

# 华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 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	华宝中证 1000 指数分级
场内简称	1000 分级
基金主代码	162413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日
报告期末基金份额总额	98,408,975.01 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。在正常情况下，本基金力争将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绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将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绝对值控制

	<p>在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。</p> <p>在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p>		
业绩比较基准	<p>中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%</p>		
风险收益特征	<p>本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</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	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金的场内简称	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金的份额总额	4,109,436.00 份	4,109,436.00 份	90,190,103.01 份
下属分级基金的风险收益特征	<p>华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。</p>	<p>华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。</p>	<p>本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p>

### § 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）
1. 本期已实现收益	714,517.26
2. 本期利润	2,989,466.07
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0635
4. 期末基金资产净值	98,594,662.91
5. 期末基金份额净值	1.0019

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

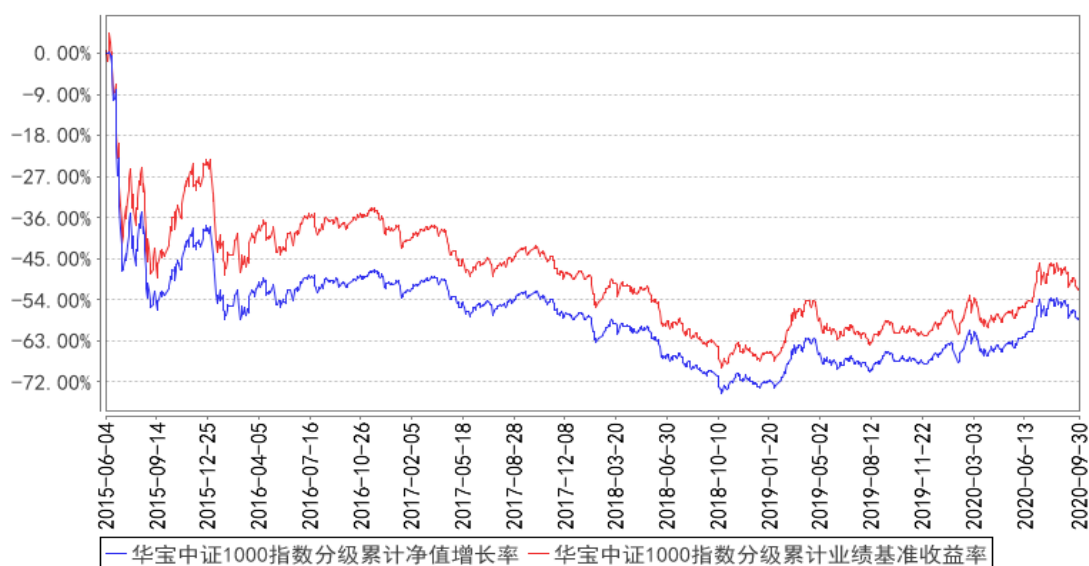
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.95%	1.74%	4.53%	1.76%	1.42%	-0.02%
过去六个月	24.09%	1.49%	20.83%	1.51%	3.26%	-0.02%
过去一年	29.20%	1.59%	25.22%	1.61%	3.98%	-0.02%
过去三年	-10.97%	1.51%	-14.47%	1.53%	3.50%	-0.02%
过去五年	-10.79%	1.56%	-12.90%	1.60%	2.11%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	-58.08%	1.80%	-51.47%	1.82%	-6.61%	-0.02%

注：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

华宝中证1000指数分级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：按照基金合同的规定，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 2015 年 12 月 4 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		
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、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	10 年	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。

#### 4.1.1 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 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 1000 指数分级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 报告期内基金的投资策略和运作分析

作为 A 股小盘股的代表指数，中证 1000 指数在三季度伊始跟随市场明显上扬，下半月短暂回吐了前期涨幅，8 月振荡为主，9 月跟随市场明显回落。

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。报告期基金表现好于业绩基准。

#### 4.5 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 5.95%，业绩比较基准收益率为 4.53%。

#### 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	43,042,185.50	43.55
	其中：股票	43,042,185.50	43.55
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	贵金属投资	0.00	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,777,159.28	7.87
8	其他资产	48,005,645.16	48.58
9	合计	98,824,989.94	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	376,437.40	0.38
B	采矿业	913,598.32	0.93

C	制造业	27,446,495.87	27.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	879,400.70	0.89
E	建筑业	879,068.43	0.89
F	批发和零售业	1,334,207.20	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	885,197.07	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,292,171.26	5.37
J	金融业	667,336.40	0.68
K	房地产业	1,274,314.19	1.29
L	租赁和商务服务业	477,467.54	0.48
M	科学研究和技术服务业	793,336.50	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	811,503.57	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,404.80	0.02
Q	卫生和社会工作	179,666.80	0.18
R	文化、体育和娱乐业	412,430.90	0.42
S	综合	123,184.30	0.12
	合计	42,766,221.25	43.38

### 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	-	-
C	制造业	158,806.03	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,890.64	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,865.30	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,380.28	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	67,022.00	0.07
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	275,964.25	0.28
----	------------	------

注：由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

### 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	300676	华大基因	1,400	201,530.00	0.20
2	300463	迈克生物	3,500	185,430.00	0.19
3	002683	宏大爆破	3,600	181,008.00	0.18
4	300661	圣邦股份	580	173,623.00	0.18
5	603345	安井食品	1,000	172,170.00	0.17
6	300724	捷佳伟创	1,600	168,128.00	0.17
7	002065	东华软件	16,300	166,097.00	0.17
8	300699	光威复材	2,260	161,205.80	0.16
9	000799	酒鬼酒	1,900	156,465.00	0.16
10	600988	赤峰黄金	8,900	156,017.00	0.16

### 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	000029	深深房 A	6,200	67,022.00	0.07
2	605336	帅丰电器	701	17,027.29	0.02
3	605358	立昂微	659	16,119.14	0.02
4	003005	竞业达	320	16,083.20	0.02
5	003006	百亚股份	804	14,914.20	0.02

### 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

中证 1000 分级基金截至 2020 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的赤峰黄金（600988）于 2019 年 11 月 25 日收到内蒙古证监局责令改正的监督管理措施。因公司 2015 年收购郴州雄风环保科技有限公司（以下简称“郴州雄风”），形成商誉 44,141.62 万元；2018 年，公司对郴州雄风商誉减值测试时，未按照《企业会计准则第 8 号——资产减值》合理划分资产组。

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，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	2,216.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,205.53
5	应收申购款	48,001,223.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,005,645.16

### 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	000029	深深房 A	67,022.00	0.07	重大事项停牌
2	605336	帅丰电器	17,027.29	0.02	新股流通受限

**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	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
报告期期初基金份额总额	1,562,135.00	1,562,135.00	47,262,220.67
报告期期间基金总申购份额	-	-	53,040,364.01
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	5,017,879.67
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,547,301.00	2,547,301.00	-5,094,602.00
报告期期末基金份额总额	4,109,436.00	4,109,436.00	90,190,103.01

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

**§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**

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**

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。

3、基金管理人于 2020 年 9 月 9 日发布《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告》，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 1000 指数分级证券投资基金基金合同；  
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书；  
华宝中证 1000 指数分级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

2020 年 10 月 28 日