华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§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1月17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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安中证全指证券公司指数分级
场内简称	证券投基
基金主代码	160419
交易代码	160419
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月9日
报告期末基金份额总额	94,831,666.69份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数(本基金的标的指数为中证全指证券公司指数),即按照标的指数的成份股组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调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术或当调整基金投资组合,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差,追求尽可能贴近标的指数的表现,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%。 为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本较低和杠杆操作等特点,通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。
业绩比较基准	95%×中证全指证券公司指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 从本基金所分离的两类基金份额来看,华安中证证券A份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征;华安中证证券B份额具有高风险、高预期收益的特征。
基金管理人	华安基金管理有限公司
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	华安中证全指证券公司指数分级A / 华安中证全指证券公司指数分级B / 华安中证全指证券公司指数分级
下属分级基金的场内简称	证券投A / 证券投B / 证券投基
下属分级基金的交易代码	150301 / 150302 / 160419
报告期末下属分级基金的份额总额	7,585,765.00份 / 7,585,765.00份 / 79,660,136.69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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-13,528,660.48
2.本期利润	-4,859,666.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0523
4.期末基金资产净值	106,114,196.09
5.期末基金份额净值	1.1190

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(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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。

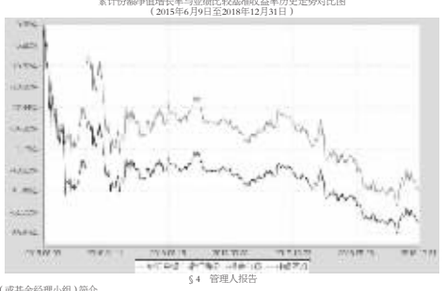
3.2 基金净值表现

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	-0.12%	2.42%	-1.51%	2.44%	1.39%	-0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月9日至2018年12月31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		
许之彦	本基金的基金经理,指数与量化投资部高级总监,总投理助理	2015-06-09	-	15年	理学博士,15年证券、基金从业经验,CQF(国际数量金融工程师),曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,2008年4月至2012年12月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理,2009年9月起同时担任上证180交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理,2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理,2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理,2013年6月起担任指数投资部高级总监,2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理,2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理,2014年11月至2015年12月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任本基金,华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理,2015年7月起担任华安创业板50指数分级证券投资基金的基金经理,2016年6月起担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2017年12月起,同时担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金,华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理,2018年11月起,同时担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,因以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配,综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易所二级市场上以同一价格成交,成交价格按照各投资组合委托量的比例进行分配,即以公司名义下达的委托指令,在交易所二级市场成交后,成交的证券按照委托比例分配给各投资组合,并以成交价格计算各投资组合应承担的成交费用。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报,若此业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签确定比例作为配,若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获利,则投资部门在相监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的twind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获利,则投资部门在相监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司各投资组合经理均定期将证券市场上所交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合间和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间以价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所发行的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与跟日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,出现同日反向交易或交易价格公允性问题的交易笔数以该证券当日成交量的5%的次数为1次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内经济仍处于明显的下行通道。12月官方制造业PMI为49.4%,两年以来首次跌破荣枯线,显示制造业景气度继续回落。居管近期货币政策放松持续加码,但由于传导渠道的不畅及滞后效应,目前来看,实体信用尚未出现明显改善,需求仍延续疲弱态势。四季度,地方国资、保险等资金组成的“纾困基金”通过多种形式对部分上市公司支援其股东予以援助,短期内券商的股权质押风险有所缓解,也使得证券指数在四季度一度出现小幅反弹,但整体上仍受基本面因素的制约,四季度下跌1.59%。

投资管理上,基金采取完全复制的管理方法跟踪指数,并利用量化工具进行精细化管理,从而控制每日跟踪误差、以及净值表现与业绩基准的偏差幅度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2018年12月31日,本基金份额净值为1.1190元,本报告期份额净值增长率为-0.12%,同期业绩比较基准增长率-1.51%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度,中美经贸关系极有可能迎来一段缓和期,但国内宏观经济的下行压力仍然很大,出口及消费需求预计仍将维持低迷,房地产投资增速将逐步下行,而基建投资的提速将承担起经济托底的重任。预计货币政策和财政政策逆周期调节的力度将进一步加大,全面的降准或降息、地方债发行的提速及较大规模的减税降费等举措都极有可能在年初推出,以进一步缓解经济下行压力。从基本面来看,券商各条业务线的景气度仍在低位徘徊,业绩还未有明显的回暖迹象,但我们认为股权质押和融资融券风险可能已经过了最艰难的阶段。尤其是纾困基金的陆续成立与落地,将对券商的股权质押风险的化解起到重要作用,市场对于证券公司的资产质量预期会有所改观。尽管券商整体的利润仍可能面临进一步萎缩,但当前板块估值处于历史底部区域,我们认为,优质的龙头券商将迎来估值修复的行情。

作为基金管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	100,360,582.36	93.19
	其中:股票	100,360,582.36	93.19
2	固定收益投资	432,828.00	0.40
	其中:债券	432,828.00	0.40
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,835,735.39	5.42
7	其他各项资产	1,060,834.94	0.99
8	合计	107,689,980.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期未未持有积极投资股票。
5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

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	100,360,582.36	94.58
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	100,360,582.36	94.58

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	600030	中信证券	950,176	15,212,317.76	14.34
2	600837	海通证券	1,068,033	9,398,690.40	8.86
3	601211	国泰君安	595,250	9,119,230.00	8.59
4	601688	华泰证券	431,145	6,984,549.00	6.58
5	600999	招商证券	377,504	5,058,553.60	4.77
6	000776	广发证券	390,718	4,954,304.24	4.67
7	600958	东方证券	472,577	3,766,438.69	3.55
8	000166	申万宏源	892,420	3,632,149.40	3.42
9	601901	方正证券	543,271	2,884,769.01	2.72
10	601377	兴业证券	618,762	2,871,055.68	2.71

5.3.2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前五名股票投资明细
本基金本报告期内积极投资未持有股票投资。
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	432,828.00	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	432,828.00	0.41

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127005	长证转债	4,400	432,828.00	0.41

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
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
无。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,474.49
2	应收证券清算款	842,901.36
3	应收股利	-
4	应收利息	2,266.61
5	应收申购款	204,192.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,060,834.94

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127005	长证转债	432,828.00	0.41

5.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600030	中信证券	15,212,317.76	14.34	重大资产重组

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。
5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安中证全指证券公司指数分级A	华安中证全指证券公司指数分级B	华安中证全指证券公司指数分级
本报告期期初基金份额总额	34,004,476.00	34,004,476.00	76,972,966.80
报告期基金总申购份额	-	-	54,849,148.40
减:报告期基金总赎回份额	-	-	50,894,208.15
报告期基金拆分变动份额	-26,418,711.00	-26,418,711.00	-1,267,770.36
本报告期期末基金份额总额	7,585,765.00	7,585,765.00	79,660,136.69

§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
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。

§8 备查文件目录
8.1 备查文件目录
1、《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》
2、《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》
3、《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书更新》
8.2 存放地点
基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。
8.3 查阅方式
投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一九年一月二十一日

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)

2018 第四季度 报告

2018年12月31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1月21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1月17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2018年10月25日(基金合同生效日)起至12月31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
基金主代码	501310
交易代码	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	65,049,268.37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。 1.组合复制策略 主要采取完全复制法,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 采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势,并利用债券定价技术,进行个券选择。
业绩比较基准	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,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金,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。
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

§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(2018年10月25日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	37,027.33
2.本期利润	-2,519,264.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0164
4.期末基金资产净值	62,093,677.93
5.期末基金份额净值	0.9546

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。

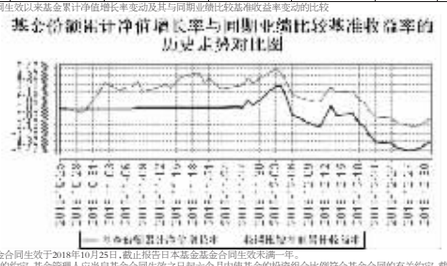
3.2 基金净值表现

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	-4.54%	0.72%	-1.34%	0.79%	-3.20%	-0.07%

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

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:1.本基金基金合同生效于2018年10月25日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2.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,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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	国际业务部总经理,华宝油气,华宝标普香港上市中国中小盘指数(LOF),华宝港股通恒生中资(香港市场简称“香港大盘”),华宝标普香港恒生香港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”)基金经理	2018年10月25日	-	12年	博士,先后在美国德州奥斯丁市德意资本,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,现任国际业务部总经理兼华宝资产管理(香港)有限公司董事。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。

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》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发起式联接基金基金合同》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。

由于股、债市的系统性风险和市盈率回归的基金资产规模变化,华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金在短期内出现过基金总资产超过基金资产净值140%和持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

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

本基金为指数基金,基金合同于2018年6月27日生效,基金管理人于2018年6月22日运用固有资金作为发起资金认购本基金,且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于3年。

根据本基金基金合同的规定,基金合同生效日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的,基金存续期内,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形之一的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

截止2018年12月31日,本基金基金合同生效未满三年,基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§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	55,460.00	0.20
	其中:股票	55,460.00	0.20
2	基金投资	25,042,945.00	92.23
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	1,935,474.13	7.13
8	其他资产	119,469.06	0.44
9	合计	27,153,348.19	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	55,460.00	0.21
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	55,460.00	0.21

5.2.2 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

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	000776	广发证券	900	11,412.00	0.04
2	000166	申万宏源	2,000	8,140.00	0.03
3	002736	国信证券	700	5,859.00	0.02
4	000783	长江证券	1,100	5,665.00	0.02
5	000728	国元证券	600	4,188.00	0.02
6	000750	国海证券	900	3,924.00	0.01
7	002673	西部证券	500	3,835.00	0.01
8	002797	第一创业	600	3,252.00	0.01
9	002500	山西证券	500	2,960.00	0.01
10	000686	东北证券	400	2,504.00	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

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	3,322,372.00	5.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,116,214.00	6.63
F	批发和零售业	1,162,075.00	1.87
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	6,087,185.80	9.80
K	房地产业	821,231.00	1.32
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	15,509,077.80	24.98

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
本报告期末未持有积极投资的境内股票。
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(%)
A 基础材料	1,822,934.10	2.94
B 消费者非必需品	1,317,217.74	2.12
C 消费者常用品	251,793.59	0.41
D 能源	4,982,669.02	8.02
E 金融	14,656,486.55	23.60
F 医疗保健	1,329,582.68	2.14
G 工业	7,186,329.55	11.57
H 信息技术	1,264,816.61	2.04
I 电信服务