

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	59
7.1 期末基金资产组合情况	59
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	61
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64

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	64
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	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 市场中性策略执行情况	65
7.13 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末上市基金前十名持有人	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证全指证券公司 ETF
场内简称	券商 ETF
基金主代码	512000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 30 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,117,617,683.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 9 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 1、组合复制策略 本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 2、替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 3、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 4、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运

	用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	021-60637111
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		孔祥清	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	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	中国证券登记结算有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
---------------	-------------------------------------

本期已实现收益	55,707,094.72
本期利润	92,724,743.13
加权平均基金份额本期利润	0.0084
本期加权平均净值利润率	0.92%
本期基金份额净值增长率	-2.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-425,388,966.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0351
期末基金资产净值	11,692,228,716.32
期末基金份额净值	0.9649
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.51%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.99%	1.80%	11.78%	1.81%	0.21%	-0.01%
过去三个月	9.61%	1.47%	9.34%	1.48%	0.27%	-0.01%
过去六个月	-2.64%	2.19%	-2.81%	2.20%	0.17%	-0.01%
过去一年	2.43%	1.87%	1.44%	1.88%	0.99%	-0.01%
过去三年	0.58%	1.97%	-4.73%	1.98%	5.31%	-0.01%

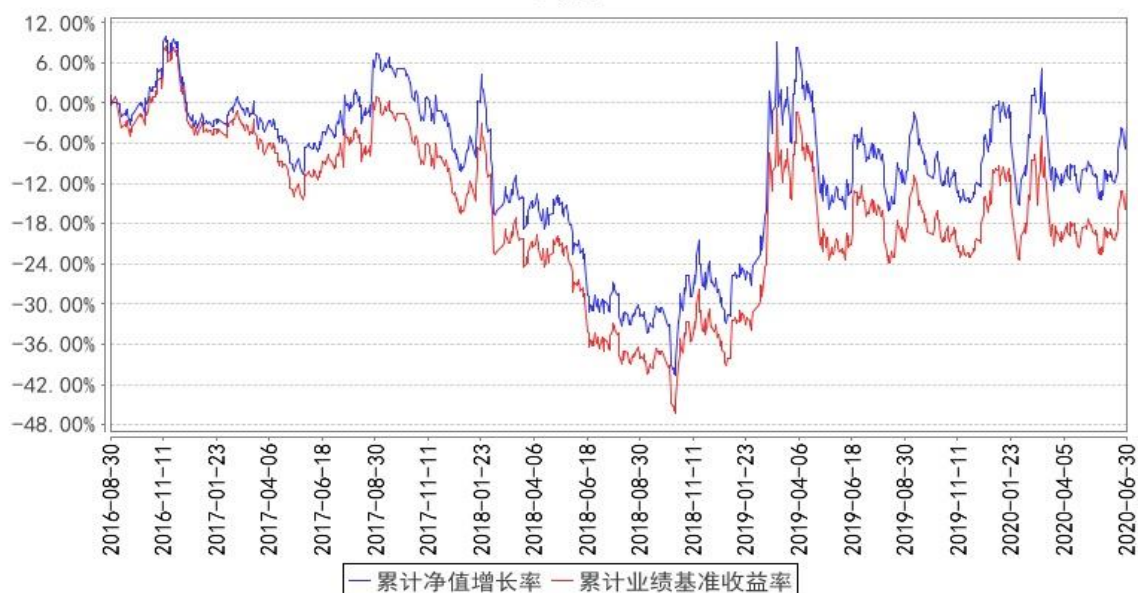
自基金合同生效起至今	-3.51%	1.79%	-12.95%	1.81%	9.44%	-0.02%
------------	--------	-------	---------	-------	-------	--------

注：1、本基金业绩比较基准为：中证全指证券公司指数。

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

华宝中证全指证券公司ETF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：本基金基金合同生效于 2016 年 8 月 30 日，按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2017 年 2 月 28 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2020 年 6 月 30 日），正在管理运作的证券投资基金分别为：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、华宝多策略增长开放式证券投资基金、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、华宝收益增长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、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、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、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国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、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、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、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数证券投资基金 (LOF)、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、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝大健康混合型证券投资基金、华宝中短债债券型发起式证券投资基金、华宝宝裕纯债债券型证券投资基金、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、华宝宝盛纯债债券型证券投资基金、华宝消费升级混合型证券投资基金、华宝宝怡纯债债券型证券投资基金、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、华宝政策性金融债债券型证券投资基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金、华宝宝润纯债债券型证券投资基金、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF)、华宝成长策略混合型证券投资基金、华宝红利精选混合型证券投资基金。

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		
丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接、华宝中证 1000 指数分级基金经理	2016 年 8 月 30 日	-	10	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理、基金经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2018 年 8 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》及其各项实施细则、《华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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

A股市场除了因疫情爆发在春节前后出现了恐慌性的下跌外，二月开始走出报复性反弹行情，随着反弹持续到2月下旬，A股成交额破万亿，直到3月中下旬受海外疫情蔓延，A股出现了明显的下滑，二季度虽然A股整体振荡攀升，但受市场成交额没有明显放大，券商板块二季度表现较为平淡。从上半年券商行业业绩数据上看，受益于尤其是一季度市场火热行情，券商的经纪、投行、资管、信用等业务条线都有增长，财务数据普遍比去年同期增长明显。上半年日均两市交易

额 7000 亿左右，较去年同期仍有明显增加。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-2.64%，业绩比较基准收益率为-2.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

资本市场在服务实体经济、防范化解重大风险、守住不发生系统性金融风险的底线的要求下继续深化改革，对券商行业来说，科创板 7 月迎来上市一周年，政策红利释放吸引各类企业登陆科创板、同时创业板注册制稳步推进，放宽涨跌幅比例限制到 20%有望进一步激发市场交易活跃度，我们预计监管政策呵护市场健康发展的趋势不变，新的资本市场基础制度改革和完善，以及随着增量资金入市进程持续，券商行业对外开放势头明显，券商将享受流动性和政策环境的双重改善，迸发出更强的成长性。

作为指数基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

（1）日常估值流程

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

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配,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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	15,008,885.31	163,703,303.91
结算备付金		8,374,908.25	3,327,895.15
存出保证金		2,396,779.30	684,838.06
交易性金融资产	6.4.7.2	11,678,974,225.36	5,668,364,650.99
其中：股票投资		11,678,974,225.36	5,668,364,650.99
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		79,511,288.95	88,974,533.31
应收利息	6.4.7.5	316,703.11	222,078.72
应收股利		460,779.20	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,785,043,569.48	5,925,277,300.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		56,702,412.80	237,905,042.24
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		4,984,042.91	2,293,365.54
应付托管费		996,808.57	458,673.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,159,496.19	3,614,890.19
应交税费		18,042.86	9,514.13
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	24,954,049.83	593,008.29
负债合计		92,814,853.16	244,874,493.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,117,617,683.00	5,731,217,683.00
未分配利润	6.4.7.10	-425,388,966.68	-50,814,876.32
所有者权益合计		11,692,228,716.32	5,680,402,806.68
负债和所有者权益总计		11,785,043,569.48	5,925,277,300.14

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9649 元，基金份额总额 12117617683 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		140,181,564.34	373,409,198.96
1. 利息收入		3,405,840.49	158,448.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	261,197.95	158,448.09
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		3,144,642.54	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		85,351,093.26	292,250,336.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	48,628,400.42	288,666,665.82
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	36,722,692.84	3,583,670.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	37,017,648.41	65,571,135.50
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	14,406,982.18	15,429,279.18
减：二、费用		47,456,821.21	15,555,038.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,818,490.11	5,673,152.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,963,698.00	1,134,630.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,074,021.81	8,292,910.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		11,320.84	-
7. 其他费用	6.4.7.20	1,589,290.45	454,345.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		92,724,743.13	357,854,160.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,724,743.13	357,854,160.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	5,731,217,683.00	-50,814,876.32	5,680,402,806.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	92,724,743.13	92,724,743.13
三、本期基金份额交易产生的基金净	6,386,400,000.00	-467,298,833.49	5,919,101,166.51

值变动数 (净值减少 以“-”号填 列)			
其中:1. 基金 申购款	20,041,500,000.0 0	-1,249,734,061 .48	18,791,765,938.52
2. 基 金赎回款	-13,655,100,000. 00	782,435,227.99	-12,872,664,772.01
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)	12,117,617,683.0 0	-425,388,966.6 8	11,692,228,716.32
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有 者权益(基金 净值)	1,441,817,683.00	-456,556,851.7 1	985,260,831.29
二、本期经营 活动产生的 基金净值变 动数(本期利 润)	-	357,854,160.04	357,854,160.04
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)	1,941,300,000.00	-97,378,712.24	1,843,921,287.76
其中:1. 基金 申购款	11,406,900,000.0 0	-457,249,947.0 8	10,949,650,052.92
2. 基 金赎回款	-9,465,600,000.0 0	359,871,234.84	-9,105,728,765.16
四、本期向基 金份额持有 人分配利润 产生的基金	-	-	-

净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,383,117,683.00	-196,081,403.91	3,187,036,279.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4

财务报表由下列负责人签署：

黄小薏

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金(原名为华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1152号《关于准予华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币642,017,683.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1061号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2016年8月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为642,017,683.00份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]230号核准,本基金于2016年9月14日在上交所挂牌交易。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金于2017年12月30日起更名为华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于中证全指证券公司指数成份股和备选成份股,

也可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；权证、股指期货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。本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数。

本基金的财务报表于 2020 年 8 月 31 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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

—

6.4.5.2 会计估计变更的说明

—

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	15,008,885.31
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	15,008,885.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,228,733,318.40	11,678,974,225.36	450,240,906.96
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	11,228,733,318.40	11,678,974,225.36	450,240,906.96

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,489.59
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	3,768.70
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	306,366.22
其他	1,078.60
合计	316,703.11

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,159,496.19
银行间市场应付交易费用	—
合计	5,159,496.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	851,151.21
应退替代款	23,960,840.60
可退替代款	57,522.66

合计	24,954,049.83
----	---------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,731,217,683.00	5,731,217,683.00
本期申购	20,041,500,000.00	20,041,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,655,100,000.00	-13,655,100,000.00
- 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	12,117,617,683.00	12,117,617,683.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	741,746,952.47	-792,561,828.79	-50,814,876.32
本期利润	55,707,094.72	37,017,648.41	92,724,743.13
本期基金份额交易产生的变动数	926,307,479.96	-1,393,606,313.45	-467,298,833.49
其中：基金申购款	2,882,699,721.16	-4,132,433,782.64	-1,249,734,061.48
基金赎回款	-1,956,392,241.20	2,738,827,469.19	782,435,227.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,723,761,527.15	-2,149,150,493.83	-425,388,966.68

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	139,114.12
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	108,565.30
其他	13,518.53
合计	261,197.95

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	59,845,583.23

股票投资收益——赎回差价收入	-11,217,182.81
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	48,628,400.42

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	4,740,661,320.11
减：卖出股票成本总额	4,680,815,736.88
买卖股票差价收入	59,845,583.23

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	12,872,664,772.01
减：现金支付赎回款总额	3,798,596,241.01
减：赎回股票成本总额	9,085,285,713.81
赎回差价收入	-11,217,182.81

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	36,722,692.84
其中：证券出借权益补偿收入	1,175,996.98
基金投资产生的股利收益	—
合计	36,722,692.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	37,017,648.41
股票投资	37,017,648.41
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	37,017,648.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	14,406,982.18
合计	14,406,982.18

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	16,074,021.81
银行间市场交易费用	-
合计	16,074,021.81

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	15,645.69
指数使用费	1,489,109.40
合计	1,589,290.45

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“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
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司
华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“中证全指联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华宝证券	399,191.00	0.00	85,089,659.72	1.48

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华宝证券	371.78	0.00	371.78	0.01

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,818,490.11	5,673,152.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,963,698.00	1,134,630.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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（%）
中国建设银行 股份有限公司- 华宝中证全指 证券公司交易 型开放式指数 证券投资基金 发起式联接基 金	1,533,448,578.00	12.65	401,284,200.00	7.00

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	15,008,885.31	139,114.12	22,572,276.80	107,133.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 07 月 10 日	配股流通受限	5.00	6.54	4,807,680	24,038,400.00	31,442,227.20	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 07 月 02 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 07 月 03 日	新股 流通 受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 07 月 01 日	新股 流通 受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船 汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 07 月 09 日	新股 流通 受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688004	博汇 科技	2020 年 6 月 5 日	2020 年 12 月 14 日	新股 流通 受限	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-
688027	国盾 量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 07 月 09 日	新股 流通 受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688081	兴图 新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 7 月 6 日	科创 板锁 定	28.21	42.01	3,153	88,946.13	132,457.53	-
688086	紫晶 存储	2020 年 2 月 19 日	2020 年 8 月 26 日	科创 板锁 定	21.49	64.54	9,361	201,167.89	604,158.94	-
688277	天智 航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 07 月 07 日	新股 流通 受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 07 月 08 日	新股 流通 受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688466	金科 环境	2020 年 4 月 27 日	2020 年 11 月 9 日	新股 流通 受限	24.61	36.59	4,907	120,761.27	179,547.13	-
688516	奥特 维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	新股 流通 受限	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-
688528	秦川 物联	2020 年 6 月	2020 年 07	新股 流通	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-

		19 日	月 01 日	受限						
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 07 月 03 日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

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，锁定期限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

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
2020060800000335	000686	东北证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	8.45	72,000	608,400.00

2020 0623 0000 0191	000686	东北证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	8.45	81,000	684,450 .00
2020 0610 0000 3040	000686	东北证券	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	8.45	72,000	608,400 .00
2020 0629 0000 2734	000686	东北证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	8.45	200,000	1,690,0 00.00
2020 0604 0000 0315	000686	东北证券	2020 年 6 月 4 日	2020 年 7 月 2 日	8.45	10,000	84,500. 00
2020 0615 0000 0297	000686	东北证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	8.45	100,000	845,000 .00
2020 0604 0000 2531	000712	锦龙股份	2020 年 6 月 4 日	2020 年 7 月 2 日	12.50	40,500	506,250 .00
2020 0610 0000 3038	000712	锦龙股份	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	12.50	64,000	800,000 .00
2020 0623 0000 0190	000712	锦龙股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	12.50	80,000	1,000,0 00.00
2020 0615 0000 0306	000712	锦龙股份	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	12.50	417,000	5,212,5 00.00
2020 0608 0000 0358	000712	锦龙股份	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	12.50	64,000	800,000 .00
2020 0615 0000 0330	000750	国海证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	4.34	40,900	177,506 .00
2020	000750	国海证券	2020 年 6 月	2020 年 7	4.34	119,000	516,460

0615 0000 0332			15 日	月 13 日			. 00
2020 0608 0000 0367	000750	国海证券	2020年6月8 日	2020 年 7 月 6 日	4. 34	93, 000	403, 620 . 00
2020 0623 0000 0206	000776	广发证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	14. 12	1, 000, 00 0	14, 120, 000. 00
2020 0623 0000 0197	000776	广发证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	14. 12	610, 600	8, 621, 6 72. 00
2020 0629 0000 2732	000783	长江证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	6. 74	250, 000	1, 685, 0 00. 00
2020 0608 0000 0569	002500	山西证券	2020年6月8 日	2020 年 7 月 6 日	6. 54	86, 000	562, 440 . 00
2020 0629 0000 3706	002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	6. 54	26, 900	175, 926 . 00
2020 0615 0000 0740	002500	山西证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	6. 54	122, 000	797, 880 . 00
2020 0629 0000 0521	002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	6. 54	314, 500	2, 056, 8 30. 00
2020 0624 0000 2571	002670	国盛金控	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	9. 15	10, 000	91, 500. 00
2020 0616 0000 3024	002670	国盛金控	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	9. 15	34, 000	311, 100 . 00
2020 0629	002670	国盛金控	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	9. 15	75, 400	689, 910 . 00

0000 0555							
2020 0623 0000 0324	002670	国盛金控	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	9.15	20,000	183,000 .00
2020 0608 0000 0587	002670	国盛金控	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	9.15	10,000	91,500. 00
2020 0622 0000 4964	002670	国盛金控	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	9.15	61,200	559,980 .00
2020 0610 0000 3034	002670	国盛金控	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	9.15	67,000	613,050 .00
2020 0630 0000 1824	002670	国盛金控	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	9.15	110,300	1,009,2 45.00
2020 0608 0000 0596	002670	国盛金控	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	9.15	68,000	622,200 .00
2020 0622 0001 2632	002670	国盛金控	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	9.15	43,500	398,025 .00
2020 0623 0000 0316	002670	国盛金控	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	9.15	12,000	109,800 .00
2020 0611 0000 0240	002670	国盛金控	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	9.15	46,400	424,560 .00
2020 0619 0000 1283	002670	国盛金控	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	9.15	10,000	91,500. 00
2020 0610 0000	002670	国盛金控	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	9.15	29,000	265,350 .00

0272							
2020 0615 0000 0796	002670	国盛金控	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	9.15	36,600	334,890 .00
2020 0609 0000 0399	002670	国盛金控	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	9.15	29,000	265,350 .00
2020 0624 0000 6567	002673	西部证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	8.16	23,700	193,392 .00
2020 0618 0000 2538	002673	西部证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	8.16	14,200	115,872 .00
2020 0622 0001 2684	002797	第一创业	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	6.92	10,000	69,200. 00
2020 0615 0000 0813	002797	第一创业	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	6.92	735,000	5,086,2 00.00
2020 0610 0000 3032	002926	华西证券	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	10.63	78,000	829,140 .00
2020 0608 0000 0615	002926	华西证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	10.63	77,000	818,510 .00
2020 0623 0000 0326	002926	华西证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	10.63	91,000	967,330 .00
2020 0615 0000 0832	002926	华西证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	10.63	491,000	5,219,3 30.00
2020 0604 0000 0497	002926	华西证券	2020 年 6 月 4 日	2020 年 7 月 2 日	10.63	10,000	106,300 .00

2020 0623 0000 1566	002926	华西证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	10.63	77,000	818,510 .00
2020 0609 0000 0416	002939	长城证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	12.32	64,100	789,712 .00
2020 0616 0000 6988	002939	长城证券	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	12.32	20,000	246,400 .00
2020 0604 0000 0498	002939	长城证券	2020 年 6 月 4 日	2020 年 7 月 2 日	12.32	10,000	123,200 .00
2020 0623 0000 1666	300059	东方财富	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	20.20	10,000	202,000 .00
2020 0616 0000 7566	300059	东方财富	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	20.20	38,700	781,740 .00
2020 0629 0000 0621	300059	东方财富	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	20.20	126,000	2,545,2 00.00
2020 0630 0000 1975	300059	东方财富	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	20.20	40,000	808,000 .00
2020 0618 0000 0460	300059	东方财富	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	20.20	20,000	404,000 .00
2020 0615 0000 0873	300059	东方财富	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	20.20	40,000	808,000 .00
2020 0623 0000 0371	300059	东方财富	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	20.20	20,000	404,000 .00
2020	300059	东方财富	2020 年 6 月	2020 年 7	20.20	60,000	1,212,0

0616 0000 3205			16 日	月 14 日			00.00
2020 0624 0000 2713	300059	东方财富	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	20.20	10,000	202,000 .00
2020 0618 0000 0461	300059	东方财富	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	20.20	20,000	404,000 .00
2020 0623 0000 0373	300059	东方财富	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	20.20	60,000	1,212,0 00.00
2020 0605 0000 7438	600030	中信证券	2020 年 6 月 5 日	2020 年 7 月 3 日	24.11	100,000	2,411,0 00.00
2020 0618 0000 2988	600030	中信证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	24.11	700,000	16,877, 000.00
2020 0618 0000 2984	600030	中信证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	24.11	1,000,00 0	24,110, 000.00
2020 0605 0000 7434	600030	中信证券	2020 年 6 月 5 日	2020 年 7 月 3 日	24.11	200,000	4,822,0 00.00
2020 0623 0000 0650	600061	国投资本	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	12.73	14,000	178,220 .00
2020 0624 0000 6569	600061	国投资本	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	12.73	15,800	201,134 .00
2020 0609 0000 0539	600109	国金证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	11.41	20,000	228,200 .00
2020 0609	600109	国金证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	11.41	28,000	319,480 .00

0000 0543							
2020 0623 0000 0605	600109	国金证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	11.41	80,000	912,800 .00
2020 0615 0000 1088	600109	国金证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	11.41	30,000	342,300 .00
2020 0623 0000 0661	600155	华创阳安	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	11.99	175,000	2,098,2 50.00
2020 0624 0000 6571	600155	华创阳安	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	11.99	16,400	196,636 .00
2020 0610 0000 3030	600155	华创阳安	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	11.99	69,000	827,310 .00
2020 0619 0000 1285	600155	华创阳安	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	11.99	14,300	171,457 .00
2020 0615 0000 1404	600155	华创阳安	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	11.99	84,000	1,007,1 60.00
2020 0622 0001 2636	600155	华创阳安	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	11.99	10,000	119,900 .00
2020 0623 0000 0671	600155	华创阳安	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	11.99	82,000	983,180 .00
2020 0608 0000 0971	600155	华创阳安	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	11.99	69,000	827,310 .00
2020 0604 0000	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 4 日	2020 年 7 月 2 日	19.30	300,000	5,790,0 00.00

0789							
2020 0624 0000 1268	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	19.30	140,000	2,702,0 00.00
2020 0615 0000 1694	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	19.30	30,000	579,000 .00
2020 0622 0001 2682	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	19.30	30,000	579,000 .00
2020 0623 0000 1780	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	19.30	10,000	193,000 .00
2020 0619 0000 1627	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 3 日	19.30	29,800	575,140 .00
2020 0610 0000 2822	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	19.30	210,000	4,053,0 00.00
2020 0617 0001 2387	600621	华鑫股份	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	19.30	50,000	965,000 .00
2020 0618 0000 2982	600837	海通证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	12.58	1,000,00 0	12,580, 000.00
2020 0618 0000 2992	600837	海通证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	12.58	510,000	6,415,8 00.00
2020 0618 0000 2996	600837	海通证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	12.58	990,000	12,454, 200.00
2020 0618 0000 2994	600837	海通证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	12.58	980,000	12,328, 400.00

2020 0610 0000 3036	600864	哈投股份	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	6.01	90,000	540,900 .00
2020 0608 0000 1187	600864	哈投股份	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	6.01	93,000	558,930 .00
2020 0630 0000 3810	600864	哈投股份	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	6.01	33,600	201,936 .00
2020 0603 0000 0505	600864	哈投股份	2020 年 6 月 3 日	2020 年 7 月 1 日	6.01	10,000	60,100. 00
2020 0615 0000 1737	600864	哈投股份	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	6.01	127,000	763,270 .00
2020 0619 0000 1625	600909	华安证券	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	6.83	59,500	406,385 .00
2020 0624 0000 0962	600909	华安证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	6.83	84,100	574,403 .00
2020 0619 0000 1623	600909	华安证券	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	6.83	48,900	333,987 .00
2020 0623 0000 0681	600909	华安证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	6.83	17,000	116,110 .00
2020 0608 0000 0827	600909	华安证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	6.83	83,000	566,890 .00
2020 0630 0000 2561	600909	华安证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	6.83	25,300	172,799 .00
2020	600909	华安证券	2020 年 6 月	2020 年 7	6.83	114,000	778,620

0615 0000 1233			15 日	月 13 日			. 00
2020 0609 0000 0557	600909	华安证券	2020年6月9 日	2020年7 月7日	6.83	130,000	887,900 .00
2020 0609 0000 0554	600909	华安证券	2020年6月9 日	2020年7 月7日	6.83	25,300	172,799 .00
2020 0604 0000 0636	600909	华安证券	2020年6月4 日	2020年7 月2日	6.83	10,000	68,300. 00
2020 0616 0000 6986	600909	华安证券	2020年6月 16日	2020年7 月14日	6.83	50,000	341,500 .00
2020 0618 0000 2990	600958	东方证券	2020年6月 18日	2020年7 月16日	9.49	190,000	1,803,1 00.00
2020 0629 0000 2736	600958	东方证券	2020年6月 29日	2020年7 月27日	9.49	170,000	1,613,3 00.00
2020 0623 0000 0722	600958	东方证券	2020年6月 23日	2020年7 月21日	9.49	73,000	692,770 .00
2020 0630 0000 3757	600999	招商证券	2020年6月 30日	2020年7 月28日	21.95	100,000	2,195,0 00.00
2020 0630 0000 3679	600999	招商证券	2020年6月 30日	2020年7 月14日	21.95	333,300	7,315,9 35.00
2020 0603 0000 0981	600999	招商证券	2020年6月3 日	2020年7 月1日	21.95	1,000,00 0	21,950, 000.00
2020 0618	600999	招商证券	2020年6月 18日	2020年7 月16日	21.95	600,000	13,170, 000.00

0000 2986							
2020 0605 0000 7436	600999	招商证券	2020年6月5 日	2020年7 月3日	21.95	200,000	4,390,0 00.00
2020 0629 0000 1182	600999	招商证券	2020年6月 29日	2020年7 月13日	21.95	60,000	1,317,0 00.00
2020 0603 0000 1791	600999	招商证券	2020年6月3 日	2020年7 月1日	21.95	100,000	2,195,0 00.00
2020 0605 0000 7440	600999	招商证券	2020年6月5 日	2020年7 月3日	21.95	1,000,00 0	21,950, 000.00
2020 0630 0000 3742	600999	招商证券	2020年6月 30日	2020年7 月28日	21.95	100,000	2,195,0 00.00
2020 0630 0000 3620	600999	招商证券	2020年6月 30日	2020年7 月14日	21.95	150,000	3,292,5 00.00
2020 0629 0000 2730	600999	招商证券	2020年6月 29日	2020年7 月27日	21.95	600,000	13,170, 000.00
2020 0604 0000 0612	601066	中信建投	2020年6月4 日	2020年7 月2日	39.38	300,000	11,814, 000.00
2020 0623 0000 0595	601066	中信建投	2020年6月 23日	2020年7 月21日	39.38	225,000	8,860,5 00.00
2020 0616 0000 8160	601066	中信建投	2020年6月 16日	2020年7 月14日	39.38	100,000	3,938,0 00.00
2020 0609 0000	601066	中信建投	2020年6月9 日	2020年7 月7日	39.38	130,000	5,119,4 00.00

4363							
2020 0610 0000 2826	601066	中信建投	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	39.38	60,000	2,362,8 00.00
2020 0608 0000 3363	601066	中信建投	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	39.38	130,000	5,119,4 00.00
2020 0615 0000 4722	601066	中信建投	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	39.38	30,000	1,181,4 00.00
2020 0618 0000 0614	601066	中信建投	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	39.38	130,000	5,119,4 00.00
2020 0615 0000 1463	601099	太平洋	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	3.17	160,000	507,200 .00
2020 0608 0000 1051	601099	太平洋	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	3.17	125,000	396,250 .00
2020 0630 0000 4046	601099	太平洋	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	3.17	303,800	963,046 .00
2020 0619 0000 1287	601099	太平洋	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	3.17	59,300	187,981 .00
2020 0624 0000 2527	601099	太平洋	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	3.17	35,000	110,950 .00
2020 0623 0000 0696	601099	太平洋	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	3.17	154,000	488,180 .00
2020 0603 0000 0845	601099	太平洋	2020 年 6 月 3 日	2020 年 7 月 1 日	3.17	30,000	95,100. 00

2020 0609 0000 0621	601099	太平洋	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	3.17	120,000	380,400 .00
2020 0629 0000 1286	601099	太平洋	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	3.17	286,700	908,839 .00
2020 0629 0000 1055	601099	太平洋	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	3.17	87,100	276,107 .00
2020 0630 0000 2528	601108	XD 财通证	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	10.25	10,000	102,500 .00
2020 0624 0000 6573	601108	XD 财通证	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	10.25	20,000	205,000 .00
2020 0608 0000 0813	601162	天风证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	6.06	200,000	1,212,0 00.00
2020 0616 0000 1115	601162	天风证券	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	6.06	300,000	1,818,0 00.00
2020 0629 0000 1258	601162	天风证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	6.06	106,900	647,814 .00
2020 0616 0000 1156	601162	天风证券	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	6.06	490,000	2,969,4 00.00
2020 0623 0000 0610	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	200,000	1,212,0 00.00
2020 0623 0000 0639	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	75,000	454,500 .00
2020	601162	天风证券	2020 年 6 月	2020 年 7	6.06	175,000	1,060,5

0623 0000 0614			23 日	月 21 日			00.00
2020 0617 0000 1764	601162	天风证券	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	6.06	85,000	515,100 .00
2020 0622 0000 4817	601162	天风证券	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	6.06	100,000	606,000 .00
2020 0623 0000 0621	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	669,000	4,054,1 40.00
2020 0623 0000 1662	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	30,000	181,800 .00
2020 0630 0000 8342	601162	天风证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	6.06	200,000	1,212,0 00.00
2020 0623 0000 1778	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	280,000	1,696,8 00.00
2020 0618 0000 0629	601162	天风证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	6.06	50,000	303,000 .00
2020 0618 0000 0638	601162	天风证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	6.06	150,000	909,000 .00
2020 0630 0000 2545	601162	天风证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	6.06	33,400	202,404 .00
2020 0630 0000 2555	601162	天风证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	6.06	10,000	60,600. 00
2020 0609	601162	天风证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	6.06	400,000	2,424,0 00.00

0000 0548							
2020 0615 0000 1225	601162	天风证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	6.06	50,000	303,000 .00
2020 0623 0000 0634	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	30,000	181,800 .00
2020 0615 0000 1204	601162	天风证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	6.06	217,800	1,319,8 68.00
2020 0617 0000 1724	601162	天风证券	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	6.06	100,000	606,000 .00
2020 0618 0000 0633	601162	天风证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	6.06	20,000	121,200 .00
2020 0610 0000 0331	601162	天风证券	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	6.06	700,000	4,242,0 00.00
2020 0629 0000 1226	601198	东兴证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	10.90	25,900	282,310 .00
2020 0624 0000 0601	601236	红塔证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	19.40	700,000	13,580, 000.00
2020 0610 0000 2824	601236	红塔证券	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	19.40	150,000	2,910,0 00.00
2020 0608 0000 1061	601375	中原证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	4.70	85,000	399,500 .00
2020 0630 0000	601375	中原证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	4.70	43,400	203,980 .00

3359							
2020 0630 0000 3608	601375	中原证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	4.70	125,700	590,790 .00
2020 0618 0000 2536	601375	中原证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	4.70	44,100	207,270 .00
2020 0610 0000 3028	601375	中原证券	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	4.70	83,000	390,100 .00
2020 0618 0000 0874	601375	中原证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 2 日	4.70	125,700	590,790 .00
2020 0615 0000 1522	601375	中原证券	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月 13 日	4.70	109,000	512,300 .00
2020 0630 0000 3768	601377	兴业证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	6.85	140,000	959,000 .00
2020 0609 0000 3011	601377	兴业证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	6.85	720,000	4,932,0 00.00
2020 0609 0000 1395	601377	兴业证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	6.85	730,000	5,000,5 00.00
2020 0609 0000 2733	601377	兴业证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	6.85	800,000	5,480,0 00.00
2020 0609 0000 1347	601377	兴业证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	6.85	700,000	4,795,0 00.00
2020 0630 0000 2639	601555	东吴证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	8.16	10,000	81,600. 00

2020 0619 0000 0472	601555	东吴证券	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 3 日	8.16	100,000	816,000 .00
2020 0623 0000 0798	601788	光大证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	16.06	330,000	5,299,8 00.00
2020 0624 0000 2257	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	16.06	300,000	4,818,0 00.00
2020 0624 0000 1971	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	16.06	210,000	3,372,6 00.00
2020 0624 0000 1964	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	16.06	860,000	13,811, 600.00
2020 0622 0000 3916	601788	光大证券	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	16.06	452,000	7,259,1 20.00
2020 0624 0000 1983	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	16.06	95,300	1,530,5 18.00
2020 0624 0000 1988	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	16.06	40,000	642,400 .00
2020 0624 0000 2231	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	16.06	280,000	4,496,8 00.00
2020 0623 0000 0808	601788	光大证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	16.06	330,000	5,299,8 00.00
2020 0624 0000 1976	601788	光大证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	16.06	370,000	5,942,2 00.00
2020	601788	光大证券	2020 年 6 月	2020 年 7	16.06	247,000	3,966,8

0624 0000 2218			24 日	月 22 日			20.00
2020 0623 0000 0812	601788	光大证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	16.06	630,000	10,117, 800.00
2020 0623 0000 0665	601878	浙商证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	9.91	98,000	971,180 .00
2020 0605 0000 0594	601878	浙商证券	2020 年 6 月 5 日	2020 年 7 月 3 日	9.91	100,000	991,000 .00
2020 0618 0000 2540	601878	浙商证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	9.91	14,300	141,713 .00
2020 0608 0000 0938	601878	浙商证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	9.91	44,500	440,995 .00
2020 0609 0000 0610	601878	浙商证券	2020 年 6 月 9 日	2020 年 7 月 7 日	9.91	12,900	127,839 .00
2020 0608 0000 0935	601878	浙商证券	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	9.91	134,400	1,331,9 04.00
2020 0624 0000 1320	601878	浙商证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	9.91	60,600	600,546 .00
2020 0623 0000 0815	601881	中国银河	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	11.47	30,000	344,100 .00
2020 0630 0000 3939	601881	中国银河	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	11.47	186,200	2,135,7 14.00
2020 0630	601881	中国银河	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	11.47	10,000	114,700 .00

0000 3913							
2020 0622 0001 2634	601901	方正证券	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	7.08	10,000	70,800. 00
2020 0605 0000 0673	601990	南京证券	2020 年 6 月 5 日	2020 年 7 月 3 日	14.27	500,000	7,135,0 00.00
2020 0603 0000 1237	601990	南京证券	2020 年 6 月 3 日	2020 年 7 月 1 日	14.27	250,000	3,567,5 00.00
2020 0624 0000 2072	601990	南京证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	14.27	1,000,00 0	14,270, 000.00
2020 0605 0000 8016	601990	南京证券	2020 年 6 月 5 日	2020 年 7 月 3 日	14.27	100,000	1,427,0 00.00
2020 0624 0000 2067	601990	南京证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	14.27	990,000	14,127, 300.00
2020 0618 0000 0891	601990	南京证券	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	14.27	300,000	4,281,0 00.00
合计	-	-	-	-	-	39,180,8 00	528,842 ,409.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。

督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本报告期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息该利息金额不重大外，本基金所承担的其他金融负债的合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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	15,008,885.31	-	-	-	15,008,885.31
结算备付金	8,374,908.25	-	-	-	8,374,908.25
存出保证金	2,396,779.30	-	-	-	2,396,779.30
交易性金融资产	-	-	-	11,678,974,225.36	11,678,974,225.36
应收利息	-	-	-	316,703.11	316,703.11
应收股利	-	-	-	460,779.20	460,779.20
应收证券清算款	-	-	-	79,511,288.95	79,511,288.95
资产总计	25,780,572.86	-	-	11,759,262,996.62	11,785,043,569.48
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,984,042.91	4,984,042.91
应付托管费	-	-	-	996,808.57	996,808.57
应付证券清算款	-	-	-	56,702,412.80	56,702,412.80
应付交易费用	-	-	-	5,159,496.19	5,159,496.19
应交税费	-	-	-	18,042.86	18,042.86
其他负债	-	-	-	24,954,049.83	24,954,049.83
负债总计	-	-	-	92,814,853.16	92,814,853.16
利率敏感度缺口	25,780,572.86	-	-	11,666,448,143.46	11,692,228,716.32

上年度末 2019 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	163,703,303.91	-	-	-	163,703,303.91
结算备付金	3,327,895.15	-	-	-	3,327,895.15
存出保证金	684,838.06	-	-	-	684,838.06
交易性金融资产	-	-	-	5,668,364,650.99	5,668,364,650.99
应收利息	-	-	-	222,078.72	222,078.72
应收证券清算款	-	-	-	88,974,533.31	88,974,533.31
资产总计	167,716,037.12	-	-	5,757,561,263.02	5,925,277,300.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,293,365.54	2,293,365.54
应付托管费	-	-	-	458,673.07	458,673.07
应付证券清算款	-	-	-	237,905,042.24	237,905,042.24
应付交易费用	-	-	-	3,614,890.19	3,614,890.19
应交税费	-	-	-	9,514.13	9,514.13
其他负债	-	-	-	593,008.29	593,008.29
负债总计	-	-	-	244,874,493.46	244,874,493.46
利率敏感度缺口	167,716,037.12	-	-	5,512,686,769.56	5,680,402,806.68

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证全指证券公司指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证全指证券公司指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	11,678,974,225.36	99.89	5,668,364,650.99	99.79
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	11,678,974,225.36	99.89	5,668,364,650.99	99.79

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	583,161,716.38	283,275,183.91
	2. 业绩比较基准下降 5%	-583,161,716.38	-283,275,183.91

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 11,677,693,532.04 元，属于第二层次的余额为 1,280,693.32 元，无属于第三层次的余额。(于上年度末：第一层次 5,667,548,469.86 元，第二层次 816,181.13 元，无第三层次)。

(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股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

§ 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	11,678,974,225.36	99.10
	其中：股票	11,678,974,225.36	99.10
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	23,383,793.56	0.20
8	其他各项资产	82,685,550.56	0.70
9	合计	11,785,043,569.48	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 528,842,409.00 元，占基金资产净值的比例为 4.52%。

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	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	11,676,967,077.32	99.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,676,967,077.32	99.87

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,617,593.52	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,847.57	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	179,547.13	0.00
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,001,754.54	0.02

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	600030	中信证券	70,051,426	1,688,939,880.86	14.44
2	300059	东方财富	54,369,917	1,098,272,323.40	9.39
3	601688	华泰证券	49,475,712	930,143,385.60	7.96
4	600837	海通证券	67,978,780	855,173,052.40	7.31
5	601211	国泰君安	37,930,333	654,677,547.58	5.60
6	600999	招商证券	24,016,538	527,163,009.10	4.51
7	000166	申万宏源	75,698,994	382,279,919.70	3.27
8	000776	广发证券	24,997,766	352,968,455.92	3.02
9	600958	东方证券	30,127,425	285,909,263.25	2.45
10	601377	兴业证券	39,367,444	269,666,991.40	2.31
11	601788	光大证券	16,411,413	263,567,292.78	2.25
12	601901	方正证券	34,604,707	245,001,325.56	2.10
13	002736	国信证券	20,711,799	234,043,328.70	2.00
14	600109	国金证券	20,302,076	231,646,687.16	1.98
15	000783	长江证券	32,585,323	219,625,077.02	1.88
16	601108	财通证券	20,977,479	215,019,159.75	1.84
17	601555	东吴证券	26,122,893	213,162,806.88	1.82
18	601990	南京证券	13,860,045	197,782,842.15	1.69
19	601099	太平洋	57,299,177	181,638,391.09	1.55
20	600061	国投资本	14,254,722	181,462,611.06	1.55
21	601162	天风证券	28,003,440	169,700,846.40	1.45
22	601066	中信建投	4,296,905	169,212,118.90	1.45
23	000728	国元证券	17,049,339	143,214,447.60	1.22
24	002797	第一创业	20,654,163	142,926,807.96	1.22
25	000750	国海证券	32,013,150	138,937,071.00	1.19

26	002500	山西证券	19,579,380	128,049,145.20	1.10
27	601198	东兴证券	11,569,747	126,110,242.30	1.08
28	600155	华创阳安	10,223,379	122,578,314.21	1.05
29	601881	中国银河	10,664,939	122,326,850.33	1.05
30	002673	西部证券	14,823,294	120,958,079.04	1.03
31	002926	华西证券	10,949,500	116,393,185.00	1.00
32	601878	浙商证券	11,184,505	110,838,444.55	0.95
33	600369	西南证券	23,671,978	108,654,379.02	0.93
34	600909	华安证券	15,088,365	103,053,532.95	0.88
35	000686	东北证券	11,778,494	99,528,274.30	0.85
36	002939	长城证券	7,792,900	96,008,528.00	0.82
37	002670	国盛金控	9,897,114	90,558,593.10	0.77
38	600621	华鑫股份	3,483,386	67,229,349.80	0.57
39	601236	红塔证券	3,310,354	64,220,867.60	0.55
40	600864	哈投股份	8,751,740	52,597,957.40	0.45
41	601375	中原证券	11,102,664	52,182,520.80	0.45
42	000712	锦龙股份	3,726,431	46,580,387.50	0.40
43	002945	华林证券	2,223,700	30,709,297.00	0.26
44	603093	南华期货	647,900	13,955,766.00	0.12
45	002961	瑞达期货	444,800	12,298,720.00	0.11

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	688086	紫晶存储	9,361	604,158.94	0.01
2	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.00
3	688466	金科环境	4,907	179,547.13	0.00
4	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.00
5	688081	兴图新科	3,153	132,457.53	0.00
6	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
7	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
8	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
9	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
10	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
11	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
12	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
13	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
14	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
15	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
16	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
17	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
18	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00

19	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
20	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
21	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	300059	东方财富	1,382,188,183.97	24.33
2	000776	广发证券	638,601,631.39	11.24
3	000166	申万宏源	621,827,736.06	10.95
4	002736	国信证券	405,384,546.74	7.14
5	000783	长江证券	388,253,107.83	6.83
6	000750	国海证券	266,096,438.34	4.68
7	002797	第一创业	255,226,513.20	4.49
8	000728	国元证券	245,259,451.71	4.32
9	601688	华泰证券	239,117,845.70	4.21
10	002673	西部证券	238,878,984.42	4.21
11	002500	山西证券	223,223,414.41	3.93
12	002926	华西证券	222,072,579.52	3.91
13	000686	东北证券	178,715,294.71	3.15
14	601162	天风证券	164,160,937.91	2.89
15	002939	长城证券	157,957,303.31	2.78
16	002670	国盛金控	157,343,514.74	2.77
17	600030	中信证券	142,116,167.77	2.50
18	002945	华林证券	99,354,342.30	1.75
19	000712	锦龙股份	90,634,615.28	1.60
20	600155	华创阳安	64,883,073.23	1.14

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	300059	东方财富	1,051,385,520.23	18.51
2	000776	广发证券	457,617,459.42	8.06
3	000166	申万宏源	445,684,374.83	7.85
4	002736	国信证券	280,889,778.48	4.94
5	000783	长江证券	278,963,158.61	4.91
6	000750	国海证券	179,563,991.21	3.16
7	002673	西部证券	170,209,588.01	3.00
8	000728	国元证券	169,762,180.07	2.99

9	002797	第一创业	167,810,095.04	2.95
10	002926	华西证券	164,651,789.41	2.90
11	600030	中信证券	145,719,453.50	2.57
12	002500	山西证券	138,279,454.59	2.43
13	000686	东北证券	127,282,864.30	2.24
14	002670	国盛金控	97,106,740.47	1.71
15	000987	越秀金控	96,938,460.64	1.71
16	002945	华林证券	84,258,835.89	1.48
17	002939	长城证券	79,572,988.80	1.40
18	600837	海通证券	70,453,765.90	1.24
19	000712	锦龙股份	64,958,488.50	1.14
20	601211	国泰君安	55,698,714.06	0.98

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	6,514,331,130.50
卖出股票收入（成交）总额	4,740,661,320.11

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

无

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

券商 ETF 基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的中信证券（600030）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本，于 2020 年 5 月 15 日收到中国银行间市场交易商协会警告处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

券商 ETF 基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的华泰证券（601688）于 2019 年 8 月 23 日收到江苏证监局整改通知。由于公司存在：在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出公司内部控制不完善。

券商 ETF 基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211）于 2020 年 1 月 17 日收到上海证监局出具警示函的行政监管措施。由于公司存在：公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。

券商 ETF 基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商证券（600999）于 2019 年 12 月 27 日收到中国证监会出具警示函的行政监管措施。由于公司存在：一是投行部门未配备专职合规人员；部分投行异地团队未配备专职合规人员；部分分支机构未配备合规人员；部分分支机构合规人员不具备 3 年以上相关工作经验。二是部分合规人员薪酬低于公司同级别平均水平。三是未见合规总监有权参加监事会的规定。四是部分重大决策、新产品和新业务未经合规总监合规审查。上述情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第十三条、第二十三条、第二十五条、第二十八条、《证券公司合规管理实施指引》第二十八条、第三十一条的规定。

券商 ETF 基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的广发证券（000776）于 2020 年 1 月 3 日收到中国证监会出具警示函的行政监管措施。由于公司存在以下问题：一是合规部门中，具有 3 年以上相关领域工作经历的合规人员数量占比不足 1.5%；部分投行异地团队未配置专职合规人员。二是公司部分合规人员薪酬低于公司同级别平均水平。三是合规考核独立性不足，包括对合规总监考核指标包括业绩等影响合规考核独立性的指标；部分合规管理人员由业务部门考核或者允许业务部门对考核评级进行调整，合规总监对子公司合规负责人的考核权重不足 100%。四是部分重大决策、新产品和新业务未经合规总监合规审查等。

券商 ETF 基金截至 2020 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的东方证券（600958）于 2020 年 1 月 3 日收到中国证监会责令改正的行政监管措施，由于公司存在以下问题：一是未将合规职责与风控职责严格区分，合规部内设风险经理岗，承担财富管理业务部、场外业务部、托管业务部风险管理职责。二是部分分支机构合规人员不具备 3 年以上相关工作经验。三是部分合规人员薪酬低于公司同级别平均水平。四是对下属子公司现场合规检查不足，近三年仅开展过 1 次。五是对合规有效性评估中发现问题的规范力度不足，2017 年合规有效性评估发现的 54 项问题中，有 22 项尚未完成落实规范。

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四名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,396,779.30
2	应收证券清算款	79,511,288.95
3	应收股利	460,779.20
4	应收利息	316,703.11
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	82,685,550.56

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	48,220,000.00	0.41	转融通流通受限
2	300059	东方财富	8,982,940.00	0.08	转融通流通受限
3	600837	海通证券	43,778,400.00	0.37	转融通流通受限
4	600999	招商证券	93,140,435.00	0.80	转融通流通受限
5	000776	广发证券	22,741,672.00	0.19	转融通流通受限
6	600958	东方证券	4,109,170.00	0.04	转融通流通受限
7	601377	兴业证券	21,166,500.00	0.18	转融通流通受限

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688086	紫晶存储	604,158.94	0.01	科创板锁定
2	688004	博汇科技	179,750.00	0.00	科创板锁定
3	688466	金科环境	179,547.13	0.00	科创板锁定
4	688516	奥特维	148,264.00	0.00	科创板锁定
5	688081	兴图新科	132,457.53	0.00	科创板锁定

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	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（%）
177,102	68,421.69	3,465,464,857.00	28.60	8,652,152,826.00	71.40

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国人寿保险股份有限公司	168,000,000.00	1.39
2	华夏人寿保险股份有限公司—万能保险产品	164,021,600.00	1.35
3	信泰人寿保险股份有限公司—分红产品	97,092,300.00	0.80
4	永安国富资产管理有限公司—永安国富—永富13号混合投资私募基金	43,938,100.00	0.36
5	西南证券股份有限公司	39,423,600.00	0.33

6	北京恒兆伟业投资有限公司	32,600,000.00	0.27
7	中国华电集团财务有限公司	32,557,587.00	0.27
8	吴晓玲	32,014,800.00	0.26
9	高建华	31,887,900.00	0.26
10	国泰君安证券股份有限公司	31,805,173.00	0.26
11	中国建设银行股份有限公司-华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,533,448,578.00	12.65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	79,300.00	0.0007

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月30日）基金份额总额	642,017,683.00
本报告期期初基金份额总额	5,731,217,683.00
本报告期基金总申购份额	20,041,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,655,100,000.00
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	12,117,617,683.00

§ 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

2020 年 5 月 20 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，经公司董事会审议通过，聘任周雷为公司督察长。公司总经理黄小慧自 2020 年 5 月 20 日起不再代任督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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	
华创证券	3	2,809,693,938.89	25.18%	2,560,475.01	24.92%	—
安信证券	2	2,163,608,631.48	19.39%	1,978,665.49	19.26%	—
银河证券	1	1,359,729,462.12	12.18%	1,266,317.24	12.32%	—

中信证券	2	1,175,137,474.05	10.53%	1,070,902.32	10.42%	-
国金证券	1	970,906,870.89	8.70%	904,204.98	8.80%	-
光大证券	1	804,286,054.43	7.21%	749,031.05	7.29%	-
国信证券	1	603,385,467.90	5.41%	561,930.13	5.47%	-
瑞银证券	1	549,689,865.56	4.93%	511,926.47	4.98%	-
上海证券	1	242,208,478.89	2.17%	225,568.26	2.20%	-
东方证券	1	215,438,370.15	1.93%	200,636.53	1.95%	-
川财证券	1	138,213,058.86	1.24%	125,953.73	1.23%	-
华泰证券	1	81,183,999.57	0.73%	75,606.45	0.74%	-
方正证券	1	46,010,863.69	0.41%	42,849.80	0.42%	-
华宝证券	1	399,191.00	0.00%	371.78	0.00%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元无变动。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	基金管理人网站	2020-01-15
2	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要	基金管理人网站	2020-01-15
3	华宝基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-01-15
4	华宝基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式调整并相应修改招募说明书的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-01-15
5	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2020-01-21
6	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-01-21
7	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增恒泰证券为一级交易商的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-03-02
8	华宝基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-03-14
9	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增中金公司为一級交易商的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-03-25
10	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	基金管理人网站	2020-03-30
11	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-03-30
12	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增民生证券为一級交易商的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-04-08
13	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2020-04-21
14	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增一級交易商的	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日	2020-05-06

	公告	报、基金管理人网站	
--	----	-----------	--

§ 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 2020 年 1 月 15 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费调整的公告》、《华宝基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式调整并相应修改招募说明书的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

基金管理人于 2020 年 3 月 14 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告》，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；

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；

华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金托管协议；

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

2020 年 8 月 31 日