

## 华宝高端制造股票型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金增持了消费电子、通信等行业龙头股,减持了医药、白酒、基建等行业龙头股。自预期的表现与预期相符,才能逐渐向右侧交易。回顾四季度,消费、基建两板块开始上行,经济下行压力依旧和风险仍然较高。

三季度以来A股指数持续下跌,上证50在银行和保险的支撑下震荡上行,九月中旬后,贸易关税落地,国内出口消费刺激政策,叠加外盘股市走强,市场情绪有所改善,A股出现大幅反弹,报告期内,上证50大涨5.11%,而代表大盘股为主的上证500和中证1000分别上涨7.99%和11.06%,风格分化明显。

本基金在报告期内更换了基金经理,对组合进行了适当的调整,主要在可投资的行业板块内挑选了技术具有领先性、业绩在行业中突出且未来发展潜力较大的龙头股公司进行配置。

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为-8.96%,同期业绩比较基准收益率为-6.84%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为-8.96%,同期业绩比较基准收益率为-6.84%。

4.6 报告期内基金管理人及基金经理变更情况

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	306,386,704.97	86.36
2	其中:股票	306,386,704.97	86.36
3	固定收益投资	1,863,452.91	0.51
4	其中:债券	1,863,452.91	0.51
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	1,863,452.91	0.51
9	其他资产	-	-
10	合计	308,250,157.88	86.87

注:1. 任日期以及离职日期均以基金公告为准。  
2. 证券从买入到卖出期间计入基金公告为准。

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投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格按照法律法规和公司内部控制制度,公平对待所有基金持有人,保护基金持有人的合法权益,没有损害基金持有人的利益的行为。

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决策规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度,严格执行集中交易、系统集中公平交易程序,每日交易后稽核,定期基金投资绩效评估等机制,确保所管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节得到公平对待。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差异,分投资组合(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情形。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

5.2 报告期末按行业分类的债券投资组合报告

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	269,028,759.00	79.60
C 批发和零售业	199,248,006.03	60.60
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,046,530.00	0.93
E 建筑业	9,438,400.00	2.87
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	1,131,220.00	0.30
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	6,089,070.00	1.89
J 房地产业	32,026,012.14	9.84
K 租赁和商务服务业	7,222,000.00	2.20
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	326,486,704.97	86.22

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	269,028,759.00	79.60
C 批发和零售业	199,248,006.03	60.60
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,046,530.00	0.93
E 建筑业	9,438,400.00	2.87
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	1,131,220.00	0.30
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	6,089,070.00	1.89
J 房地产业	32,026,012.14	9.84
K 租赁和商务服务业	7,222,000.00	2.20
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	326,486,704.97	86.22

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.5 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.7 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.9 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.11 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.13 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.15 报告期末按行业分类的债券投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	-	-
G 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	-	-
J 房地产业	-	-
K 租赁和商务服务业	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 建筑业	-	-
O 其他	-	-
合计	-	-

5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C 批发和零售业	-	-
D 电力、热力、燃气		