

华宝中证银行交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2018 年第 4 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 11 月 27 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况（转型后）

基金简称	华宝银行 ETF 联接
基金主代码	240019
交易代码	240019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 27 日
报告期末基金份额总额	65,090,698.45 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，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	1、目标 ETF 投资策略 1) 投资组合的投资方式 本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。 2) 投资组合的调整 本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。 2、股票投资策略 本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基

	金将参与一级市场新股认购。 3、债券投资策略 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	
业绩比较基准	中证银行指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为指数型基金，本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，并且具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝银行 ETF 联接 A	华宝银行 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	240019	006697
报告期末下属分级基金的份额总额	65,088,410.59 份	2,287.86 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华宝中证银行 ETF
基金主代码	512800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 18 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 8 月 3 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

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	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 本基金主要采取复制法，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。 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 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。 4、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、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。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证银行指数
风险收益特征	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，跟踪中证银行指数，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。

2.1 基金产品情况（转型前）

基金简称	华宝上证 180 成长 ETF 联接
基金主代码	240019
交易代码	240019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 9 日
报告期末基金份额总额	65,425,893.96 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	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或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，本管理人会在 10 个交易日内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。本基金对标的指数的跟踪目标是：在正常情况下，本基金相对于业绩比较基准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%。
业绩比较基准	$95\% \times \text{上证 180 成长指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相

	近的产品。
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

2.1.1 目标基金产品说明（转型前）

基金名称	上证 180 成长 ETF
基金主代码	510280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 10 月 18 日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明（转型前）

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	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	上证 180 成长指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2018 年 11 月 27 日 — 2018 年 12 月 31 日 ）	
	华宝银行 ETF 联接 A	华宝银行 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-1,191,327.39	-37.41
2. 本期利润	-4,271,368.09	-132.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0654	-0.0687
4. 期末基金资产净值	60,822,893.42	2,137.30
5. 期末基金份额净值	0.9345	0.9342

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 11 月 26 日 ）
1. 本期已实现收益	5,319,957.56
2. 本期利润	-4,925,067.78
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1152
4. 期末基金资产净值	65,425,893.96
5. 期末基金份额净值	1.0000

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（转型后）

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

华宝银行 ETF 联接 A

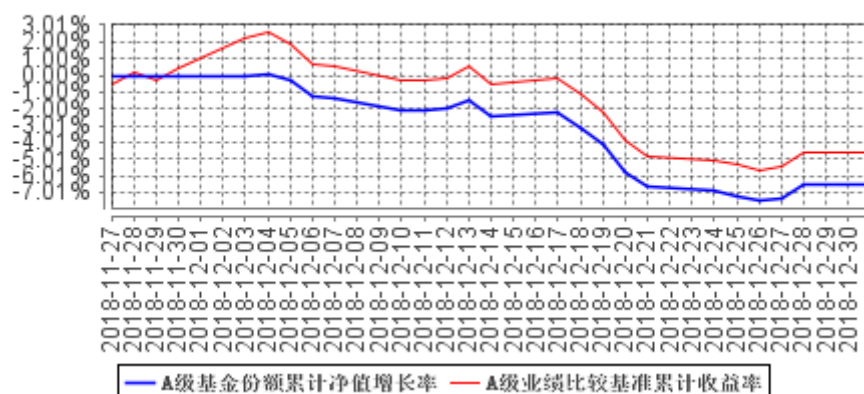
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.55%	0.58%	-4.67%	0.79%	-1.88%	-0.21%

华宝银行 ETF 联接 C

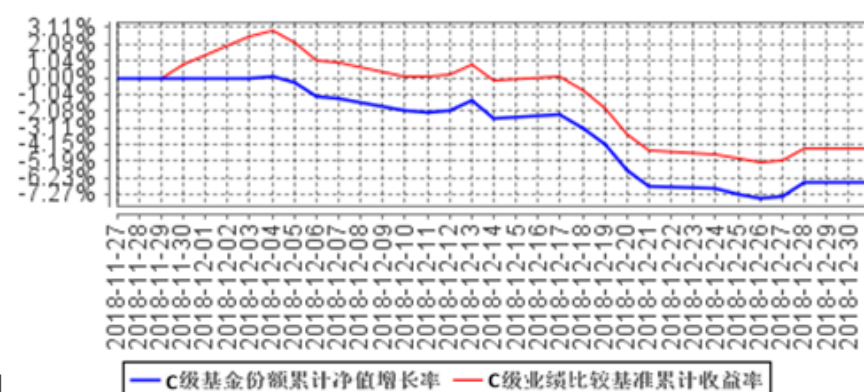
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.58%	0.60%	-4.85%	0.80%	-1.73%	-0.20%

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

A级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



C级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 11 月 27 日,截至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。

3.2 基金净值表现 (转型前)

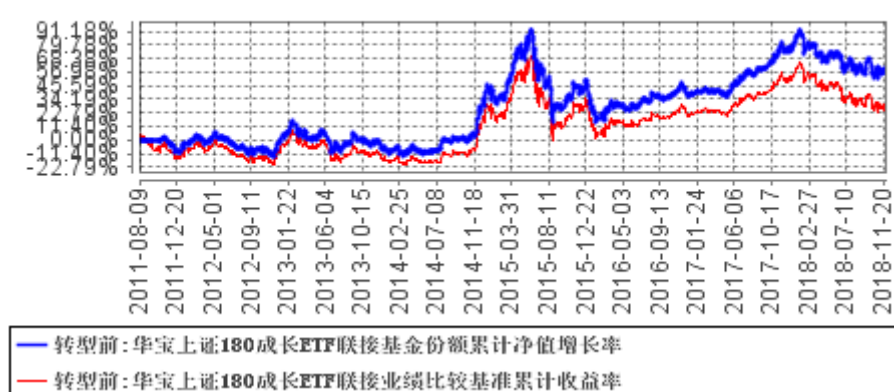
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.07%	1.73%	-9.37%	1.83%	2.30%	-0.10%
-------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

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

华宝上证180成长ETF联接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. 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 2012 年 2 月 9 日, 本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2. 华宝上证 180 成长 ETF 联接的统计区间为 2011/8/9-2018/11/26。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介 (转型前)

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	本基金基金经理、量化投资部副总经理、上证 180 成长 ETF、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)、华宝中证银行 ETF (场内简称	2012 年 10 月 16 日	2018 年 11 月 26 日	12 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, 现任量化投资部副总经理。2012 年 10 月起任上证 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 5 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理, 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,

	“银行 ETF”) 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。
--	--------------------	--	--	--	---

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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	本基金基金经理、量化投资部副总经理、上证 180 成长 ETF、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)、华宝中证银行 ETF (场内简称“银行 ETF”) 基金经理	2018 年 11 月 27 日	-	12 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, 现任量化投资部副总经理。2012 年 10 月起任上证 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 5 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理, 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, 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。

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指数成分股的调整，上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金出现了持有不属于 180 成长指数的成分股及其备选股、基金总资产超过基金资产净值 140%、持有上证 180 成长 ETF 低于基金资产净值 90%及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的情况。由于持有的非上证 180 成长指数的成份股和备选成份股仍处于停牌状态，此情况将在合理期限内调整。

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、《华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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指数成分股的调整，华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金出现了持有不属于中证银行的成分股及其备选股的情况。由于持有的非中证银行指数的成份股和备选成份股仍处于停牌状态，此情况将在合理期限内调整。

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

2018 年四季度，国内经济整体走弱，12 月 PMI 跌破 50 的荣枯线，工业企业盈利增速两年来首度告负，消费、交运、建筑相对保持高景气。中美贸易摩擦阶段性缓和，后续发展仍有具有一定的不确定性。在艰难而复杂的经济环境下，政府开始通过结构性宽松和减税等政策刺激经济，国内的货币和财政政策边际转暖，企业进入盈利寻底阶段。从 A 股表现来看，四季度市场呈现普跌态势，所有申万一级行业指数均取得负收益。相对而言，农林牧渔和券商跌幅较少，周期板块和医药板块的跌幅较大。风格方面，大小盘分化不明显，跌幅相当。本报告期内，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下跌了 12.45% 和 12.5%；而作为成长股代表的小板指和创业板指分别下跌了 18.22% 和 11.39%。在本报告期内，中证银行指数累计下跌了 9.32%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前截至 2018 年 11 月 26 日，本报告期基金份额净值增长率为-7.07%，同期业绩比较基准-9.37%；转型后截至本报告期末华宝银行 ETF 联接 A 基金份额净值为 0.9345 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为-6.55%，同期业绩比较基准-4.67%；截至本报告期末华宝银行 ETF 联接 C 基金份额净值为 0.9342 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为-6.58%；同期业绩比较基准收益率为-4.85%。

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

转型后：

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	5,827.43	0.01
	其中：股票	5,827.43	0.01
2	基金投资	57,650,100.00	93.64
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	3,807,655.50	6.19
8	其他资产	100,382.59	0.16
9	合计	61,563,965.52	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	5,827.43	0.01
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	—	—
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	5,827.43	0.01

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	600485	信威集团	581	5,827.43	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

本基金本报告期末未持有权证。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金	指数型	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	57,650,100.00	94.78

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.11.2 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。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	50,284.96
2	应收证券清算款	33,490.10
3	应收股利	—
4	应收利息	870.69
5	应收申购款	15,736.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	100,382.59

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末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	600485	信威集团	5,827.43	0.01	重大事项停牌

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内，本基金持有目标 ETF 基金（“华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金”）的公允价值为 57,650,100.00 元，占基金资产净值比例为 94.78%。

转型前：

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	6,100.50	0.01
	其中：股票	6,100.50	0.01
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	65,527,622.62	99.96
8	其他资产	16,859.11	0.03
9	合计	65,550,582.23	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	6,100.50	0.01
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	—	—
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	6,100.50	0.01

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	600485	信威集团	581	6,100.50	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

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**

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	1,627.73
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	15,231.38

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,859.11

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

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	600485	信威集团	6,100.50	0.01	重大事项停牌

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华宝银行 ETF 联接 A	华宝银行 ETF 联接 C
基金合同生效日(2018 年 11 月 27 日) 基金份额总额	65,425,893.96	0.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	680,459.65	2,292.86
减:基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	1,017,943.02	5.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	65,088,410.59	2,287.86

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	40,727,781.92
报告期间基金总申购份额	23,715,280.48

减:报告期期间基金总赎回份额	22,631,093.40
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	23,613,924.96
报告期期末基金份额总额	65,425,893.96

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(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型后)

单位:份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	600,674.62
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	339,239.83
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	939,914.45
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例(%)	1.44

注:报告期间买入/申购总份额填报的数据为该基金转型后强制调增的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型后)

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	强制调增	2018年11月27日	339,239.83	339,239.83	0.00%
合计			339,239.83	339,239.83	

注:填报的数据为该基金转型后强制调增的份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	600,674.62
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	600,674.62
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.44

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例所采用的分母为未转型前的基金总份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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	20181001~20181231	12,894,261.76	7,282,224.13	0.00	20,176,485.89	31.00%
	2	20181025~20181028	0.00	15,413,615.92	15,413,615.92	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金由华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来，本基金基金合同自 2018 年 11 月 27 日起生效。

§ 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；
华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同；
华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书；
华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议；
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住所备投资者查阅。

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 1 月 21 日