

华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 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 1-3 年国开债指数
基金主代码	009757
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 18 日
报告期末基金份额总额	515,920,284.68 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

## § 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	4,549,710.84
2. 本期利润	4,772,176.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0107
4. 期末基金资产净值	529,292,258.00
5. 期末基金份额净值	1.0259

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 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

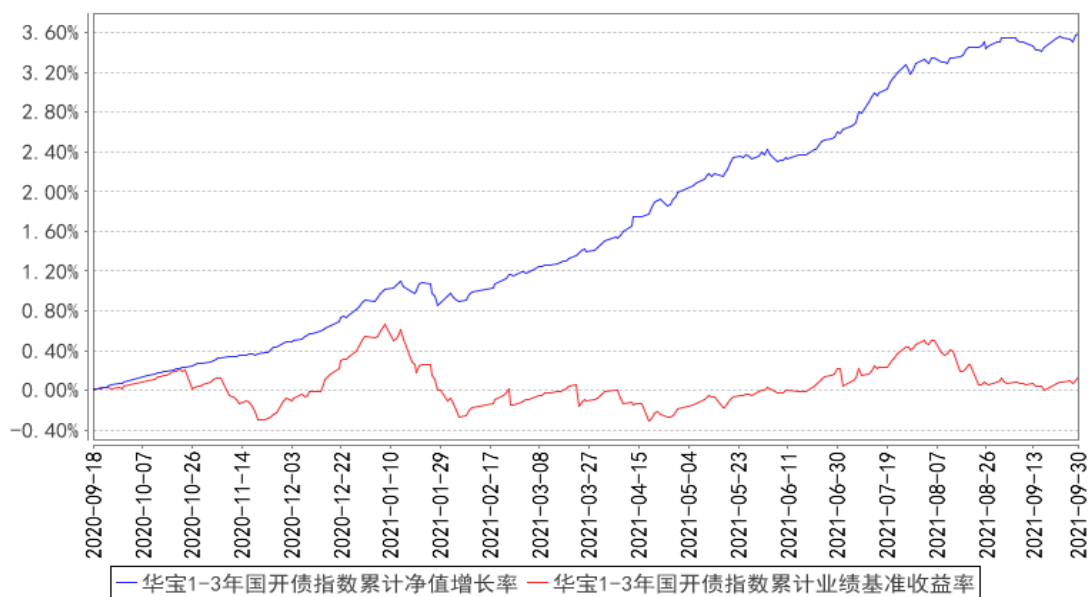
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	0.04%	-0.08%	0.05%	1.05%	-0.01%
过去六个月	2.10%	0.03%	0.19%	0.05%	1.91%	-0.02%
过去一年	3.51%	0.03%	0.10%	0.05%	3.41%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	3.59%	0.03%	0.13%	0.05%	3.46%	-0.02%

注：（1）基金业绩基准：中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（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

华宝1-3年国开债指数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6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2021年03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		
林昊	本基金基金经理	2020-09-18	-	15年	本科。2006年5月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017年3月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年3月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年12月至2018年12月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年12月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年12月至2018年7月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经

					理，2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月起任华宝安益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、《华宝中债 1-3 年国开行债券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，本基金没有发现异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场利率整体下行，收益率曲线上 3-5 年期更显陡峭化。在疫情连续局部扰动、能耗双控与限电、地产调控政策持续的背景下，8 月各主要经济指标继续走弱。最新的官方制造业 PMI 下降至 49.6，跌破荣枯线，分项指标亦整体回落。8 月规模以上工业增加值同比实际增长 5.3%，较上月回落 1.1 个百分点，工业生产回落主要受到出口放缓、高污染行业产出受限、近期自然灾害事件以及原材料价格上涨带来的冲击。1-8 月固定资产投资累计同比增速 8.9%，较 1-7 月累计同比增速下滑 2.3pct，两年复合平均增速 4.0%；制造业投资增速基本持平，原材料价格上涨和芯片短缺导致利润率受到挤压；1-8 月基建（不含电力）累计同比增速 2.9%，两年复合增速 0.2%，8 月边际改善主要与灾后重建及地方债发行环比提速有关。8 月社零总额同比增长 2.5%，分别较上月下降 6.0pct 和 2.1pct，剔除汽车外的消费增速及两年复合平均分别为 3.6% 和 1.5%，较上月增速双双回落。受本土疫情等方面影响，消费需求再现较明显回落。8 月 CPI 同比增 0.8%，较上月继续回落 0.2pct，8 月核心 CPI 同比增 1.2%，较上月回落 0.1pct，食品类（-4.1%，-0.4pct）在高基数下仍然是 CPI 最大拖累项；8 月 PPI 同比增 9.5%，较上月继续上行 0.5pct，生产资料价格同比上涨 12.7% 是主要贡献项。政策层面，继央行 7 月超预期降准后，8 月 MLF 续作量 6000 亿（到期 7000 亿）接近完全续作，9 月 MLF 等量续作 6000 亿，考虑到此前降准已经释放了 1 万亿长期资金，货币政策较为宽松。债券收益短端先下后上、中长端则下行后保持平稳，从到期收益率曲线来看，1Y 国债、国开较二季末分别下行 10BP、12BP 至 2.33%、2.40%；10Y 国债下行 20BP 至 2.88%，10Y 国开下行 29BP 至 3.20%。

华宝 1-3 年国开债指数基金在三季度总体运作平稳，在市场波动中小幅调整组合配置。本基金将在下一个报告期内继续跟踪标的指数进行基金投资，并且密切关注未来市场利率走势的变化。

#### 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 0.97%，业绩比较基准收益率为 -0.08%。

#### 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	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	459,068,415.20	86.69
	其中：债券	459,068,415.20	86.69
	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	55,955,194.93	10.57
	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	9,018,753.83	1.70
8	其他资产	5,524,964.35	1.04
9	合计	529,567,328.31	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

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

### 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 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 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 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	3,498,950.00	0.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	455,569,465.20	86.07
	其中：政策性金融债	455,569,465.20	86.07
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	459,068,415.20	86.73

### 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	190208	19 国开 08	1,200,000	121,896,000.00	23.03
2	210207	21 国开 07	800,000	80,544,000.00	15.22
3	200202	20 国开 02	600,000	59,340,000.00	11.21
4	190203	19 国开 03	500,000	50,625,000.00	9.56
5	200207	20 国开 07	500,000	50,300,000.00	9.50

### 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国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 5.9.2 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。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,167.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,523,797.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,524,964.35

### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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

报告期期初基金份额总额	494,496,789.48
报告期期间基金总申购份额	118,935,949.37
减：报告期期间基金总赎回份额	97,512,454.17
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	515,920,284.68

## § 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

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	20210701~20210930	199,420,680.02	1,945,567.60	0.00	201,366,247.62	39.03
	2	20210701~20210929	100,012,500.00	0.00	0.00	100,012,500.00	19.39
	3	20210803~20210929	97,512,432.95	0.00	0.00	97,512,432.95	18.90
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

2021 年 8 月 25 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，李慧勇不再担任公司副总经理。

## § 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；  
 华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同；  
 华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书；  
 华宝中债 1-3 年国开行债券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

2021 年 10 月 27 日