

# 华富中证100指数证券投资基金

## 2018年第四季度报告

今年四季度,中证100指数收益为-7.23%,业绩基准为-7.53%,跟踪偏离为0.6%,年化跟踪误差为7.73%。基金净值增长主要来自打新收益和成分股分红,以及在大部分下跌时,基金仓位调整仓位。

在2019年一季度中,我们将继续通过严格的资产估值和量化风控策略,力争实现对业绩基准的有效跟踪。同时结合打新策略,在严格控制基金跟踪误差的前提下,适当优化基金的成本收益。为投资者提供有效跟踪中证100指数的投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
本基金于2009年12月30日正式成立,截至2018年12月31日,本基金份额净值为1.1138元,累计净值1.1138元。本基金本报告期份额净值增长率为-11.22%,同期业绩比较基准收益率为-11.77%。

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出现基金份额持有人数量不满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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	81,363,061.15	92.20
2	债券投资	81,363,061.15	92.20
3	固定收益投资	-	-
4	货币资金	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,703,296.34	7.61
8	其他资产	301,264.03	0.34
9	合计	88,027,438.14	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股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	3,175,390.01	3.62
C	建筑业	28,646,783.17	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,361,161.21	26.89
E	建筑业	3,769,027.46	4.30
F	批发和零售业	708,719.16	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	2,596,490.43	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,283,240.27	1.47
J	金融业	38,133,132.92	43.11
K	房地产业	4,304,302.67	4.95
L	租赁和商务服务业	1,244,310.62	1.40
M	科学研究和技术服务业	97,310.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、文化和体育业	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	公共管理	-	-
R	综合	80,396,530.00	92.20

注:本基金本报告期股票投资组合符合前于2019年1月1日调中中证100指数的资产配置,具体情况参阅中证指数有限公司相关公告。因成份股停牌,流动性不足导致未能及时的按比例调整等限制导致本基金仓位高于中证100指数成份股或者无法按照中证100指数成份股的权重购买足够数量的成份股时,本基金可以根据市场情况,买入该成份股的替代股票,以维持该成份股在本基金

资产配置中的配置比例。

#### 5.2.2 报告期末积极投资行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	3,175,390.01	3.62
C	建筑业	28,646,783.17	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,361,161.21	26.89
E	建筑业	3,769,027.46	4.30
F	批发和零售业	708,719.16	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	2,596,490.43	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,283,240.27	1.47
J	金融业	38,133,132.92	43.11
K	房地产业	4,304,302.67	4.95
L	租赁和商务服务业	1,244,310.62	1.40
M	科学研究和技术服务业	97,310.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、文化和体育业	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	公共管理	-	-
R	综合	80,396,530.00	92.20

注:本基金本报告期股票投资组合符合前于2019年1月1日调中中证100指数的资产配置,具体情况参阅中证指数有限公司相关公告。因成份股停牌,流动性不足导致未能及时的按比例调整等限制导致本基金仓位高于中证100指数成份股或者无法按照中证100指数成份股的权重购买足够数量的成份股时,本基金可以根据市场情况,买入该成份股的替代股票,以维持该成份股在本基金

资产配置中的配置比例。

#### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股投资股票。

#### 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	601318	中国平安	136,428	7,603,010.00	8.72
2	600535	贵研铂业	6,362	3,771,263.00	4.30
3	600288	包装印刷	129,349	3,272,110.00	3.73
4	601100	纳创世纪	107,811	2,264,700.34	2.60
5	000051	格力电器	80,844	2,171,022.38	2.47
6	600333	旭光能源	58,273	2,161,028.79	2.46
7	601288	农业银行	191,964	2,131,070.40	2.43
8	600000	浦发银行	187,480	1,738,360.00	1.99
9	600039	四川路桥	312,374	1,791,040.00	2.04
10	600087	伊泰煤炭	76,301	1,752,402.08	2.00

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注: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

注: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

注: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五名权证投资

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.10 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.11 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.12 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.13 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.14 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.15 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.16 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.17 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.18 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.19 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.20 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.21 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.22 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.23 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.24 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.25 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.26 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.27 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.28 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.29 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.30 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.31 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.32 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.33 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.34 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.35 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.36 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.37 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.38 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.39 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.40 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.41 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.42 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

注:本基金本报告期末未持有权证。

基金管理人:华富基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:2019年1月21日

基金管理人:华富基金管理有限公司  
基金托管人: