

# 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资 基金（LOF） 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华宝标普沪港深中国增强价值指数   |
| 场内简称       | 价值基金 LOF  |
| 基金主代码      | 501310  |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式（LOF）   |
| 基金合同生效日    | 2018 年 10 月 25 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 176,252,453.08 份  |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。<br>正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。  |
| 投资策略       | 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。<br>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。  |                 |
| 业绩比较基准          | 本基金的业绩比较基准为标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%  |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 |                 |
| 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  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 价值基金 LOF  | 华宝价值基金 C        |
| 下属分级基金的场内简称     | 价值基金 LOF  | -               |
| 下属分级基金的交易代码     | 501310  | 007397          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 157,384,389.49 份  | 18,868,063.59 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 华宝价值基金                              | 华宝价值基金 C      |
| 1. 本期已实现收益      | 2,335,276.03                        | 290,989.17    |
| 2. 本期利润         | 2,359,690.87                        | 320,302.33    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0155                              | 0.0158        |
| 4. 期末基金资产净值     | 148,839,632.41                      | 17,680,612.21 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9457                              | 0.9371        |

注：1. 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。

2. 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。

### 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

华宝价值基金

| 阶段         | 净值增长率① | 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    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 1.58%  | 1.09%     | -0.33%     | 1.08%         | 1.91% | 0.01%  |
| 过去六个月      | -1.46% | 0.89%     | -5.61%     | 0.89%         | 4.15% | 0.00%  |
| 过去一年       | 14.57% | 0.97%     | 10.22%     | 0.98%         | 4.35% | -0.01% |
| 过去三年       | -      | -         | -          | -             | -     | -      |
| 过去五年       | -      | -         | -          | -             | -     | -      |
| 自基金合同生效起至今 | -5.43% | 1.09%     | -9.90%     | 1.08%         | 4.47% | 0.01%  |

华宝价值基金 C

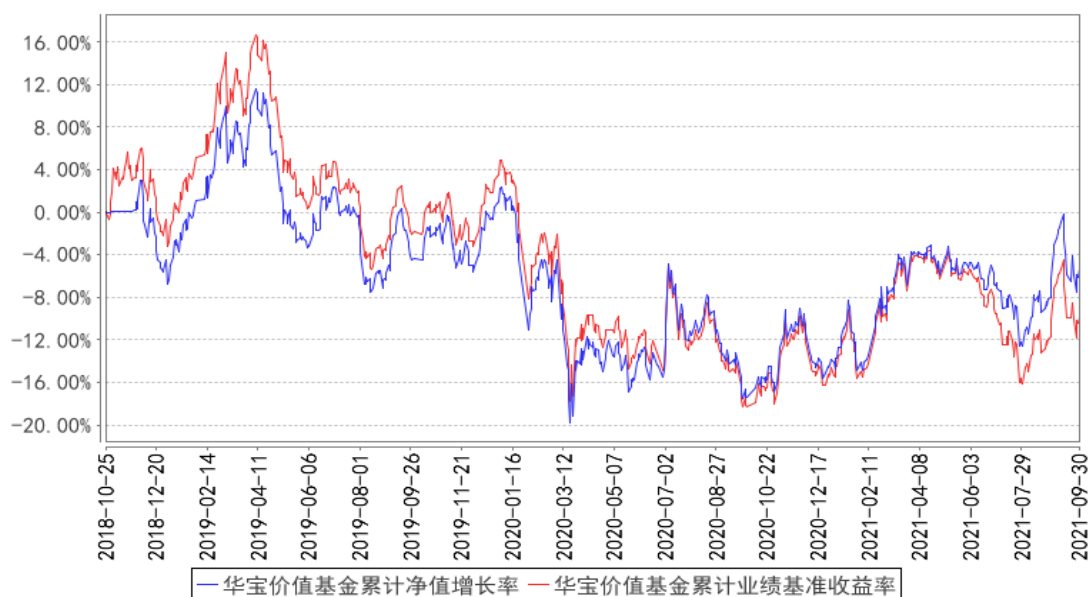
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 1.47%  | 1.09%     | -0.33%     | 1.08%         | 1.80% | 0.01%  |
| 过去六个月      | -1.66% | 0.89%     | -5.61%     | 0.89%         | 3.95% | 0.00%  |
| 过去一年       | 14.13% | 0.97%     | 10.22%     | 0.98%         | 3.91% | -0.01% |
| 过去三年       | -      | -         | -          | -             | -     | -      |
| 过去五年       | -      | -         | -          | -             | -     | -      |
| 自基金合同生效起至今 | -4.80% | 1.10%     | -12.64%    | 1.08%         | 7.84% | 0.02%  |

注：（1）基金业绩基准：本基金的业绩比较基准为标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%；

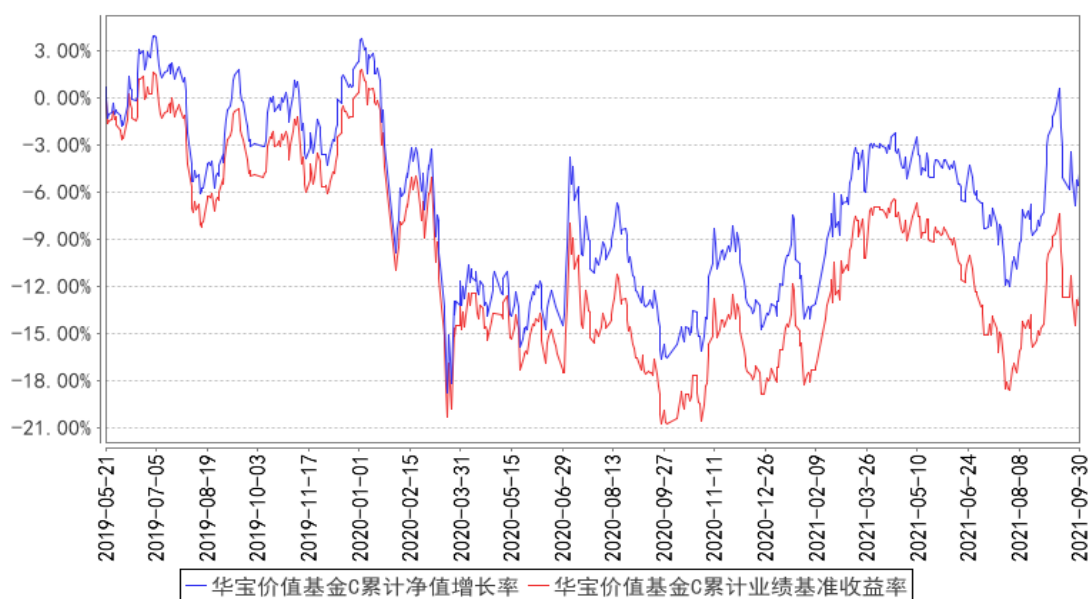
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 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

华宝价值基金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



华宝价值基金C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2019 年 04 月 25 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、本基金 C 份额成立于 2019 年 5 月 21 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                               | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|----------------------------------|-------------|------|--------|--|
|    |                                  | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 杨洋 | 本基金基金经理                          | 2021-05-11  | -    | 11 年   | 硕士。曾在法兴银行、东北证券从事证券交易、研究、投资管理等工作，2014 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、投资经理等职务。2021 年 5 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）、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）、华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金（LOF）、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）、华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金基金经理。   |
| 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 | 2018-10-25  | -    | 17 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任策略部总经理兼首席策略分析师，现任公司总经理助理兼国际业务部总经理。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。 |

|  |  |  |  |  |    |
|--|--|--|--|--|----|
|  |  |  |  |  | 理。 |
|--|--|--|--|--|----|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 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，本基金没有发现异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金采用全复制方法跟踪标普沪港深中国增强价值指数。该指数在沪港深三地上市的股票中采用量化的方法精选估值偏低的股票。整个基金通过 A 股和港股通进行交易。该基金于 2018/10/25 成立。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

2021 年三季度，受 7 月份河南水灾和 8 月份新冠变种毒株的扩散所造成的影响，中国经济在

三季度进一步缓慢下滑。制造业 PMI 在荣枯线位置徘徊并在 9 月份跌破荣枯线。此外，教育、互联网和地产等行业在三季度回调较大，而在港股市场，以上行业的上市公司均占有不小比重。特别是地产行业，短期情绪上，对港股的波动影响较大。期间，A 股的波动相对港股更小。沪港深增强价值基金所持有的股票更为稳健，净值表现优异。我们预计，随着未来政策的支持，影响港股三季度表现的板块在未来将逐渐企稳。

截止今年三季度末，标普沪港深中国增强价值指数（人民币）震荡横盘，小幅下跌，从 1351.65 下跌到 1346.63，跌幅 0.4%。恒生国企指数这段期间下跌 18.2%，沪深 300 指数这段期间下跌 6.8%。本季度，该基金跟踪的标普沪港深中国增强价值指数跌幅远小于恒生国企指数，也小于沪深 300 指数。沪港深中国增强价值基金本季度年化波动率为 18.4%，相较恒生国企指数的 27.8% 更低，相较沪深 300 指数的 19.1% 更低。

#### 4.5 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 1.58%，本报告期基金份额 C 净值增长率为 1.47%；同期业绩比较基准收益率为 -0.33%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 157,993,570.94 | 93.72        |
|    | 其中：股票             | 157,993,570.94 | 93.72        |
| 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      | 9,651,382.57   | 5.72         |
| 8  | 其他资产              | 943,034.18     | 0.56         |
| 9  | 合计                | 168,587,987.69 | 100.00       |



注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 113,820,382.14 元，占基金资产净值的比例为 68.35%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 7,237,093.00  | 4.35         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,115,807.00  | 0.67         |
| E  | 建筑业              | 16,299,121.00 | 9.79         |
| F  | 批发和零售业           | 1,878,556.00  | 1.13         |
| 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              | 6,006,883.80  | 3.61         |
| K  | 房地产业             | 11,068,944.00 | 6.65         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 566,784.00    | 0.34         |
| 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               | 44,173,188.80 | 26.53        |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 能源       | 13,058,632.03 | 7.84         |
| 原材料      | 3,902,486.23  | 2.34         |
| 工业       | 10,543,840.46 | 6.33         |
| 非日常生活消费品 | 1,457,371.83  | 0.88         |
| 日常消费品    | -             | -            |
| 医疗保健     | 2,715,785.59  | 1.63         |
| 金融       | 53,688,733.48 | 32.24        |

|      |                |       |
|------|----------------|-------|
| 信息技术 | 641,539.51     | 0.39  |
| 通信服务 | 3,091,102.45   | 1.86  |
| 公用事业 | 5,911,197.99   | 3.55  |
| 房地产  | 18,809,692.57  | 11.30 |
| 合计   | 113,820,382.14 | 68.35 |

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 03988  | 中国银行     | 3,436,000 | 7,900,207.88 | 4.74         |
| 2  | 601668 | 中国建筑     | 1,598,600 | 7,673,280.00 | 4.61         |
| 3  | 01398  | 工商银行     | 2,103,000 | 7,585,836.03 | 4.56         |
| 4  | 00939  | 建设银行     | 1,569,000 | 7,293,456.96 | 4.38         |
| 5  | 00386  | 中国石油化工股份 | 2,022,000 | 6,501,966.66 | 3.90         |
| 6  | 03328  | 交通银行     | 1,389,000 | 5,345,895.97 | 3.21         |
| 7  | 02628  | 中国人寿     | 474,000   | 5,046,444.22 | 3.03         |
| 8  | 00857  | 中国石油股份   | 1,442,000 | 4,432,695.60 | 2.66         |
| 9  | 01288  | 农业银行     | 1,930,000 | 4,308,919.54 | 2.59         |
| 10 | 00688  | 中国海外发展   | 280,500   | 4,145,364.87 | 2.49         |

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

#### 5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

沪港深价值基金截至 2021 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的中国银行（3988.HK）的发行人中国银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日公告，因公司存在以下违规行为：一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；二、违规向关系人发放信用贷款；三、向无资金缺口企业发放流动

资金贷款；四、存款月末冲时点；五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票；六、贷款管理不严，信贷资金被挪用；七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户；八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足；九、超比例发放并购贷款；十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款；十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款；十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务；十三、与名单外交易对手开展同业业务；十四、违规为他行开立投融资性同业账户；十五、以同业返存方式不当吸收存款；十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离；十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票；十八、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况；十九、违规向四证不全房地产项目提供融资；二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款；二十一、理财资金违规用于土地储备项目；二十二、理财非标融资入股商业银行；二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资；二十四、超授信额度提供理财非标融资；二十五、买入返售业务标的资产不合规；二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品；二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品；二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置；二十九、通过平移贷款延缓风险暴露；三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备；三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产；三十二、迟报案件信息；三十三、案件问责不到位；三十四、提供质价不符的服务；三十五、违规收取福费廷风险承担费；三十六、违规向部分已签约代发工资客户收取年费；于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会罚没 8761.355 万元的处罚。

沪港深价值基金截至 2021 年 9 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。

沪港深价值基金截至 2021 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的建设银行（0939.HK）的发行人中国建设银行股份有限公司于 2020 年 08 月 28 日公告，因公司存在以下违规行为：（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保；于 2020 年 07 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 3920 万元的处罚。

沪港深价值基金截至 2021 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的交通银行（3328.HK）的发行人交通银行股份有限公司因存在以下行为：一、理财业务和同业业务制度不健全二、理财业务数据与事实不符三、部分理财业务发展与监管导向不符四、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资五、理财资金违规投向土地储备项目六、理财产品相互交易调节收益七、面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券八、公募理财产品投资单只证券超限额九、理财资金违规投向交易所上市交易的股票十、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位十一、私募理财产品销售文件未约定冷静期十二、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求十三、理财产品信息登记不及时十四、理财产品信息披露不合规十五、同业业务交易对手名单调整不及时十六、将同业存款纳入一般性存款核算十七、同业账户管理不规范十八、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足十九、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为二十、未严格审查委托贷款资金来源二十一、违规向委托贷款借款人收取手续费二十二、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表二十三、监管检查发现问题屡查屡犯；于 2021 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 4100 万元的行政处罚决定。

沪港深价值基金截至 2021 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的农业银行（1288.HK）的发行人中国农业银行股份有限公司于 2020 年 08 月 28 日公告，因公司存在以下违规行为：（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金

直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财产品；（十五）信贷资金用于承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节收益；（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；（二十一）开立同业银行结算账户不合规；（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责；（二十三）对小微企业不当收费；（二十四）未按规定报送案件；于 2020 年 07 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 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视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余五名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 38,997.39  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 902,932.93 |
| 4  | 应收利息    | 1,103.86   |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 943,034.18 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 华宝价值基金         | 华宝价值基金 C      |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 151,328,344.03 | 20,587,099.67 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 39,470,184.28  | 2,678,952.05  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 33,414,138.82  | 4,397,988.13  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 157,384,389.49 | 18,868,063.59 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 20210819~20210930        | 21,133,604.94 | 29,815,046.59 | 0.00       | 50,948,651.53 | 28.91    |

#### 产品特有风险

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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 8 月 25 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，李慧勇不再担任公司副总经理。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 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。

### 9.3 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 10 月 27 日