

华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券  
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	华宝中证科技龙头 ETF
场内简称	科技 ETF
基金主代码	515000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 7 月 22 日
报告期末基金份额总额	5,806,289,667.00 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的最小化。
投资策略	<p>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。</p> <p>1、组合复制策略 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，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。</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p>

	<p>本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同,控制信用风险和流动性风险的前提下,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货等金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,降低跟踪误差,以更好地实现本基金的投资目标。</p>
业绩比较基准	中证科技龙头指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用组合复制策略,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### § 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(2020年7月1日-2020年9月30日)
1. 本期已实现收益	762,573,067.99
2. 本期利润	6,416,207.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0011
4. 期末基金资产净值	9,677,766,525.09
5. 期末基金份额净值	1.6668

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	①-③	②-④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	0.20%	1.92%	-0.28%	1.96%	0.48%	-0.04%
过去六个月	27.83%	1.79%	27.22%	1.82%	0.61%	-0.03%
过去一年	46.67%	1.96%	46.55%	1.98%	0.12%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	66.68%	1.88%	72.75%	1.92%	-6.07%	-0.04%

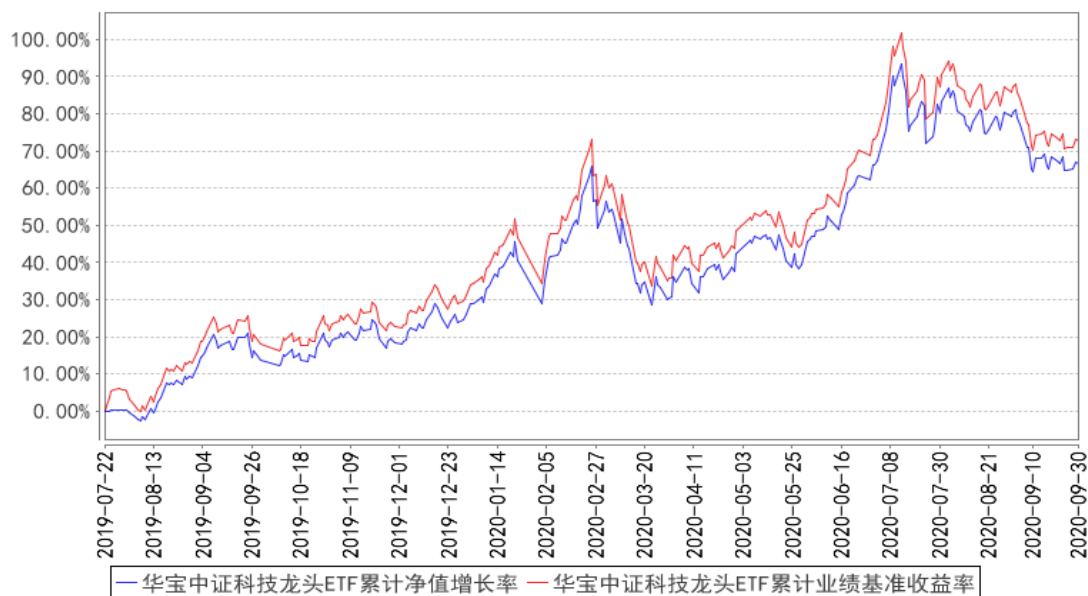
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：中证科技龙头指数收益率。

3、本基金成立于2019年7月22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

华宝中证科技龙头ETF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2020年1月22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		
胡洁	指数研发投资部总经理、本基金基金经理、华宝中证医疗指数分级、华宝中证军工 ETF、华宝标普中国 A 股红利机会指数 (LOF) (场内简称“红利基金”)、华宝中证银行 ETF (场内简称“银行 ETF”)、华宝银行 ETF 联接、华宝标普中国 A 股质量价值指数 (场内简称“质量基金”)、华宝中证医疗 ETF (场内简称“医疗 ETF”)、华宝 MSCI ESG 指数 (场内简称“ESG 基金”)、	2019 年 7 月 22 日	-	14 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任指数研发投资部总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 1 月起任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 8 月起任华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头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。2019 年 12 月起任华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。

	华宝科技 ETF 联接、 华宝消费 龙头指数 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、《华宝中证科技龙头交易型开放式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

2020 年 3 季度，随着全球基本面的缓慢复苏以及新冠肺炎疫情对国内经济增长的影响减弱，中国经济在内外需双驱动之下趋于上升趋势。与此同时，在贸易战影响长期存在的大背景下，核心产业的转型升级仍然是国内经济关注的焦点，科技创新、新基建、消费升级仍然是未来政策支持的重点。证券市场方面，外有扰动，内有利好，A 股和中国资产中长期向好的趋势并未改变。美国大选不确定性、美股高波动等外部因素扰动仍是近期 A 股市场主要波动和不确定性的来源。国内制造业、服务业等数据亦进一步验证中国经济仍在持续恢复。三季度市场行情主要围绕休闲服务、国防军工、汽车、食品饮料、券商等板块展开。其中，休闲服务、国防军工、食品饮料、券商等行业表现较好，通信、计算机、银行等行业表现较弱。本报告期内，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上涨 10.36%和 10.17%；而作为成长股代表的创业板指和中证 500 指数分别上涨了 5.60%和 5.59%。在本报告期内，中证科技龙头指数累计下跌 0.28%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，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 0.20%，业绩比较基准收益率为-0.28%。

#### 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	9,560,614,409.09	97.83
	其中：股票	9,560,614,409.09	97.83

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	133,245,598.74	1.36
8	其他资产	79,205,746.45	0.81
9	合计	9,773,065,754.28	100.00

注：1, 此处股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上可能不相等。

2, 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 722,619,951.00, 占基金资产净值的比例为 7.47%。

## 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	7,775,516,898.41	80.34
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	1,420,634,391.71	14.68
J	金融业	138,930,547.14	1.44
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	218,991,224.95	2.26



R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,554,073,062.21	98.72

### 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	5,366,721.86	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	28,264.03	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,029,536.49	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	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	70,328.62	0.00
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	6,541,346.88	0.07

### 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	002475	立讯精密	17,071,188	975,276,970.44	10.08
2	600276	恒瑞医药	10,660,953	957,566,798.46	9.89
3	002415	海康威视	15,231,553	580,474,484.83	6.00
4	000725	京东方 A	110,337,900	541,759,089.00	5.60

5	300760	迈瑞医疗	1,485,864	517,080,672.00	5.34
6	000661	长春高新	1,153,838	426,504,678.32	4.41
7	002241	歌尔股份	9,250,892	374,013,563.56	3.86
8	000063	中兴通讯	10,985,624	363,624,154.40	3.76
9	600570	恒生电子	3,397,102	334,920,286.18	3.46
10	600588	用友网络	6,609,792	252,560,152.32	2.61

### 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	300999	金龙鱼	121,132	3,113,092.40	0.03
2	688318	财富趋势	4,356	973,827.36	0.01
3	688505	复旦张江	22,688	489,380.16	0.01
4	688085	三友医疗	8,807	450,566.12	0.00
5	688330	宏力达	3,573	315,245.79	0.00

### 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

科技 ETF 基金截至 2020 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的用友网络（600588）因在 2019 年以集中竞价交易方式回购股份中，实际回购完成金额占回购计划金额的 46.91%，未完成原有回购计划。2020 年 2 月 28 日，上海证券交易所对公司及董事长予以口头警示。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他析，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	1,993,340.92
2	应收证券清算款	76,650,140.23
3	应收股利	-
4	应收利息	529,802.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,462.32
8	其他	-
9	合计	79,205,746.45

### 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

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	000661	长春高新	80,211,880.00	0.83	转融通流通受限
2	002475	立讯精密	70,041,380.00	0.72	转融通流通受限
3	002241	歌尔股份	69,454,697.00	0.72	转融通流通受限
4	002415	海康威视	50,800,630.00	0.52	转融通流通受限
5	000063	中兴通讯	43,725,100.00	0.45	转融通流通受限
6	000725	京东方 A	34,517,300.00	0.36	转融通流通受限
7	600276	恒瑞医药	17,514,900.00	0.18	转融通流通受限
8	300760	迈瑞医疗	7,656,000.00	0.08	转融通流通受限
9	600588	用友网络	1,230,362.00	0.01	转融通流通受限
10	600570	恒生电子	985,900.00	0.01	转融通流通受限

#### 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	300999	金龙鱼	3,113,092.40	0.03	新股流通受限
2	688318	财富趋势	973,827.36	0.01	新股锁定
3	688505	复旦张江	489,380.16	0.01	科创板锁定

4	688085	三友医疗	450,566.12	0.00	新股锁定
5	688330	宏力达	315,245.79	0.00	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

报告期期初基金份额总额	5,888,289,667.00
报告期期间基金总申购份额	2,224,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	2,306,000,000.00
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	5,806,289,667.00

### §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。

## § 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；  
华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
华宝中证科技龙头交易型开放式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

2020 年 10 月 28 日