

华宝中证 100 指数证券投资基金 2019 年第 2 季度报告

2019 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

报告送出日期：2019 年 7 月 17 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 2019 年 7 月 15 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 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|---------------|
| 基金简称 | 华宝中证 100 指数 | |
| 基金主代码 | 240014 | |
| 交易代码 | 240014 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2009 年 9 月 29 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 416,296,651.67 份 | |
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，力争控制本基金的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 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，实现对中证 100 指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。 | |
| 投资策略 | 本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。 | |
| 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 | 华宝中证 100 指数 | 华宝中证 100 指数 C |

| | | |
|-----------------|------------------|--------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 240014 | 007405 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 415,879,341.89 份 | 417,309.78 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（2019年4月1日—2019年6月30日） | |
|-----------------|---------------------------|---------------|
| | 华宝中证 100 指数 | 华宝中证 100 指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 5,088,798.22 | 3,453.60 |
| 2. 本期利润 | 15,570,493.71 | 30,824.71 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0376 | 0.1702 |
| 4. 期末基金资产净值 | 591,541,033.90 | 593,293.36 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4224 | 1.4217 |

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. C 类份额的实际起始日为 2019 年 5 月 13 日。

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

华宝中证 100 指数

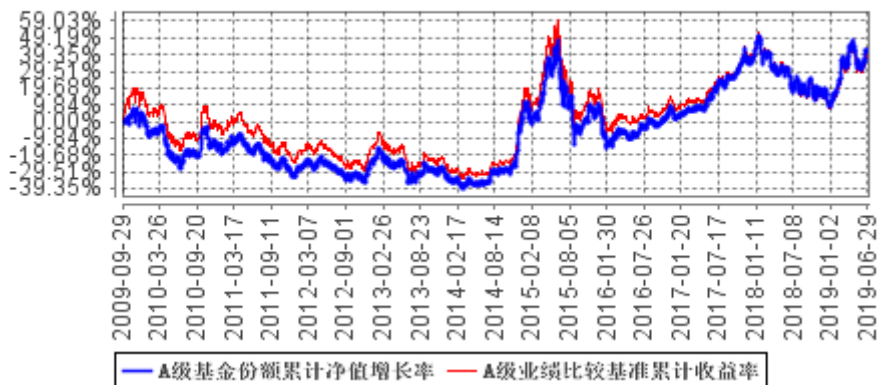
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.89% | 1.48% | 1.83% | 1.44% | 1.06% | 0.04% |

华宝中证 100 指数 C

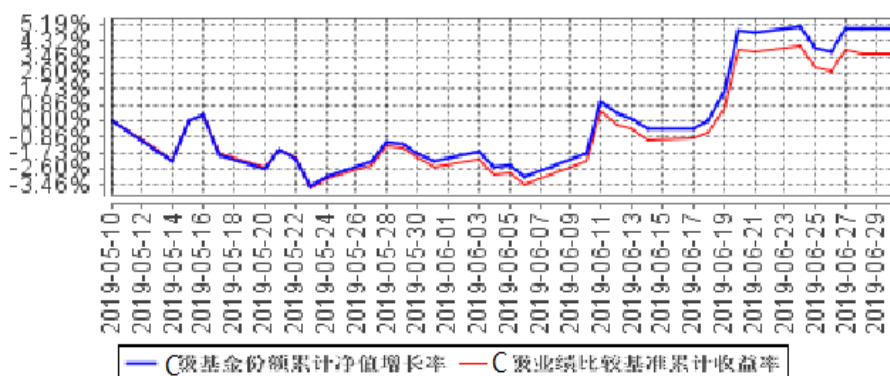
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 4.92% | 1.17% | 3.64% | 1.14% | 1.28% | 0.03% |

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

A 级基金份额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



C 级基金份额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：基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，截至 2009 年 11 月 6 日，本基金已完成建仓且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 | | |
| 陈建华 | 本基金基金经理、华宝事件驱动混合、华宝智慧产业混合、华宝第三产业混合基金经理 | 2012 年 12 月 22 日 | - | 17 年 | 硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、上证 180 价值 ETF 和华宝上证 180 价值 ETF 联接基金经理助理、上证 180 成长 ETF 和华宝上证 180 成长 ETF 联接基金经理助理。2012 年 12 月起任华宝中证 100 指数型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月起任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月起任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金和华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 7 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型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。

4.2 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、《华宝基金管理有限公司华宝中证 100 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 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，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

从宏观层面来看，二季度贸易冲突带来的不确定性上升，全球增长乏力，各国央行多转向宽松。国内经济继续处于下台阶的寻底过程，生产及需求端整体仍然偏弱，同时通胀小幅上行，货币政策稳健中性灵活，财政政策积极逆周期调节，发力对冲风险。二季度 A 股在经历了一季度的强势反弹后振幅加大，在 5 月中美贸易摩擦再度升级后大幅下跌，市场情绪趋于谨慎，成交量低迷，随着六月底 G20 会议的召开中美关系缓和和市场有所回暖。报告期内以蓝筹股为代表的上证 50 和中证 100 表现相对较好，分别上涨 3.24%和 1.88%，而创业板和中证 500 相对较弱，分别下跌 10.75%和 10.76%。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持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。

4.5 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 2.89%，业绩比较基准收益率为 1.83%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 4.92%，业绩比较基准收益率为 3.64%。

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 | 560,801,539.68 | 94.17 |
| | 其中：股票 | 560,801,539.68 | 94.17 |
| 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 | 32,471,301.87 | 5.45 |
| 8 | 其他资产 | 2,277,313.04 | 0.38 |
| 9 | 合计 | 595,550,154.59 | 100.00 |

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 | 9,449,110.00 | 1.60 |
| B | 采矿业 | 18,190,462.29 | 3.07 |
| C | 制造业 | 184,414,145.61 | 31.14 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,180,348.64 | 1.72 |
| E | 建筑业 | 16,950,695.18 | 2.86 |
| F | 批发和零售业 | 4,821,954.72 | 0.81 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,928,896.25 | 2.35 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,890,501.62 | 2.01 |
| J | 金融业 | 255,619,204.07 | 43.17 |
| K | 房地产业 | 23,601,208.09 | 3.99 |
| L | 租赁和商务服务业 | 9,633,434.64 | 1.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 814,792.00 | 0.14 |
| 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 | 559,494,753.11 | 94.49 |

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

| 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 | 355,184.60 | 0.06 |
| C | 制造业 | 855,021.67 | 0.14 |
| 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 | 39,603.76 | 0.01 |
| J | 金融业 | 33,869.94 | 0.01 |
| 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 | 23,106.60 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,306,786.57 | 0.22 |

5.2.3 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。

5.3 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 | 601318 | 中国平安 | 697,926 | 61,843,222.86 | 10.44 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 33,332 | 32,798,688.00 | 5.54 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 675,996 | 24,322,336.08 | 4.11 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 314,177 | 17,279,735.00 | 2.92 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 903,040 | 16,516,601.60 | 2.79 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 133,654 | 15,764,489.30 | 2.66 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 297,811 | 15,444,478.46 | 2.61 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 587,052 | 13,977,708.12 | 2.36 |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 204,809 | 13,517,394.00 | 2.28 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 376,565 | 12,581,036.65 | 2.12 |

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

| 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 | 600485 | *ST 信威 | 113,587 | 678,114.39 | 0.11 |
| 2 | 600968 | 海油发展 | 100,052 | 355,184.60 | 0.06 |
| 3 | 300782 | 卓胜微 | 743 | 80,927.56 | 0.01 |
| 4 | 601698 | 中国卫通 | 10,103 | 39,603.76 | 0.01 |
| 5 | 603863 | 松炆资源 | 1,612 | 37,204.96 | 0.01 |

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。

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投资。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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 | 111,183.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,089,464.83 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,783.22 |
| 5 | 应收申购款 | 1,069,881.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,277,313.04 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|--------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600485 | *ST 信威 | 678,114.39 | 0.11 | 重大事项停牌 |

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 | 华宝中证 100 指数 | 华宝中证 100 指数 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 407,160,458.92 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 72,387,018.93 | 418,201.49 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 63,668,135.96 | 891.71 |
| 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 | 415,879,341.89 | 417,309.78 |

注：总申购份额含红利再投资和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

单位：份

| 项目 | 华宝中证 100 指数 | 华宝中证 100 指数 C |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 22,112,742.66 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 17,254,758.79 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,857,983.87 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.17 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|-------|
| 1 | 赎回 | 2019年5月23日 | 17,254,758.79 | 22,898,790.39 | 0.00% |
| 合计 | | | 17,254,758.79 | 22,898,790.39 | |

注：交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

§ 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 | 20190401~20190630 | 112,072,025.39 | 0.00 | 0.00 | 112,072,025.39 | 26.92% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 5 月 6 日发布公告，自 2019 年 5 月 10 日增加华宝中证 100 指数证券投资基金 C 类基金份额并修改基金合同；并在 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，以上事项具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 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；
- 华宝中证 100 指数证券投资基金基金合同；
- 华宝中证 100 指数证券投资基金招募说明书；

华宝中证 100 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。

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

2019 年 7 月 17 日