升温，美债收益率开始加速抬升，投资者开始担心港股成长股的相对高估值难以维系，港股风格由成长股迅速切到价值股。步入四月，随着中国和美国的经济数据进一步好转，美债收益率持续在高位徘徊。因此港股的高估值成长股板块延续一季度末颓势。而四月五月中国的 PPI 和美国的 CPI 连续超预期上扬，导致投资人对通胀风险担忧增加，这更加对高估值板块的估值水平形成了比较大的压制。而港股低估值顺周期板块因为投资者对后

续中国经济复苏抱有信心，仍然有不错的相对收益。步入五月中旬以后，随着美国非农就业数据低于预期，而美联储多次强调目前的高通胀只是暂时因素，通胀预期走低，美债收益率开始回落。而中国经济增速相较于一季度有所回落，港股市场流动性随即出现一定的改善，因此港股成长股开始反弹，而价值股则相对走弱。

本基金在管理过程中，我们仍然认为代表中国经济转型方向的新经济细分领域，尤其是像新能源车，运动服饰，医疗服务这样的高景气赛道的龙头公司，将在中长期给投资者带来丰厚的回报，因此基金上半年仍然集中于布局这样的新经济龙头公司，并在三四月份新经济龙头公司下跌的过程中选择了加仓，从而在港股成长股五月中以来的这轮反弹中有所斩获。但整体来看，这是基金上半年业绩逊色于香港大盘指数的原因之所在。此外，出于对中国经济今年上半年快速增长的信心，本基金继续主要投资于港股市场，美股市场比重较低。因此基金今年上半年表现较业绩比较基准略弱。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 1.50%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 1.31%；同期业绩比较基准收益率为 5.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当下时点展望 21 年下半年美股和港股市场，我们预测后续均将波动性增大。对于美股而言，美国下半年经济复苏进展和美联储货币政策将成为影响美股走势的核心变量。一方面，虽然随着美国疫苗接种推进顺利，美国经济已经在七月份基本实现了完全重启。但疫情变种的蔓延最近趋于严重，美国的每日感染人数有所增加，因此疫情变化对美国经济后面的复苏节奏还存在着一定的不确定性。此外，美国就业虽然在稳步复苏之中，但是二季度的就业增长速度并不达预期。而拜登的庞大基建计划目前在国会受阻，能否如期在年内推出也充满了不确定性。因此，美国下半年是否能延续上半年的高复苏增速，目前尚不得而知，这就意味着美股二季度高盈利增长之后，下半年盈利增长可能会有一定程度下滑。另一方面，步入二季度之后，美国 CPI 连月创新高，美国通胀风险短期不容小视。这意味着联储后续货币政策上将进行艰难选择。虽然美联储主席鲍威尔多次强调当前的通胀威胁只是暂时性的，联储的宽松货币政策年内不会有根本性转变，但投资者越来越坚信，年内联储债券购买规模将启动减少程序。如此一来，美国流动性最充裕阶段可能即将过去，四季度美股将面临高估值在流动性转弱背景下压缩的风险。我们目前还是认为，在就业和通胀预期两个目标之中，美联储会将就业放在更重要的位置。这样一来，如果美国下半年经济增速果真放缓的话，联储维持流动性充裕的决心会更加充裕。因此，我们认为，美股下半年估值大幅度压缩的可能性并不大，但因为经济情况和通胀数据的反复，而引发的美国短期调整的风

险在增大。由于美债利率可能在下半年继续保持低位，因此美股成长股的表现可能会优于价值股，但成长股中必须优选盈利增长确定度高的个股。

而对于港股而言，上半年在中国经济已经率先从疫情中走出的背景之下，港股的盈利增长令人满意。但下半年中国经济增速预计将较上半年有所放缓，这样港股的盈利增长下半年较上半年会有明显分化，这对选股上提出了更高的挑战。而从流动性方面，国内层面，央行多次表示今年货币政策不会急转弯，且在七月中实施了全面降准。我们预测今年下半年为了维持稳定的经济增长，中国货币政将趋于和缓，而海外我们前面已经预测美联储下半年将继续宽松货币政策，海外流动性将非常充沛。但从资金面上考虑，港股上半年赚钱效应明显弱于美股和港股，因此资金下半年流入香港市场的动力可能会不足。而作为离岸市场，国内和海外市场的扰动，往往会更大效应的反映在香港市场。在这样的情况下，港股下半年流动性上可能很难有比较大的改善，同时波动性可能较 A 股和美股市场都会更加剧烈。因此我们预测下半年港股的结构和个股选择，将对基金的业绩表现至关重要。我们认为代表中国经济转型方向的新经济细分领域龙头赛道，仍然是值得重点配置的方向。但相对于上半年，市场对于这些赛道中龙头公司的增长质量，会更加严苛。因此我们必须加强对这些个股的深入研究，选择真正具备长期成长性的优质公司，才有可能获得令人满意的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、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者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在华宝致远混合型证券投资基金(QDII)的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，华宝基金管理有限公司在华宝致远混合型证券投资基金(QDII)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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

本报告期内，由华宝基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华宝致远混合型证券投资基金(QDII)的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：华宝致远混合型证券投资基金（QDII）

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,220,057.47	5,703,039.45
结算备付金		791,902.04	-
存出保证金		581,996.65	399,510.46
交易性金融资产	6.4.7.2	93,235,914.45	64,875,294.47
其中：股票投资		93,235,914.45	64,875,294.47
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		1,592,652.64	1,574,148.58
应收利息	6.4.7.5	1,168.36	947.53
应收股利		1,124,805.13	6,982.80
应收申购款		130,726.14	171,877.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,679,222.88	72,731,800.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		1,473,658.38	1,092,049.57
应付赎回款		909,075.24	306,528.05
应付管理人报酬		124,676.88	81,962.74
应付托管费		20,779.47	13,660.45
应付销售服务费		6,175.04	415.27
应付交易费用	6.4.7.7	79,547.50	52,589.61
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	59,934.72	180,081.45
负债合计		2,673,847.23	1,727,287.14
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	74,742,359.69	52,753,473.40
未分配利润	6.4.7.10	27,263,015.96	18,251,040.14
所有者权益合计		102,005,375.65	71,004,513.54
负债和所有者权益总计		104,679,222.88	72,731,800.68

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 74,742,359.69 份，其中华宝致远混合 A 基金份额总额为 61,097,570.16 份，基金份额净值 1.3663 元；华宝致远混合 C 基金份额总额为 13,644,789.53 份，基金份额净值 1.3577 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝致远混合型证券投资基金（QDII）

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		-369,910.77	4,368,307.86
1. 利息收入		28,217.87	84,145.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,217.87	84,145.16
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）		3,424,297.68	-2,388,459.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,109,128.91	-2,741,076.17
基金投资收益	6.4.7.13	-190,546.01	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,505,714.78	352,616.19
3. 公允价值变动收益（损失	6.4.7.18	-3,759,861.24	6,701,934.96

以“-”号填列)			
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列)		-96,593.99	-32,532.76
5. 其他收入（损失以“-”号填列)	6.4.7.19	34,028.91	3,220.48
减：二、费用		1,557,341.15	922,986.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	709,896.61	403,622.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	118,316.06	67,270.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,055.23	9,355.53
4. 交易费用	6.4.7.20	621,509.32	374,490.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,112.43	860.16
7. 其他费用	6.4.7.21	76,451.50	67,386.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		-1,927,251.92	3,445,321.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-1,927,251.92	3,445,321.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝致远混合型证券投资基金（QDII）

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）	52,753,473.40	18,251,040.14	71,004,513.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,927,251.92	-1,927,251.92
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)	21,988,886.29	10,939,227.74	32,928,114.03
其中：1. 基金申购款	31,708,498.76	14,476,515.64	46,185,014.40
2. 基金赎回	-9,719,612.47	-3,537,287.90	-13,256,900.37

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	74,742,359.69	27,263,015.96	102,005,375.65
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）	141,322,690.28	340,915.17	141,663,605.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,445,321.30	3,445,321.30
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）	-89,918,969.20	-244,059.32	-90,163,028.52
其中：1. 基金申购款	2,229,186.03	-27,427.76	2,201,758.27
2. 基金赎回款	-92,148,155.23	-216,631.56	-92,364,786.79
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）	51,403,721.08	3,542,177.15	54,945,898.23

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：

黄小蕊

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

华宝致远混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1058号文《关于准予华宝致远混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司于2019年11月22日起至2019年11月25日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第61471289\_B05号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年11月27日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币208,898,153.56元，其中A类基金份额的净认购金额为人民币100,016,037.56元；C类基金份额的净认购金额为人民币108,882,116.00元；在募集期间产生利息为人民币2,477.39元，其中A类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币2,250.61元；C类基金份额的有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币226.78元。以上实收基金合计为人民币208,900,630.95元，折合208,900,630.95份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司。。

根据基金合同相关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式不同，将基金份额分为不同类别，即A类基金份额（以下简称“致远混合A”）和C类基金份额（以下简称“致远混合C”）两类份额。其中，致远混合A是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用的基金份额类别；致远混合C是指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝致远混合型证券投资基金（QDII）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，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括交易型开放式指数基金（ETF））；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等

标的物挂钩的结构化投资产品。本基金主要投资的境外市场有：美国和中国香港特别行政区。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%；本基金保留的现金（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不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 本基金投资于中国香港特别行政区证券市场挂牌交易的股票时，在法律法规允许的前提下，既可通过合格境内机构投资者的额度进行投资，也可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生指数收益率×65%+经人民币汇率调整的标普 500 指数收益率×15%+境内银行活期存款利率（税后）×20%。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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（以下简称“资管产品运营业务”），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。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，《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费附加的单位外）及地方教育费附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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	7,220,057.47
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	7,220,057.47

注：于 2021 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 3,048,824.78 元，港元活期存款 4,636,800.82 元（折合人民币 3,858,189.23 元），美元活期存款 48,457.99 元（折合人民币 313,043.46 元）。

##### 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	83,183,884.18	93,235,914.45	10,052,030.27
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	83,183,884.18	93,235,914.45	10,052,030.27
----	---------------	---------------	---------------

#### 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	916.70
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	251.66
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	-
合计	1,168.36

#### 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	79,547.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	79,547.50

## 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	427.35
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,507.37
合计	59,934.72

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝致远混合 A

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	51,524,620.24	51,524,620.24
本期申购	12,074,246.82	12,074,246.82
本期赎回（以“-”号填列）	-2,501,296.90	-2,501,296.90
-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	61,097,570.16	61,097,570.16

华宝致远混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,228,853.16	1,228,853.16
本期申购	19,634,251.94	19,634,251.94
本期赎回（以“-”号填列）	-7,218,315.57	-7,218,315.57
-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	13,644,789.53	13,644,789.53

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝致远混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,304,643.92	13,528,491.23	17,833,135.15

本期利润	1,845,541.21	-2,534,205.93	-688,664.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,218,312.05	4,019,645.80	5,237,957.85
其中：基金申购款	1,537,337.46	4,669,374.22	6,206,711.68
基金赎回款	-319,025.41	-649,728.42	-968,753.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,368,497.18	15,013,931.10	22,382,428.28

## 华宝致远混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,489.33	321,415.66	417,904.99
本期利润	-12,931.89	-1,225,655.31	-1,238,587.20
本期基金份额交易产生的变动数	1,456,700.06	4,244,569.83	5,701,269.89
其中：基金申购款	2,357,135.52	5,912,668.44	8,269,803.96
基金赎回款	-900,435.46	-1,668,098.61	-2,568,534.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,540,257.50	3,340,330.18	4,880,587.68

## 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	21,001.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,508.82
其他	707.33
合计	28,217.87

## 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	2,109,128.91
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	2,109,128.91

#### 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	177,627,627.93
减：卖出股票成本总额	175,518,499.02
买卖股票差价收入	2,109,128.91

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

-

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	13,003,843.42
减：卖出/赎回基金成本总额	13,194,389.43
基金投资收益	-190,546.01

#### 6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,498,595.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	7,119.65
合计	1,505,714.78

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,759,861.24
股票投资	-3,759,861.24
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	-3,759,861.24

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	34,028.91
合计	34,028.91

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。

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	621,509.32
银行间市场交易费用	-
合计	621,509.32

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	15,790.29
其他	1,153.84
合计	76,451.50

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
香港上海汇丰银行有限公司（“HSBC”）	境外资产托管人
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（“Warburg Pincus Asset Management, L.P.”）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 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	709,896.61	403,622.95
其中：支付销售机构的客户维护费	48,801.36	2,822.43

注：支付基金管理人华宝基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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×1.50%÷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	118,316.06	67,270.44

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，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×0.25%÷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		
	华宝致远混合 A	华宝致远混合 C	合计
交通银行	-	476.20	476.20
华宝基金	-	6,559.57	6,559.57
合计	-	7,035.77	7,035.77
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝致远混合 A	华宝致远混合 C	合计
交通银行	-	178.05	178.05
华宝基金	-	8,176.20	8,176.20
合计	-	8,354.25	8,354.25

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：

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

#### 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无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

##### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华宝致远混合 A



关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
华宝投资有限公司	7,711,935.21	12.62	-	-

份额单位：份

## 华宝致远混合 C

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
华宝投资有限公司	2,653,575.69	19.45	-	-

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
汇丰银行	4,171,232.69	17.40	1,030,226.76	4.65
交通银行股份有限公司	3,048,824.78	20,984.32	3,883,785.55	73,276.08

注：本基金的银行存款分别由基金托管人交通银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

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

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司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、各项业务全面实施的监

督反馈，最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

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

#### **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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无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**

本基金本报告期末无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**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无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**

本基金本报告期末无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，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

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。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；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、存出保证金和部分应收申购款等。

##### 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	7,220,057.47	-	-	-	7,220,057.47

结算备付金	791,902.04	-	-	-	791,902.04
存出保证金	581,996.65	-	-	-	581,996.65
交易性金融资产	-	-	-	93,235,914.45	93,235,914.45
应收利息	-	-	-	1,168.36	1,168.36
应收股利	-	-	-	1,124,805.13	1,124,805.13
应收申购款	111.00	-	-	130,615.14	130,726.14
应收证券清算款	-	-	-	1,592,652.64	1,592,652.64
资产总计	8,594,067.16	-	-	96,085,155.72	104,679,222.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	909,075.24	909,075.24
应付管理人报酬	-	-	-	124,676.88	124,676.88
应付托管费	-	-	-	20,779.47	20,779.47
应付证券清算款	-	-	-	1,473,658.38	1,473,658.38
应付销售服务费	-	-	-	6,175.04	6,175.04
应付交易费用	-	-	-	79,547.50	79,547.50
其他负债	-	-	-	59,934.72	59,934.72
负债总计	-	-	-	2,673,847.23	2,673,847.23
利率敏感度缺口	8,594,067.16	-	-	93,411,308.49	102,005,375.65
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	5,703,039.45	-	-	-	5,703,039.45
存出保证金	399,510.46	-	-	-	399,510.46
交易性金融资产	-	-	-	64,875,294.47	64,875,294.47
应收利息	-	-	-	947.53	947.53
应收股利	-	-	-	6,982.80	6,982.80
应收申购款	210.00	-	-	171,667.39	171,877.39
应收证券清算款	-	-	-	1,574,148.58	1,574,148.58
资产总计	6,102,759.91	-	-	66,629,040.77	72,731,800.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	306,528.05	306,528.05
应付管理人报酬	-	-	-	81,962.74	81,962.74
应付托管费	-	-	-	13,660.45	13,660.45
应付证券清算款	-	-	-	1,092,049.57	1,092,049.57
应付销售服务费	-	-	-	415.27	415.27
应付交易费用	-	-	-	52,589.61	52,589.61
其他负债	-	-	-	180,081.45	180,081.45
负债总计	-	-	-	1,727,287.14	1,727,287.14
利率敏感度缺口	6,102,759.91	-	-	64,901,753.63	71,004,513.54

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

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的 资产				
银行存款	313,043.4 6	3,858,189.23	-	4,171,232.69
交易性金融资 产	5,606,753 .08	87,629,161.37	-	93,235,914.45
应收股利	1,038.14	159,087.18	-	160,125.32
应收利息	-	0.11	-	0.11
应收证券清算 款	1,592,652 .64	-	-	1,592,652.64
资产合计	7,513,487 .32	91,646,437.89	-	99,159,925.21
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	150,089.76	-	150,089.76
负债合计	-	150,089.76	-	150,089.76
资产负债表外 汇风险敞口净	7,513,487	91,496,348.13	-	99,009,835.45

额	.32			
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	2,768,555.93	-	2,768,555.93
交易性金融资产	-	64,875,294.47	-	64,875,294.47
应收利息	-	0.08	-	0.08
资产合计	-	67,643,850.48	-	67,643,850.48
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	1,092,049.57	-	1,092,049.57
负债合计	-	1,092,049.57	-	1,092,049.57
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	66,551,800.91	-	66,551,800.91

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）	
1. 所有外币相对人民币升值 5%	4,950,491.77	3,327,590.05	
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-4,950,491.77	-3,327,590.05	

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的 60%-95%。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	93,235,914.45	91.40	64,875,294.47	91.37
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	93,235,914.45	91.40	64,875,294.47	91.37

#### 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	8,271,739.95	3,768,032.28

	升 5%		
	2. 业绩比较基准下	-8,271,739.95	-3,768,032.28
	降 5%		

#### 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、应收利息、应收申购款及其他金融负债，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 93,235,914.45 元，无划分为第二层次和第三层次的余额（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 64,875,294.47 元，无划分为第二层次和第三层次的余额）。

##### (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，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	93,235,914.45	89.07
	其中：普通股	93,235,914.45	89.07
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,011,959.51	7.65
8	其他各项资产	3,431,348.92	3.28
9	合计	104,679,222.88	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 60,330,667.65 元，占基金资产净值的比例为 59.14%。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	87,629,161.37	85.91
美国	5,606,753.08	5.50
合计	93,235,914.45	91.40

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
房地产	104,675.66	0.10
非日常生活消费品	34,439,142.36	33.76
工业	5,294,009.15	5.19

公用事业	2,061,361.71	2.02
金融	6,573,461.12	6.44
能源	3,096,569.07	3.04
日常消费品	3,425,922.98	3.36
通信服务	9,961,755.52	9.77
信息技术	11,443,288.37	11.22
医疗保健	12,781,834.75	12.53
原材料	4,053,893.76	3.97
合计	93,235,914.45	91.40

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	14,700	7,143,240.38	7
2	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	33,000	5,019,439.39	4.92
3	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	23,000	4,443,806.45	4.36
4	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	赣锋	1772	香	中	42,000	4,053,893.	3.97

		锂业	HK	港 联 合 交 易 所	国 香 港		76	
5	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇 光学 科技	2382 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	19,000	3,879,656. 21	3.8
6	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华 控股	1999 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	218,00 0	3,384,801. 59	3.32
7	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲 国际	2313 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	20,000	3,263,417. 76	3.2
8	IND & COMM BK OF CHINA-H	工商 银行	1398 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	846,00 0	3,209,964. 94	3.15
9	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世 特	1316 HK	香 港 联 合 交 易	中 国 香 港	336,00 0	3,019,451. 90	2.96

				所				
1 0	WUXI APTEC CO LTD-H	药明康德	2359 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	20,000	3,017,122. 08	2.96
1 1	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 H K	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	46,000	2,472,608. 93	2.42
1 2	INMODE LTD	Inmode 公司	INMD US	美国 证 券 交 易 所	美 国	4,000	2,446,569. 07	2.4
1 3	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	158,00 0	2,195,526. 28	2.15
1 4	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 H K	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	68,000	2,087,855. 14	2.05
1 5	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际	1368 HK	香港 联	中 国 香	170,00 0	2,070,880. 70	2.03

				合 交 易 所	港			
1 6	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆 仑 能 源	135 H K	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	346,00 0	2,061,361. 71	2.02
1 7	XIAOMI CORP-CLASS B	小 米 集 团	1810 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	90,000	2,021,954. 40	1.98
1 8	EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	永 升 生 活 服 务	1995 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	126,00 0	2,021,355. 30	1.98
1 9	WUXI BIOLOGICS CAYMAN IN C	药 明 生 物	2269 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	17,000	2,012,884. 72	1.97
2 0	SEMICONDUCTOR MANUFACTURIN G	中 芯 国 际	981 H K	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	100,00 0	1,988,671. 20	1.95

2 1	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商 银行	3968 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	34,500	1,901,822. 85	1.86
2 2	MEITUAN-CLASS B	美 团 -W	3690 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	6,800	1,812,869. 34	1.78
2 3	LI NING CO LTD	李 宁	2331 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	22,000	1,735,386. 05	1.7
2 4	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUT I-H	复 星 医药	2196 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	33,000	1,721,656. 73	1.69
2 5	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信 义 玻璃	868 H K	香港 联合 交易所	中国 香港	64,000	1,685,461. 25	1.65
2 6	TSINGTAO BREWERY CO LTD- H	青 岛 啤酒	168 H K	香港 联合 交	中国 香港	24,000	1,669,485. 31	1.64



				易所				
27	ROBLOX CORP -CLASS A	ROBLOX 公司	RBLX US	美国证券交易所	美国	2,750	1,598,519.44	1.57
28	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港联合交易所	中国香港	92,000	1,565,475.32	1.53
29	TARGET CORP	塔吉公司	TGT US	美国证券交易所	美国	1,000	1,561,664.57	1.53
30	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港联合交易所	中国香港	128,000	1,508,128.36	1.48
31	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	香港联合交易所	中国香港	250,000	1,447,819.20	1.42
32	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港	中国	65,000	1,425,145.02	1.4

				联合交易所	香港			
3 3	CHINA YOURAN DAIRY GROUP LTD	优然牧业	9858 HK	香港联合交易所	中国香港	250,000	1,287,643.80	1.26
3 4	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	1,047,172.68	1.03
3 5	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港联合交易所	中国香港	114,000	990,308.33	0.97
3 6	VIVA BIOTECH HOLDINGS	维亚生物	1873 HK	香港联合交易所	中国香港	100,000	827,087.52	0.81
3 7	BAOFENG MODERN INTERNATIONAL	宝峰时尚	1121 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	822,261.46	0.81

38	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLD GS	四环医药	460 HK	香港联合交易所	中国香港	240,000	663,001.34	0.65
39	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	9,000	646,650.97	0.63
40	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	619,733.18	0.61
41	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	549,172.80	0.54
42	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	540,019.92	0.53
43	SISRAM MEDICAL LTD	复锐医疗科技	1696 HK	香港联合交易所	中国香港	38,000	528,037.97	0.52

				交易所				
4 4	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	中国香港	14,000	522,463.03	0.51
4 5	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	481,774.32	0.47
4 6	CHINA MENGNIU DAIRY CO	蒙牛乳业	2319 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	468,793.87	0.46
4 7	CHINA INTERNATIONAL CAPIT A-H	中金公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	347,809.44	0.34
4 8	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	46,000	337,974.25	0.33
4	CHINA PETROLEUM	中国	386 H	香	中	98,000	320,467.29	0.31

9	& CHEMICAL-H	石化	K	港 联 合 交 易 所	国 香 港			
5 0	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中 国 电 信	728 H K	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	120,00 0	290,562.34	0.28
5 1	CHINA MOBILE LTD	中 国 移 动	941 H K	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	7,000	282,782.39	0.28
5 2	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中 银 香 港	2388 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	5,000	109,626.54	0.11
5 3	CHINA RESOURCES LAND LTD	华 润 置 地	1109 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,000	104,675.66	0.1

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净
----	----------	------	----------	----------

				值比例(%)
1	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1585 HK	6,434,870.24	9.06
2	INMODE LTD	INMD US	6,341,799.48	8.93
3	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	5,695,099.91	8.02
4	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	5,056,194.64	7.12
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	4,684,762.16	6.6
6	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	4,342,334.71	6.12
7	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	3,840,623.78	5.41
8	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	3,780,824.63	5.32
9	CHINA MOBILE LTD	941 HK	3,621,815.26	5.1
10	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	3,592,631.95	5.06
11	CNOOC LTD	883 HK	3,534,423.12	4.98
12	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	3,231,167.13	4.55
13	Atlas Air Worldwide Holdings	AAWW US	3,223,693.53	4.54
14	BOEING CO	BA US	3,220,893.21	4.54
15	BYD CO LTD-H	1211 HK	3,157,643.20	4.45
16	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,154,566.49	4.44
17	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	1772 HK	3,082,723.01	4.34
18	Louisiana-Pacific Corp	LPX US	2,945,892.70	4.15
19	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	3993 HK	2,936,989.22	4.14
20	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	2,874,596.97	4.05
21	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	2,775,049.23	3.91
22	MINTH GROUP LTD	425 HK	2,575,081.91	3.63
23	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	2,536,561.00	3.57
24	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	2,460,112.21	3.46
25	TARGET CORP	TGT US	2,396,378.79	3.37
26	SHANGHAI FOSUN P	2196 HK	2,360,062.13	3.32

	HARMACEUTI-H			
27	ROBLOX CORP -CLASS A	RBLX US	2,294,775.75	3.23
28	HSBC HOLDINGS PL C	5 HK	2,287,270.07	3.22
29	KINGDEE INTERNATI ONAL SFTWR	268 HK	2,214,677.92	3.12
30	AIA GROUP LTD	1299 HK	2,174,956.87	3.06
31	Tencent Music En tertainm	TME US	2,132,686.63	3
32	WUXI BIOLOGICS C AYMAN INC	2269 HK	2,104,681.63	2.96
33	CHINA MEDICAL SY STEM HOLDING	867 HK	2,054,209.02	2.89
34	CHINA SHENHUA EN ERGY CO-H	1088 HK	1,959,647.99	2.76
35	ALIBABA GROUP HO LDING LTD	9988 HK	1,958,057.90	2.76
36	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	1,953,736.70	2.75
37	WH GROUP LTD	288 HK	1,926,392.57	2.71
38	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	1,912,843.21	2.69
39	XTEP INTERNATIONA L HOLDINGS	1368 HK	1,896,101.22	2.67
40	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	1,891,827.49	2.66
41	CHINA TELECOM CO RP LTD-H	728 HK	1,876,039.22	2.64
42	IND & COMM BK OF C HINA-H	1398 HK	1,844,028.08	2.6
43	HOPE EDUCATION G ROUP CO LTD	1765 HK	1,808,455.91	2.55
44	SIHUAN PHARMACEUT ICAL HLDGS	460 HK	1,803,589.19	2.54
45	BOC HONG KONG H OLDINGS LTD	2388 HK	1,785,384.10	2.51
46	GUANGDONG INVESTM ENT LTD	270 HK	1,771,193.92	2.49
47	TECHTRONIC INDUST RIES CO LTD	669 HK	1,730,605.91	2.44
48	CHINA YOURAN DAI RY GROUP LTD	9858 HK	1,723,173.54	2.43
49	CHINA MERCHANTS	3968 HK	1,701,059.81	2.4

	BANK-H			
50	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	1,665,130.39	2.35
51	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	6969 HK	1,646,646.80	2.32
52	LI NING CO LTD	2331 HK	1,578,810.55	2.22
53	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	1658 HK	1,561,811.31	2.2
54	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	1,545,293.44	2.18
55	Taiwan Semiconductor-SP	TSM US	1,532,837.69	2.16
56	SISRAM MEDICAL LTD	1696 HK	1,509,322.91	2.13
57	POP MART INTERNATIONAL GROUP	9992 HK	1,506,769.71	2.12
58	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	1,469,478.46	2.07
59	HOME DEPOT INC	HD US	1,460,953.94	2.06
60	TINGYI (CAYMAN ISLANDS) HOLDING CO	322 HK	1,452,543.15	2.05
61	RLX Technology Inc	RLX US	1,443,543.78	2.03
62	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,439,579.64	2.03
63	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	1888 HK	1,429,083.77	2.01
64	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	1,427,970.89	2.01
65	BILIBILI INC-ADR	BILI US	1,422,554.45	2

注：买入金额不包括相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	6,053,185.35	8.53
2	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	1772 HK	4,850,178.13	6.83
3	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	4,690,051.86	6.61



4	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	4,666,347.89	6.57
5	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	4,232,568.67	5.96
6	INMODE LTD	INMD US	3,904,268.20	5.5
7	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1585 HK	3,825,542.98	5.39
8	Atlas Air Worldwide Holdings I	AAWW US	3,278,054.58	4.62
9	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	3,251,011.54	4.58
10	BOEING CO	BA US	3,214,312.63	4.53
11	CHINA MOBILE LTD	941 HK	3,168,413.54	4.46
12	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	881 HK	3,147,000.12	4.43
13	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	6969 HK	2,923,956.59	4.12
14	CNOOC LTD	883 HK	2,905,222.01	4.09
15	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	2,794,709.03	3.94
16	Louisiana-Pacific Corp	LPX US	2,770,526.46	3.9
17	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	2,553,658.86	3.6
18	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	3993 HK	2,538,891.12	3.58
19	MINTH GROUP LTD	425 HK	2,467,581.19	3.48
20	BYD CO LTD-H	1211 HK	2,241,441.22	3.16
21	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	2,198,366.25	3.1
22	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	2,180,504.69	3.07
23	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	2,142,915.04	3.02
24	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	2,115,719.96	2.98
25	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	2,092,613.99	2.95
26	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	2,039,042.21	2.87
27	Tencent Music Entertainment	TME US	2,008,965.72	2.83
28	WH GROUP LTD	288 HK	1,889,876.10	2.66
29	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9922 HK	1,857,736.96	2.62

30	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	1,752,197.94	2.47
31	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	1,747,272.93	2.46
32	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	1,737,057.29	2.45
33	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	1,662,173.35	2.34
34	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	1,660,192.99	2.34
35	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	1658 HK	1,653,057.08	2.33
36	CHINA LESSOR GROUP HOLDINGS LTD	2128 HK	1,648,447.82	2.32
37	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	1,638,180.98	2.31
38	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	669 HK	1,636,505.08	2.3
39	SHENZHEN INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	1,633,125.76	2.3
40	AIA GROUP LTD	1299 HK	1,603,885.42	2.26
41	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,597,451.78	2.25
42	CHINA TELECOM CORPORATION LTD-H	728 HK	1,593,303.64	2.24
43	PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY	1833 HK	1,571,187.34	2.21
44	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	1,545,530.99	2.18
45	HOME DEPOT INC	HD US	1,523,580.89	2.15
46	RLX Technology Inc	RLX US	1,519,730.61	2.14
47	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	1,476,340.90	2.08
48	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	1,467,617.55	2.07
49	Taiwan Semiconductor-SP	TSM US	1,450,036.05	2.04
50	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	1888 HK	1,443,764.03	2.03

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	207,638,980.24
------------	----------------

卖出收入（成交）总额	177,627,627.93
------------	----------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

致远基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的工商银行（1398.HK）的发行人中国工商银行股份有限公司于 2021 年 01 月 08 日公告，因公司存在以下违规行为：一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；二、关键岗位未进行实质性轮岗；三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；四、为同业投资业务提供隐性担保；五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；六、非标准化债权资产限额测算不准确；七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例；八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；九、为违规的政府购买服务项目提供融资；十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；十五、全权委托业务不规范；十六、用其他资金支付结构性存款收益；十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；十八、理财资金承接本行自营贷款；十九、封闭式理财产品相互交易调节收益；二十、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益；二十一、高净值客户认定不审慎；二十二、理财产品信息披露不到位；二十三、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记；于 2020

年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 5470 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。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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	581,996.65
2	应收证券清算款	1,592,652.64
3	应收股利	1,124,805.13
4	应收利息	1,168.36
5	应收申购款	130,726.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,431,348.92

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.11.6 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	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

级别			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华宝致远混合 A	5,348	11,424.38	57,713,185.21	94.46	3,384,384.95	5.54
华宝致远混合 C	9,303	1,466.71	2,653,575.69	19.45	10,991,213.84	80.55
合计	14,651	5,101.52	60,366,760.90	80.77	14,375,598.79	19.23

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	华宝致远混合 A	392,571.63	0.6425
	华宝致远混合 C	23,812.93	0.1745
	合计	416,384.56	0.5571

## 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	华宝致远混合 A	10~50
	华宝致远混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝致远混合 A	10~50
	华宝致远混合 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝致远混合 A	华宝致远混合 C
基金合同生效日 (2019 年 11 月 27 日) 基金份额总额	100,018,288.17	108,882,342.78
本报告期期初基金份 额总额	51,524,620.24	1,228,853.16
本报告期基金总申购 份额	12,074,246.82	19,634,251.94
减：本报告期基金总 赎回份额	2,501,296.90	7,218,315.57
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	61,097,570.16	13,644,789.53

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	219,769,589.45	57.04%	175,815.68	68.00%	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	1	136,876,800.94	35.53%	54,750.52	21.18%	-
J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	1	26,908,804.57	6.98%	10,763.51	4.16%	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	1	1,723,173.54	0.45%	17,231.74	6.66%	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2、本报告期无新增交易单元。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	15,206,527.12	58.05%
J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	10,989,214.86	41.95%
China International Capital corporation HK Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	华宝致远混合型证券投资基金(QDII) 2020年第4季度报告	2021-1-22	基金管理人网站
2	华宝致远混合型证券投资基金(QDII) 2021年第1季度报告	2021-4-22	基金管理人网站
3	华宝致远混合型证券投资基金(QDII) 2020年年度报告	2021-3-31	基金管理人网站
4	关于华宝致远混合型证券投资基金(QDII) 2021年开放日的提示性公告	2021-1-4	基金管理人网站, 上海证券报



5	华宝致远混合型证券投资基金(QDII)新增招商银行为代销机构的公告	2021-2-2	基金管理人网站, 上海证券报
6	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
7	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, 中国证券报
8	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
9	华宝基金管理有限公司关于提示投资者完善身份信息公告	2021-3-9	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
10	华宝基金关于旗下部分开放式基金参加交通银行申购及定投手续费率优惠活动的公告	2021-6-30	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	关于警惕冒用华宝基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	2021-2-19	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	华宝基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	2021-6-22	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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101~202	50,001,250.0	0.00	0.00	50,001,250.00	66.90

	10630	0		
产品特有风险				
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>				

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 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；  
 华宝致远混合型证券投资基金（QDII）基金合同；  
 华宝致远混合型证券投资基金（QDII）招募说明书；  
 华宝致远混合型证券投资基金（QDII）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