

华宝中证港股通互联网交易型开放式指数  
证券投资基金发起式联接基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 年 10 月 25 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 2024 年 10 月 23 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 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接
基金主代码	017125
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2022 年 12 月 6 日
报告期末基金份额总额	112,506,163.35 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	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金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控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 本基金可以通过申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。
业绩比较基准	中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）× 95% + 人民币银行活期存款利率（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。本基金投资港股通标的股票，将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 A	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	017125	017126
报告期末下属分级基金的份额总额	23,430,722.38 份	89,075,440.97 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	513770
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 2 月 9 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 2 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	中国工商银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

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。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股。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。
业绩比较基准	中证港股通互联网指数收益率
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。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。本基金主要通过港股通机制投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来

的特有风险。

### §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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 A	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 C
1. 本期已实现收益	-955,974.75	-2,727,506.05
2. 本期利润	4,540,580.59	16,026,805.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1607	0.2068
4. 期末基金资产净值	23,303,750.54	88,113,540.80
5. 期末基金份额净值	0.9946	0.9892

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

华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 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	26.27%	1.94%	29.25%	2.06%	-2.98%	-0.12%
过去六个月	31.77%	1.97%	36.77%	2.09%	-5.00%	-0.12%
过去一年	18.24%	2.03%	18.77%	2.09%	-0.53%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.54%	1.96%	-0.03%	2.06%	-0.51%	-0.10%

华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 C

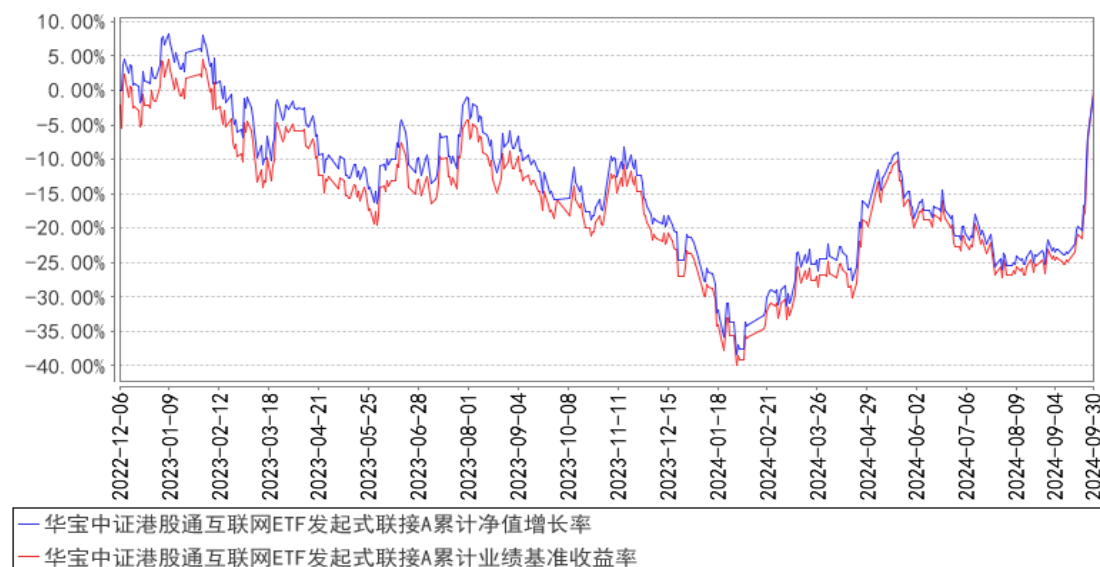
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	26.17%	1.94%	29.25%	2.06%	-3.08%	-0.12%
过去六个月	31.58%	1.97%	36.77%	2.09%	-5.19%	-0.12%
过去一年	17.87%	2.03%	18.77%	2.09%	-0.90%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-1.08%	1.96%	-0.03%	2.06%	-1.05%	-0.10%

注：（1）基金业绩基准：中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%；

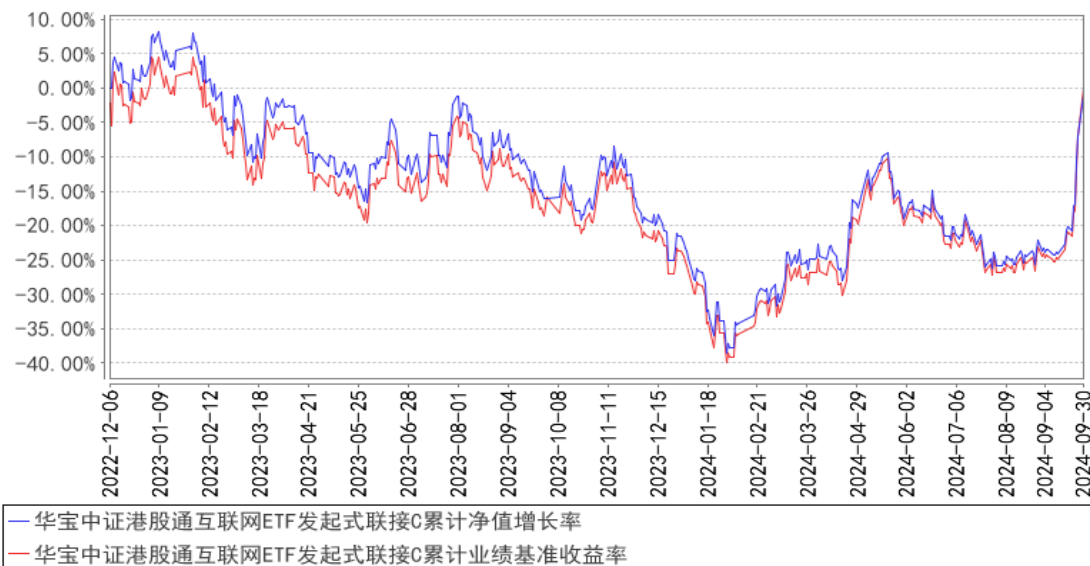
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 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

华宝中证港股通互联网ETF发起式联接A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



华宝中证港股通互联网ETF发起式联接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：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 2023 年 06 月 06 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	本基金基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理	2022-12-06	-	20 年	博士。先后在德亚投资(美国)、华宝基金、汇丰证券(美国)从事风控、投资分析等工作。2011 年 6 月再次加入华宝基金管理有限公司，先后担任策略部总经理、首席策略分析师、海外投资部总经理等职务，现任公司总经理助理兼国际业务部总经理。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝兴业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 月任华宝兴业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 月起任华宝标普香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 月至 2023 年 3 月任华宝港股通恒生香港 35 指

					<p>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增强价值指数证券投资基金(LOF)基金经理,2019年11月起任华宝致远混合型证券投资基金(QDII)基金经理,2020年11月至2023年11月任华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金经理,2022年2月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022年9月起任华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金经理,2022年12月起任华宝中证港股通互联网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,2023年3月起任华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金(QDII)基金经理,2023年4月起任华宝海外科技股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金经理,2023年5月起任华宝海外新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII)基金经理。</p>
丰晨成	本基金基金经理	2022-12-06	-	15年	<p>硕士。2009年7月加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015年11月起任华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2016年8月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年4月至2021年1月任华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理,2018年6月起任华宝中证全指证券公司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,2018年8月至2020年11月任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理,2020年11月起任华宝中证1000指数证券投资基金基金经理,2022年2月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022年9月至2023年3月任华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金(LOF)基金经理,2022年12月起任华宝中证港股通互联网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。</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、《华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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。

#### 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

三季度伊始港股互联网板块延续此前的振荡走低，受宏观经济数据透露的复苏节奏的不确定，北向持续流出 A 股，而与此同时南向资金持续流入港股市场，并且互联网公司的中报财报体现出较强的经营韧性，在宏观经济环境疲软的背景下，多数互联网公司的盈利水平超出市场一致预期，盈利增速远超收入增速，使得 8 月起彭博对 MSCI 中国指数的 24/25 年 EPS 一致预期出现持续上修趋势，这也是港股市场在 8、9 月间表现明显强于 A 股的逻辑基石。9 月中旬美联储的降息叠加



9 月 24 日金融口负责人新闻发布会、9 月 26 日政治局会议透露出托底经济的决心和意志，货币、财政、地产、金融等政策组合拳接棒发力，并储备一批政策工具适时推出，市场情绪被点燃，A 股和港股出现短期大涨势头。由于港股互联网 ETF 标的指数的高弹性，在上涨过程中表现优于恒生指数和恒生科技指数。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 26.27%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 26.17%；同期业绩比较基准收益率为 29.25%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

### §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	100,577,469.92	86.06
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	8,326,041.64	7.12
8	其他资产	7,962,507.44	6.81
9	合计	116,866,019.00	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。

### 5.4 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金	指数基金	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	100,577,469.92	90.27

### 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 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

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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,579.30
2	应收证券清算款	2,067.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,882,912.31
6	其他应收款	-
7	其他	1,058,948.71
8	合计	7,962,507.44

### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.12.6 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	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 A	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 C
报告期期初基金份额总额	32,309,686.99	70,517,206.21
报告期期间基金总申购份额	3,194,417.97	126,829,191.32

减: 报告期期间基金总赎回份额	12, 073, 382. 58	108, 270, 956. 56
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	23, 430, 722. 38	89, 075, 440. 97

## §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

项目	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 A	华宝中证港股通互联网 ETF 发起式联接 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9, 900, 000. 00	100, 000. 00
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	9, 900, 000. 00	100, 000. 00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	42. 25	0. 11

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10, 000, 000. 00	8. 89	10, 000, 000. 00	8. 89	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10, 000, 000. 00	8. 89	10, 000, 000. 00	8. 89	-

注: 1、本基金募集期间, 本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10, 001, 000. 00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年;

2、本基金管理人运用固有资金于 2022 年 12 月 2 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1, 000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同；

华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书；

华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议；

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。

### 10.2 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。

### 10.3 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

2024 年 10 月 25 日