华宝宝康消费品证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3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4月19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4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝宝康消费品混合
基金主代码	240001
交易代码	240001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15日
报告期末基金份额总额	430,667,071.25份
投资目标	分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长;为基金份额持有人谋求长期稳定回报。
投资策略	本基金看好消费品的发展前景,长期持有消费品组合,并注重资产在其各相关行业的配置,适当进行时机选择。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	28,667,466.89
2.本期利润	161,971,549.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.3700
4.期末基金资产净值	1,049,066,857.68
5.期末基金份额净值	2.4359

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。

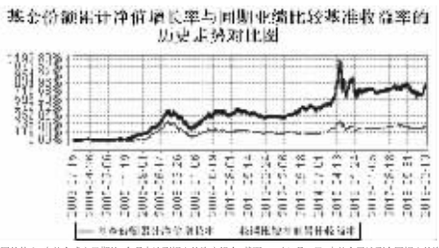
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	17.95%	1.24%	22.78%	1.24%	-4.83%	0.00%

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



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2004年1月15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		
胡戈游	助理投资总监,本基金基金经理,华宝核心优势混合基金经理	2011年2月11日	-	13年	硕士,拥有CFA资格。2005年2月加入华宝基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师、国内投资部基金经理助理等职务,现任助理投资总监。2009年5月至2010年6月任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2009年4月至2012年4月任华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2011年2月起任华宝宝康消费品证券投资基金基金经理,2013年7月至2015年12月任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2015年1月至2018年11月任华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理,2016年1月起任华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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、《华宝基金管理有限公司证券投资管理制度》、《华宝宝康系列开放式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、公司投票库管理制度、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业绩表现说明

本报告期内,基金管理人秉持"稳健、长期、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。

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

2019年1季度,中国经济表现出较强的韧劲。社会融资总量同比显著增长,3月制造业PMI快速反弹,加上中美贸易摩擦有所缓和,短期经济或阶段性企稳。在货金面、政策面、宏观数据和外围环境等多重因素的共同作用下,A股一季度出现大幅反弹,个股出现普涨,题材股表现活跃,投资者情绪快速恢复。具体来看,工业大麻、猪产业、鸡产业、国企改革等主题领跑市场;券商、农林牧渔、计算机、食品饮料和电子等行业一季度涨幅均超过40%;风格方面,小盘股走势更为强劲。本报告期中,以沪深300指数和中证100指数为代表的大盘蓝筹股指数分别上涨了28.62%和26.43%;而作为成长股代表的中小板指和创业板指分别上涨了35.66%和35.43%。在本报告期中,中证医疗指数累计上涨了30.56%。

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

本报告期基金份额净值增长率为28.50%,业绩比较基准收益率为28.90%。

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	772,128,022.64	73.10
	其中:股票	772,128,022.64	73.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	211,127,967.20	19.99
	其中:债券	211,127,967.20	19.99
	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	52,019,518.24	4.93
8	其他资产	20,944,166.99	1.98
9	合计	1,056,219,675.07	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	310,642,890.57	29.61
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	18,858,340.80	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	68,365,000.00	6.52
H	住宿和餐饮业	8,489,289.00	0.81
I	信息传输、软件和信息技术服务业	202,021,564.51	19.26
J	金融业	25,978,500.00	2.48
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	119,384,000.00	11.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	668,437.76	0.06
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	17,720,000.00	1.69
S	综合	-	-
	合计	772,128,022.64	73.60

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	601888	中国国旅	1,050,000	73,584,000.00	7.01
2	600009	上海机场	1,100,000	68,365,000.00	6.52
3	002624	完美世界	2,001,000	63,871,920.00	6.09
4	002127	南极电商	4,000,000	45,800,000.00	4.37
5	002174	游族网络	1,700,000	40,460,000.00	3.86
6	603688	石英股份	2,400,000	38,088,000.00	3.63
7	002821	凯莱英	370,000	34,054,800.00	3.25
8	600887	伊利股份	1,000,000	29,110,000.00	2.77
9	002555	三七互娱	2,000,000	27,800,000.00	2.65
10	300253	卫宁健康	1,800,000	26,280,000.00	2.51

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	62,939,800.00	6.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	148,188,167.20	14.13
	其中:政策性金融债	148,188,167.20	14.13
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	211,127,967.20	20.13

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	010107	21国债(7)	610,000	62,939,800.00	6.00
2	018005	国开1701	450,000	45,004,500.00	4.29
3	180212	18国开12	300,000	30,438,000.00	2.90
4	140219	14国开19	300,000	30,237,000.00	2.88
5	180207	18国开07	300,000	30,015,000.00	2.86

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 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	374,089.12
2	应收证券清算款	14,958,580.76
3	应收股利	-
4	应收利息	5,253,293.57
5	应收申购款	358,203.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,944,166.99

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在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

报告期期初基金份额总额	442,593,482.32
报告期期间基金总申购份额	7,760,797.23
减:报告期期间基金总赎回份额	19,687,208.30
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	430,667,071.25

注:总申购份额含转换入份额;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

报告期期初管理人持有的本基金份额	807,952.69
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	807,952.69
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.19

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

无

§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;

华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约;

华宝宝康系列开放式证券投资基金招募说明书;

华宝宝康系列开放式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4月19日

华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)

2019 第一季度 报告

2019年3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4月19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4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝标普美国品质消费股票(LOF)
场内简称	美国消费
基金主代码	162415
交易代码	162415
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2016年3月18日
报告期末基金份额总额	217,400,723.40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调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足、跟踪无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金(包括ETF),以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的标普美国品质消费股票指数收益率×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	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,主要采用完全复制法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。
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
境外资产托管人	英文名称:Brown Brothers Harriman & Co. 中文名称:布朗兄弟哈里曼银行

注:

1.本基金另设美元份额,基金代码002423,与人民币份额并表披露。

2. 截止本报告期末,本基金人民币份额净值1.471元,人民币总份额209,529,895.46份;本基金美元份额净值0.2185美元,美元总份额7,870,827.94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1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-499,857.71
2.本期利润	39,960,792.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.1584
4.期末基金资产净值	319,713,654.85
5.期末基金份额净值	1.471

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。

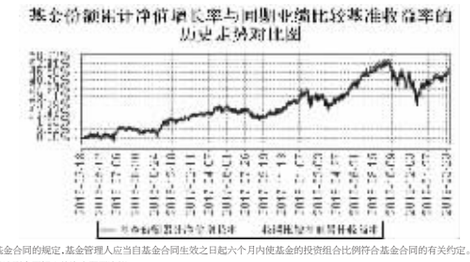
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.20%	0.92%	12.16%	0.91%	0.04%	0.01%

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



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2016年9月18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	国际业务部总经理,本基金基金经理,华宝油气,华宝标普香港上市中国中小盘指数(LOF),华宝港股通恒生中国(香港上市25指数)杨向阳称"恒生H",华宝标普沪港深中国精强价值指数杨向阳称"标普A股",华宝标普沪港深中国精强价值指数杨向阳称"标普H股"基金经理	2016年3月18日	-	14年	博士,先后在美国德州奥斯丁市能源资本、达大平洋证券、德国、纽约、中证券、德国从事数量分析、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资深策略分析师。现任国际业务部总经理兼华宝油气投资(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精强价值指数证券投资基金(LOF)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 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、《华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(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、公司投票库管理制度、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业绩表现说明

本基金采用全复制方法跟踪标普美国品质消费股票指数。在报告期内按照这一原则比较好的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。

2019年一季度标普美国品质消费指数跟随美股迅速反弹。美联储今年以来货币政策导向迅速由鹰转鸽,一月初联储主席鲍威尔就发表了鸽派言论:"联储对货币政策调整将有耐心","如果我们发现联储缩表造成了市场的动荡,我们将毫不犹豫调整缩表政策"。而三月联储议息会议明确年内不加息,同时九月结束缩表,鸽派程度甚至略超市场预期。联储货币政策重新转向宽松之余,中美贸易谈判一季度整体进展顺利,市场预期双方大概率上半年能够达成最终决议。在以上利好的刺激下,全球风险资产一季度都获得了比较大的反弹。而由于美国整体消费增速仍然稳健,美国可选消费板块一季度走势明显优于大盘。截止报告期,标普美国品质消费指数收于1149.49点,一季度涨幅15.0%,高于标普500指数13.1%的涨幅。一季度标普品质消费指数年化日均波幅为15.2%,略高于标普500指数日均波幅13.6%的水平。

日常操作过程中,人民币汇率方面,2019年一季度人民币汇率兑美元呈现升值走势。一季度人行中间价从6.8632升值至6.7335,相对于美元升值1.89%。同期,人民币交易价也相对于美元升值2.12%左右。汇率一季度整体而言对基金的人民币计价业绩有负面影响。

本报告期基金份额净值增长率为12.20%,业绩比较基准收益率为12.16%。

4.5 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	304,127,201.32	91.95
	其中:普通股	304,127,201.32	91.95
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,752,887.16	7.79
8	其他资产	868,720.16	0.26
9	合计	330,748,808.64	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(%)
美国	304,127,201.32	95.12
合计	304,127,201.32	95.12

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(%)
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	304,127,201.32	95.12
日常消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	304,127,201.32	95.12

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

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.4 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(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	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	美国	美国	6,088	72,999,260.60	22.83
2	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	美国	美国	23,327	30,140,614.11	9.43
3	MCDONALDS CORP	麦当劳	MCD US	美国	美国	15,805	20,209,721.53	6.32
4	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	美国	美国	25,996	14,740,460.80	4.61
5	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	美国	美国	25,682	12,855,597.39	4.02
6	LOWES COS INC	劳氏	LOW US	美国	美国	16,542	12,193,376.92	3.81
7	BOOKING HOLDINGS INC	Booking控股股份有限公司	BKNG US	美国	美国	929	10,915,147.53	3.41
8	TJX COMPANIES INC	TJX公司	TJX US	美国	美国	25,557	9,156,805.65	2.86
9	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM US	美国	美国	27,071	6,762,683.66	2.12
10	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT US	美国	美国	10,777	5,824,221.76	1.82

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

本基金本报告期末未持有积极投资。

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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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序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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	32,852.41
2	应收证券清算款	132,765.19
3	应收股利	-
4	应收利息	5,116.46
5	应收申购款	436,568.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	607,302.26

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。

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

报告期期初基金份额总额	263,004,328.30
报告期期间基金总申购份额	48,753,501.64
减:报告期期间基金总赎回份额	94,357,106.54
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	217,400,723.40

§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

无

§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;

华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)基金合同;

华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)招募说明书;

华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(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
2019年4月19日

华宝中证医疗指数分级证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝中证医疗指数分级
场内简称	医疗分级
基金主代码	162412
交易代码	162412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月21日
报告期末基金份额总额	407,818,641.22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在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。 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。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95