

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资  
基金(LOF)  
2020年第3季度报告

2020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：2020年10月28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2020年10月26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2020年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华宝标普香港上市中国中小盘指数（LOF）  |
| 场内简称       | 香港中小 LOF  |
| 基金主代码      | 501021  |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式（LOF）   |
| 基金合同生效日    | 2016年6月24日  |
| 报告期末基金份额总额 | 836,991,793.24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。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。<br><br>1、组合复制策略<br><br>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。 |

|             |  |                 |
|-------------|--|-----------------|
|             | <p>2、替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将适当投资于债券和货币市场工具，固定收益投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。</p> |                 |
| 业绩比较基准      | <p>经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%</p>  |                 |
| 风险收益特征      | <p>本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可能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。</p>  |                 |
| 基金管理人       | <p>华宝基金管理有限公司</p>  |                 |
| 基金托管人       | <p>中国建设银行股份有限公司</p>  |                 |
| 下属分级基金的基金简称 | <p>香港中小 LOF</p>  | <p>华宝香港中小 C</p> |
| 下属分级基金的场内简称 | <p>香港中小 LOF</p>  | <p>-</p>        |
| 下属分级基金的交易代码 | <p>501021</p>  | <p>006127</p>   |

|                     |   |                 |
|---------------------|---|-----------------|
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 815,965,172.46 份                          | 21,026,620.78 份 |
| 境外投资顾问              | 英文名称: -                                   |                 |
|                     | 中文名称: -                                   |                 |
| 境外资产托管人             | 英文名称: State Street Bank and Trust Company |                 |
|                     | 中文名称: 美国道富银行有限公司                          |                 |

### § 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 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日) |               |
|-----------------|--------------------------------------|---------------|
|                 | 香港中小                                 | 华宝香港中小 C      |
| 1. 本期已实现收益      | 119,078,231.98                       | 4,030,555.16  |
| 2. 本期利润         | 88,857,944.54                        | -1,105,218.78 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0934                               | -0.0314       |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,262,683,130.60                     | 32,304,964.30 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.5475                               | 1.5364        |

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 本报告期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

香港中小

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 4.03%  | 1.59%         | 4.34%          | 1.60%                 | -0.31% | -0.01% |
| 过去六个月 | 17.12% | 1.49%         | 16.71%         | 1.49%                 | 0.41%  | 0.00%  |
| 过去一年  | 14.86% | 1.65%         | 15.05%         | 1.68%                 | -0.19% | -0.03% |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三年       | 14.16% | 1.45% | 12.24% | 1.46% | 1.92%  | -0.01% |
| 过去五年       | 0.00%  | 0.00% | 0.00%  | 0.00% | 0.00%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 54.75% | 1.29% | 59.16% | 1.31% | -4.41% | -0.02% |

华宝香港中小 C

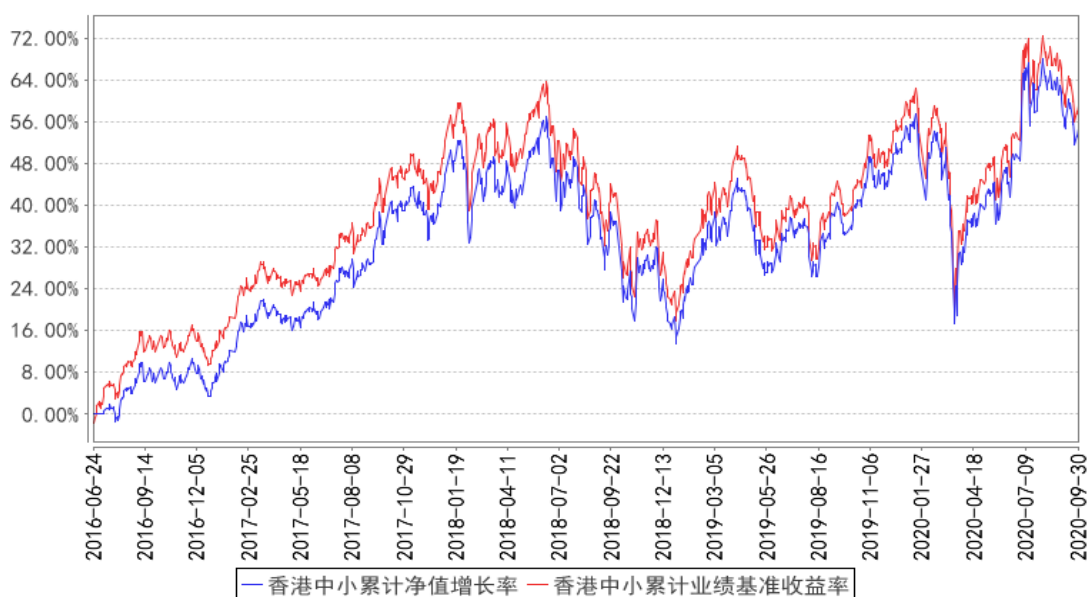
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 3.92%  | 1.59%     | 4.34%      | 1.60%         | -0.42% | -0.01% |
| 过去六个月      | 16.88% | 1.49%     | 16.71%     | 1.49%         | 0.17%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 14.48% | 1.65%     | 15.05%     | 1.68%         | -0.57% | -0.03% |
| 过去三年       | 0.00%  | 0.00%     | 0.00%      | 0.00%         | 0.00%  | 0.00%  |
| 过去五年       | 0.00%  | 0.00%     | 0.00%      | 0.00%         | 0.00%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 5.41%  | 1.50%     | 4.21%      | 1.52%         | 1.20%  | -0.02% |

注：1、本基金业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

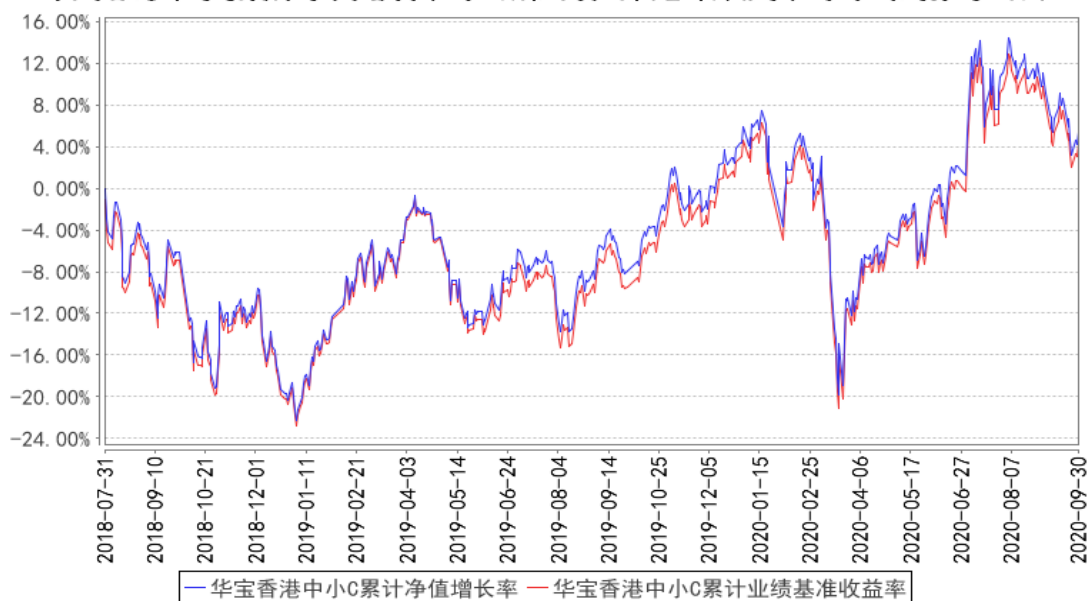
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 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

香港中小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



华宝香港中小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，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 2016 年 12 月 24 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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 |        |  |
| 周晶 | 公司总经理助理/<br>国际业务 | 2016年6月24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 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
| <p>部总经理、本基金基金经理、华宝油气、美国消费、华宝港股通恒生中国（香港上市）25指数（场内简称“香港大盘”）、华宝港股通恒生香港35指数（场内简称“香港本地”）、华宝标普沪港深中国增强价值指数（场内简称“价值基金”）、华宝致远混合基金经理</p> |  |  |  | <p>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。</p> |
|--|--|--|--|--|

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。

#### 4.1.1 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

#### 4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（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。

#### 4.4 公平交易专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金采用全复制方法跟踪标普香港上市中国中小盘指数，在报告期内按照这一原则比较好地实现了基金跟踪指数表现的目的。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

整个 2020 年三季度，标普香港中小盘指数上涨。七月初，受到美元指数大幅下行，外资涌入，叠加国内经济复苏推进，权益市场内流动性快速上升等积极因素的推动，指数快速大幅上涨。七月中旬后，国内流动性从宽边际有所收缩，存量资金转向景气度更高的消费和科技板块，香港中小指数行业配置均衡，且成长性较强，受益于该趋势。而进入到八月下旬，受到欧洲疫情有所重新加速扩散、美国新财政刺激方案难产、英国脱欧谈判阻力重重等因素影响，美元指数走强，带动新兴市场和该指数回撤。但整体而言，标普香港中小盘指数受益于较高成长性和均衡的行业配置，表现优于恒生指数和恒生国企指数。

本基金跟踪的标普香港中小盘指数在三季度中表现优于恒生指数。同时，香港中小指数三季度年化日均波幅 26.79%，相较恒生指数的 19.33% 更高。



日常操作过程中，人民币汇率方面，2020年三季度人民币汇率呈现升值走势。三季度人行中间价从0.9134升值至0.8787，相对于港币升值3.8%。同期，人民币交易价也相对于港币升值3.71%左右。汇率三季度整体而言对基金的人民币计价业绩有负面影响。

本报告期基金份额A净值增长率为4.03%；本报告期基金份额C净值增长率为3.92%；同期业绩比较基准收益率为4.34%。

#### 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（人民币元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,233,498,085.38 | 92.03        |
|    | 其中：普通股            | 1,233,498,085.38 | 92.03        |
|    | 优先股               | -                | -            |
|    | 存托凭证              | -                | -            |
|    | 房地产信托凭证           | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | 0.00             | 0.00         |
| 3  | 固定收益投资            | 0.00             | 0.00         |
|    | 其中：债券             | 0.00             | 0.00         |
|    | 资产支持证券            | 0.00             | 0.00         |
| 4  | 金融衍生品投资           | 0.00             | 0.00         |
|    | 其中：远期             | -                | -            |
|    | 期货                | 0.00             | 0.00         |
|    | 期权                | -                | -            |
|    | 权证                | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 0.00             | 0.00         |
|    | 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      | 100,867,275.29   | 7.53         |
| 8  | 其他资产              | 5,900,429.16     | 0.44         |
| 9  | 合计                | 1,340,265,789.83 | 100.00       |

### 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------------|--------------|
| 中国香港   | 1,233,498,085.38 | 95.25        |
| 合计     | 1,233,498,085.38 | 95.25        |

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

#### 5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|------------------|--------------|
| 房地产      | 113,369,779.58   | 8.75         |
| 非日常生活消费品 | 228,294,755.58   | 17.63        |
| 工业       | 161,696,899.34   | 12.49        |
| 公用事业     | 86,917,090.58    | 6.71         |
| 金融       | 83,222,218.86    | 6.43         |
| 能源       | 7,150,039.19     | 0.55         |
| 日常消费品    | 166,610,338.27   | 12.87        |
| 通信服务     | 11,208,917.18    | 0.87         |
| 信息技术     | 156,699,234.32   | 12.10        |
| 医疗保健     | 154,049,374.19   | 11.90        |
| 原材料      | 64,273,343.49    | 4.96         |
| 合计       | 1,233,491,990.58 | 95.25        |

#### 5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|------------|--------------|
| 医疗保健 | 3,912.06   | 0.00         |
| 原材料  | 2,182.74   | 0.00         |
| 合计   | 6,094.80   | 0.00         |

### 5.4 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股票及存托凭证投资明细

#### 5.4.1 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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称<br>(英文)               | 公司名称<br>(中文) | 证券代<br>码   | 所在证<br>券市场      | 所属<br>国家<br>(地<br>区) | 数量<br>(股)     | 公允价值（人<br>民币元）    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
|----|----------------------------|--------------|------------|-----------------|----------------------|---------------|-------------------|--------------------------|
| 1  | CHINA<br>MENGNIU<br>DAIRY  | 蒙牛乳业         | 2319<br>HK | 香港联<br>合交易<br>所 | 中 国<br>香 港           | 1,262<br>,000 | 40,254,690.4<br>3 | 3.11                     |
| 2  | SHENZHO<br>INTERNATI<br>ON | 申洲国际         | 2313<br>HK | 香港联<br>合交易<br>所 | 中 国<br>香 港           | 348,6<br>00   | 39,974,993.8<br>5 | 3.09                     |
| 3  | Geely<br>Automobil<br>e    | 吉利汽车         | 175 HK     | 香港联<br>合交易<br>所 | 中 国<br>香 港           | 2,639<br>,000 | 35,711,708.0<br>3 | 2.76                     |

|    |                                      |        |         |         |      |           |               |      |
|----|--------------------------------------|--------|---------|---------|------|-----------|---------------|------|
|    | Holdings Limited                     |        |         |         |      |           |               |      |
| 4  | SUNNY OPTICAL TECH                   | 舜宇光学科技 | 2382 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 330,600   | 34,366,721.63 | 2.65 |
| 5  | CHINA PHARMACEUTICAL                 | 石药集团   | 1093 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,603,600 | 34,317,530.88 | 2.65 |
| 6  | SUNAC ORD                            | 融创中国   | 1918 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1,167,000 | 30,969,080.45 | 2.39 |
| 7  | LI NING CO                           | 李宁     | 2331 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 956,000   | 30,242,027.52 | 2.34 |
| 8  | Country Garden Services Holdin       | 碧桂园服务  | 6098 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 614,000   | 26,895,773.89 | 2.08 |
| 9  | WH GROUP LTD                         | 万洲国际   | 288 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 4,372,500 | 24,129,036.10 | 1.86 |
| 10 | China Conch Venture Holdings Limited | 海螺创业   | 586 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 761,500   | 24,022,315.55 | 1.86 |

#### 5.4.2 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及存托凭证投资明细

| 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 (人民币元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------------------|-----------|---------|---------|-----------|--------|-------------|---------------|
| 1  | WUXI APPTec CO LTD-H  | 药明康德      | 2359 HK | 香港联合交易所 | 中国香港      |        | 3,912.06    | 0.00          |
| 2  | ANGANG STEEL CO LTD-H | 鞍钢股份      | 347 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港      |        | 2,182.74    | 0.00          |

#### 5.5 报告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。

## 5.6 报告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。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 5.8 报告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。

## 5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 5.10.2

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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）     |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,696,476.60 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | 2,587,093.65 |
| 4  | 应收利息    | 7,635.26     |
| 5  | 应收申购款   | 609,223.65   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 5,900,429.16 |
|---|----|--------------|

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.10.5.1 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.10.5.2 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.10.6 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                        | 香港中小             | 华宝香港中小 C      |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,102,034,244.69 | 14,280,927.90 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 59,058,068.49    | 48,078,537.92 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 345,127,140.72   | 41,332,845.04 |
| 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               | 815,965,172.46   | 21,026,620.78 |

## §7 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

无

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2020 年 9 月 4 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任李孟恒为公司首席信息官。

2、2020 年 9 月 23 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，朱永红担任公司董事长，孔祥清不再担任公司董事长。

## § 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；

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（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

2020 年 10 月 28 日