

华宝中证 100 指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：2022 年 10 月 26 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 2022 年 10 月 24 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 2022 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 100 指数
基金主代码	240014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 30 日
报告期末基金份额总额	308,110,736.28 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	本基金为股票型指数基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。	
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	289,137,132.35 份	18,973,603.93 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 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	-355,178.01	-41,993.12
2. 本期利润	-77,507,545.85	-3,679,554.06
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2537	-0.2157
4. 期末基金资产净值	455,836,123.03	29,518,394.34
5. 期末基金份额净值	1.5765	1.5558

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于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

华宝中证 100 指数 A

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	-15.38%	0.86%	-15.32%	0.90%	-0.06%	-0.04%

过去六个月	-9.74%	1.12%	-9.96%	1.13%	0.22%	-0.01%
过去一年	-20.59%	1.14%	-20.77%	1.14%	0.18%	0.00%
过去三年	8.19%	1.23%	-8.46%	1.21%	16.65%	0.02%
过去五年	24.74%	1.25%	-1.20%	1.23%	25.94%	0.02%
自基金合同 生效起至今	57.65%	1.37%	26.15%	1.36%	31.50%	0.01%

华宝中证 100 指数 C

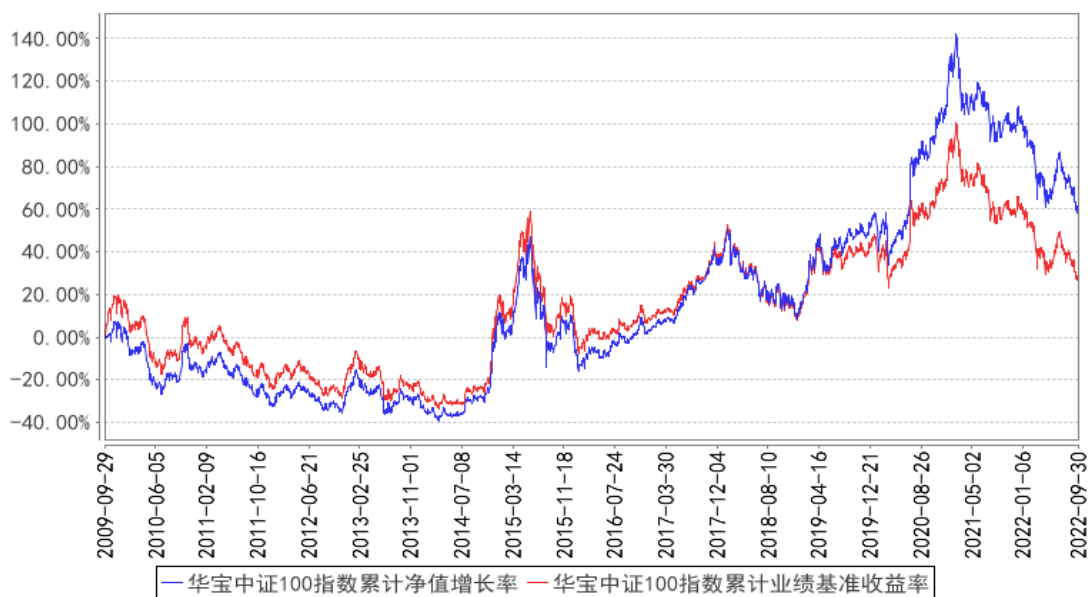
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-15.46%	0.86%	-15.32%	0.90%	-0.14%	-0.04%
过去六个月	-9.91%	1.12%	-9.96%	1.13%	0.05%	-0.01%
过去一年	-20.89%	1.14%	-20.77%	1.14%	-0.12%	0.00%
过去三年	6.92%	1.23%	-8.46%	1.21%	15.38%	0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	14.82%	1.21%	-5.78%	1.19%	20.60%	0.02%

注：（1）基金业绩基准：中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%；

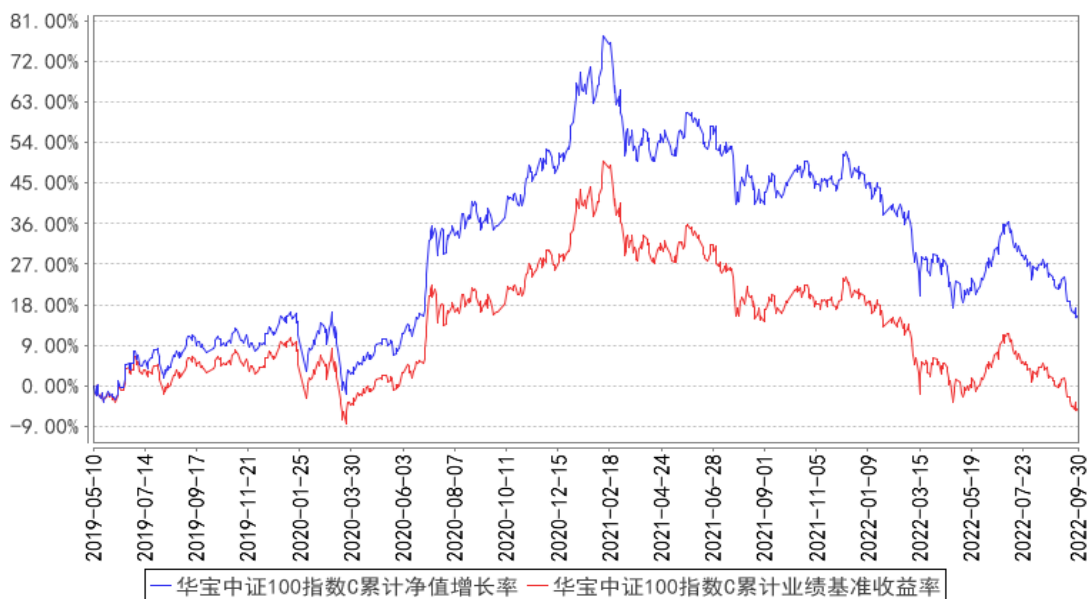
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝中证100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



华宝中证100指数C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、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 2009 年 11 月 6 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、华宝中证 100 指数 C 成立于 2019 年 5 月 10 日，本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图的数据的计算起始日期为 2019 年 5 月 10 日，C 类份额的实际起始日为 2019 年 5 月 13 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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
陈建华	本基金基金经理	2012 年 12 月 22 日	-	21 年	<p>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、基金经理助理等职务。2012 年 12 月至 2022 年 10 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月至 2021 年 1 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝智慧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，2021 年 2 月起任华宝中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任华宝中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝中证细分化工产业主题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，2021 年 10 月起任华宝中证新材料主题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，2021 年 11 月起任华宝中证智能电动汽车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，2021 年 11 月起任华宝中证金融科技主题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，2021 年 12 月起任华宝中证全指农牧渔指数型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 7 月起任华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 10 月起任华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。</p>

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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、《华宝中证 100 指数证券投资基金》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

2022 年三季度，随着欧洲、美国的通胀数据超预期，以及欧洲 PMI 数据持续低迷，全球流动性收紧的情况下对全球经济均造成较大冲击。在全球经济放缓的背景下，我国的出口增速也受到较大影响，呈现放缓迹象。但政府采取了积极的维稳经济政策，货币政策保持流动性合理充裕，随着稳增长措施的落地实施和逐步生效，为经济的高质量发展提供了有效的政策保障，国内经济回升的基础正逐步强化。展望 2022 年四季度，预计“稳增长”仍然会是国内经济政策的主要目标，宏观流动性预计将维持总体宽松的基调。市场方面，A 股三季度整体承压，估值已处于历史低位。行业方面，煤炭、综合、公用事业等行业表现较好，建筑材料、电力设备、电子等行业表现较弱。

指数方面，市场上大部分基准指数呈现普跌态势，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别下跌了 16.07%和 15.16%，而作为成长股代表的中证 1000 指数和创业板指数分别下跌了 12.45%和 18.56%。

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 A 净值增长率为-15.38%，本报告期基金份额 C 净值增长率为-15.46%；同期业绩比较基准收益率为-15.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	459,909,182.26	94.28
	其中：股票	459,909,182.26	94.28
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	27,303,207.40	5.60
8	其他资产	594,980.49	0.12
9	合计	487,807,370.15	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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	6,513,940.56	1.34
B	采矿业	21,842,222.85	4.50
C	制造业	289,483,726.56	59.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,038,013.44	3.30
E	建筑业	4,651,485.15	0.96
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,536,239.88	2.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,380,714.87	3.58
J	金融业	53,686,625.41	11.06
K	房地产业	16,336,431.38	3.37
L	租赁和商务服务业	10,573,733.32	2.18
M	科学研究和技术服务业	6,665,592.82	1.37
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	4,352,077.33	0.90
R	文化、体育和娱乐业	745,407.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	458,806,210.57	94.53

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	714,253.27	0.15
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	39,157.24	0.01
J	金融业	-	-
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	349,561.18	0.07
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	1,102,971.69	0.23

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 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	600519	贵州茅台	27,932	52,302,670.00	10.78
2	300750	宁德时代	63,500	25,456,515.00	5.24
3	601318	中国平安	482,673	20,069,543.34	4.14
4	600036	招商银行	555,566	18,694,795.90	3.85
5	601012	隆基绿能	274,873	13,169,165.43	2.71
6	600900	长江电力	516,656	11,748,757.44	2.42
7	000333	美的集团	210,911	10,400,021.41	2.14
8	002594	比亚迪	38,998	9,827,885.98	2.02
9	300059	东方财富	474,261	8,356,478.82	1.72
10	601888	中国中免	42,100	8,346,325.00	1.72

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	688371	菲沃泰	12,249	228,566.34	0.05
2	688387	信科移动	46,438	225,688.68	0.05
3	688073	毕得医药	2,340	205,920.00	0.04
4	688380	中微半导	7,318	161,581.44	0.03
5	688137	近岸蛋白	1,863	127,913.58	0.03

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝中证 100 指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 招商银行股份有限公司因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差二、漏报贷款核销业务 EAST 数据三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据四、未报送权益类投资业务 EAST 数据五、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据六、漏报贷款承诺

业务 EAST 数据七、漏报委托贷款业务 EAST 数据八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差十、EAST 系统分户账与总账比对不一致十一、漏报分户账 EAST 数据十二、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报。于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 300 万元的行政处罚决定。

华宝中证 100 指数截止 2022 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国平安保险(集团)股份有限公司因未按照规定进行国际收支统计申报于 2022 年 8 月 22 日收到国家外汇管理局深圳市分局责令改正、给予警告并处罚款人民币 30 万元的处罚决定。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和析,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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	98,311.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	496,668.75
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	594,980.49

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	占基金资产净	流通受限情况
----	------	------	----------	--------	--------

			允价值（元）	值比例（%）	说明
1	688371	菲沃泰	228,566.34	0.05	新股锁定
2	688387	信科移动	225,688.68	0.05	新股锁定
3	688073	毕得医药	205,920.00	0.04	新股流通受限
4	688380	中微半导	161,581.44	0.03	新股锁定
5	688137	近岸蛋白	127,913.58	0.03	新股锁定

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	282,718,913.98	7,040,611.15
报告期期间基金总申购份额	307,491,238.45	24,804,936.11
减：报告期期间基金总赎回份额	301,073,020.08	12,871,943.33
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	289,137,132.35	18,973,603.93

§ 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

基金管理人于 2022 年 9 月 3 日发布关于华宝中证 100 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

基金管理人于 2022 年 9 月 30 日发布关于华宝中证 100 指数证券投资基金变更为华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同和托管协议的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

2022 年 7 月 2 日，基金管理人发布董事长变更公告，黄孔威担任公司董事长，朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任向辉为公司总经理。

§ 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

2022 年 10 月 26 日