

华夏大盘精选证券投资基金

2018年第三季度报告

为-5.95%，同期业绩比较基准增长率为-0.15%。
4.6 报告期内本基金未出现违反《证券投资基金运作管理办法》规定的情形。
报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 投资组合报告

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时间	证券从业年限	说明
魏庆	基金经理	2016-10-20	10年	硕士研究生学历，毕业于南开大学。2007年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、基金经理。2016年10月20日起任华夏大盘精选证券投资基金基金经理。2017年11月10日至2017年11月10日任华夏大盘精选证券投资基金基金经理。2017年11月10日至2017年11月10日任华夏大盘精选证券投资基金基金经理。2017年11月10日至2017年11月10日任华夏大盘精选证券投资基金基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任免日期。
②证券从业的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理人内部控制指引》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额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
本基金管理人一贯公平对待持有管理的所有基金和组合，制定并严格执行相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
3季度，美国经济仍然强劲，欧元区经济疲软，贸易摩擦持续，加大了全球经济和全球金融市场的不确定性。国内经济虽有所下行，但整体处于平稳区间，消费增速短期内有所下行，但整体保持平稳，并成为经济增量的重要支撑。A股持续下跌，大盘蓝筹股跌幅较大，创业板跌幅较大，市场风格偏向进一步避险。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未出现及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
3季度，美国经济仍然强劲，欧元区经济疲软，贸易摩擦持续，加大了全球经济和全球金融市场的不确定性。国内经济虽有所下行，但整体处于平稳区间，消费增速短期内有所下行，但整体保持平稳，并成为经济增量的重要支撑。A股持续下跌，大盘蓝筹股跌幅较大，创业板跌幅较大，市场风格偏向进一步避险。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未出现及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
3季度，美国经济仍然强劲，欧元区经济疲软，贸易摩擦持续，加大了全球经济和全球金融市场的不确定性。国内经济虽有所下行，但整体处于平稳区间，消费增速短期内有所下行，但整体保持平稳，并成为经济增量的重要支撑。A股持续下跌，大盘蓝筹股跌幅较大，创业板跌幅较大，市场风格偏向进一步避险。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未出现及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

截至2018年9月30日，本基金份额净值为12.299元，本报告期份额净值增长率

为-5.95%，同期业绩比较基准增长率为-0.15%。
4.6 报告期内本基金未出现违反《证券投资基金运作管理办法》规定的情形。
报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 投资组合报告
4.7.1 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	2,941,196,390.27	82.03
2	固定收益投资	2,941,066,390.27	82.03
3	买入返售金融资产	203,966,000.00	5.80
4	银行存款	203,966,000.00	5.80
5	其他资产	203,966,000.00	5.80
6	其他负债	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,549,134,670.54	100.00

4.7.2 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	医药、生物	1,796,404,472.77	4.30
B	制造业	10,776,488,028.43	26.09
C	电力、热力、燃气及生产和供应业	2,017,088,066.04	4.87
D	信息技术	698,230,470.13	1.63
E	金融业	548,230,470.13	1.28
F	其他	26,511,689,302.52	58.76
G	其他	1,224,669,302.52	2.81
H	其他	-	-
I	其他	-	-
J	其他	-	-
K	其他	-	-
L	其他	-	-
M	其他	-	-
N	其他	-	-
O	其他	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
T	其他	-	-
合计		41,226,961,766.24	96.81

4.7.3 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	600000	贵州茅台	17,000,000	280,800,000.00	7.97
2	600019	中国银行	3,898,402	223,818,785.64	5.28
3	600176	招商局	19,439,669	220,259,700.40	5.04
4	600128	中国神华	9,863,922	196,586,907.28	4.53
5	600019	工商银行	21,569,183	178,266,866.56	4.03
6	600029	中信证券	24,019,919	165,919,454.47	3.77
7	300134	汇川技术	5,799,917	160,667,700.00	3.60
8	600089	玲珑轮胎	18,494,956	155,353,367.68	3.50
9	600036	招商银行	4,589,303	141,371,023.07	3.16
10	600088	鲁商发展	6,188,760	137,448,027.60	3.06

4.7.4 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
6	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
7	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
8	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
9	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	
10	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63	

4.7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
6	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
7	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
8	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
9	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
10	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.7 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权证投资明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.8 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.9 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.10 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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.11 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明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.12 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.13 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.14 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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.15 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明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.16 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.17 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.18 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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
3	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
4	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
5	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63

4.7.19 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明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	99.63
2	160018	国债逆回购	1,238,547,247.24	