

2017年9月30日  
基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：2017年10月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会、监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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人对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。

本报告期为 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 华宝兴业制造股票

基金代码 000666

交易场所 深交所

基金管理人 华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

基金合同生效日 2014年12月10日

报告期末基金份额总额 486,163,684.65份

投资目标 把握制造业投资机会，控制投资组合在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期资本增值。

投资策略 本基金主要投资于国内大类资产配置策略，通过实施宏观研究，综合考虑宏观经济、国家政策调整、货币政策、行业政策以及市场价格等因素，对投资组合的预期收益及风险进行动态的分析和评估，从而确定最佳的资产配置比例。同时，本基金将根据宏观经济形势的变化，适时地结合仓位，通过适时地对股票型基金、固定收益类基金以及对行业龙头企业投资的择优选择，把握行业企业的投资价值，分享行业龙头企业的成长。本基金将通过深入的行业研究，精选具有持续竞争优势的公司，以期获得长期稳定的资本增值。

业绩比较基准 申银万国制造业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票型基金，属于证券投资基金中的股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于债券型基金。

基金管理人 华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 31,370,355.34

2.本期利润 2,652,818.29

3.加权平均基金份额本期利润 0.0051

4.期末基金资产净值 630,448,684.15

5.期末基金份额净值 1.297

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、股利收益、利息收入、赎回费用、申购款利息收入等）扣除相关费用后的余额，本期利润为期末已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述各项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将低于上述数字。

3.2.1 本基金报告期内基金资产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① % 业绩比较基准收益率② % 业绩比较基准收益率③ % ①-③ % ②-③ %

过去三个季度 0.84% 5.26% 0.70% -4.56% 0.14%

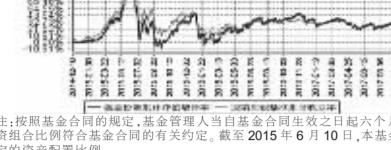
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2014年12月10日至 2017年9月30日)

## 华宝兴业高端制造股票型证券投资基金管理

## 2017年第三季度报告

## 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



本报告期末，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金管理人资金头寸运作分析

进入 7 月，资金宽松的局面继续维持，但市场对成长股的风险依然犹疑较大，同时由于经济指标继续超预期，周期类品种受价格驱动出现大幅上涨，大强小弱的格局明显，但整体来看，资金面相对宽松，使得资金利率整体下行，资金仍保持了整体上的低位。周期股开始反弹，环保股和新能源出现一定程度上涨，超跌的个股也出现资金流入。8 月末金融股强力反弹，带动大盘一举突破了 3300 点，市场恐慌情绪开始缓解。周期股继续大涨，市场人气受到极大打，但在强力维稳的情况下，资金面依然较为宽松，热点开始快速轮转，5G、半导体、食品饮料等有所表现，但整体市场情绪较为谨慎。

在操作方面，本基金 7.8 月份继续降低持股配臵，搭配了部分新材料、工程机械、电子等行业的个股，业绩表现有明显回暖。

4.5 报告期内基金管理人业绩报酬计提情况

截至本报告期末，本基金每份基金份额净值为 0.70%，同期业绩比较基准收益率为 5.26%，基金业绩报酬率为 4.56%。

4.6 报告期内基金管理人有损益或基金额度说明

本报告期末，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五万元的情形。

4.7 在投资运作中所面临的重大风险及控制方法

在投资运作中所面临的重大风险及控制方法，详见本报告“风险揭示”部分。

4.8 公平交易专项说明

4.8.1 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会议规则，公司股票库管理制度，中央交易室制度，防火墙制度，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机制，确保所管理的所有投资组合在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节均得到公平对待。同时，基金管理人严格按照法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，对旗下所有投资组合之间的整体买卖差额、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差价，分析结果未发现异常情况。

4.8.2 公平交易行为的专题说明

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9 报告期内基金管理人公平交易制度的执行情况

4.9.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人遵守《证券投资基金法》及其各项实施细则、《中华人民共和国证券投资基金销售行为规范导则》及其实施细则的规定，公平对待所有投资人，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.9.2 公平交易执行结果

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.3 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.4 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.5 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.6 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.7 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.8 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.9 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.10 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.11 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.12 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.13 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.14 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.15 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.16 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.17 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.18 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.19 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.20 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.21 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.22 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.23 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.24 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.25 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.26 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.27 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.28 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.29 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.30 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.31 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.32 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.33 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.34 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.35 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.36 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.9.37 公平交易制度的执行情况

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双边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4