

华宝高端装备股票型发起式证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华宝高端装备股票发起式 |
| 基金主代码 | 016113 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 8 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 20,784,680.03 份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于高端装备相关上市公司，在控制风险的前提下，力争实现资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。 本基金旨在中国经济结构调整和装备制造业升级的过程中寻找具有核心竞争力的高端装备业的公司进行投资。本基金界定的高端装备产业包括高端装备产业全产业链，应当具有高成长性、高盈利性和高壁垒性的基本 |

| | | |
|-----------------|--|-------------------|
| | 特征。具体地说，根据国家高端装备制造业产业发展规划的界定，本基金投资的高端装备制造行业囊括航空航天装备工业、卫星产业、轨道交通设备制造业、海洋工程装备制造业、信息电子设备工业，同时涉及其产业链的上下游。 | |
| 业绩比较基准 | 中证高端装备细分 50 指数收益率×80% + 中证港股通综合指数收益率(经汇率调整)×10% + 人民币活期存款税后利率×10% | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的股票型基金，其长期平均预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金以及货币市场基金。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，还可能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。 | |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华宝高端装备股票发起式 A | 华宝高端装备股票发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016113 | 016114 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 14, 797, 695. 63 份 | 5, 986, 984. 40 份 |

§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） | |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
| | 华宝高端装备股票发起式 A | 华宝高端装备股票发起式 C |
| 1. 本期已实现收益 | -66, 069. 75 | -28, 155. 95 |
| 2. 本期利润 | 1, 184, 568. 92 | 481, 095. 73 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0818 | 0. 0865 |
| 4. 期末基金资产净值 | 10, 768, 682. 11 | 4, 329, 367. 90 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0. 7277 | 0. 7231 |

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

华宝高端装备股票发起式 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 | 12.37% | 2.00% | 12.84% | 1.74% | -0.47% | 0.26% |
| 过去六个月 | 12.70% | 1.82% | 11.18% | 1.57% | 1.52% | 0.25% |
| 过去一年 | -7.25% | 1.82% | -2.69% | 1.59% | -4.56% | 0.23% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -27.23% | 1.51% | -18.40% | 1.34% | -8.83% | 0.17% |

华宝高端装备股票发起式 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 | 12.28% | 2.00% | 12.84% | 1.74% | -0.56% | 0.26% |
| 过去六个月 | 12.53% | 1.82% | 11.18% | 1.57% | 1.35% | 0.25% |
| 过去一年 | -7.53% | 1.82% | -2.69% | 1.59% | -4.84% | 0.23% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -27.69% | 1.51% | -18.40% | 1.34% | -9.29% | 0.17% |

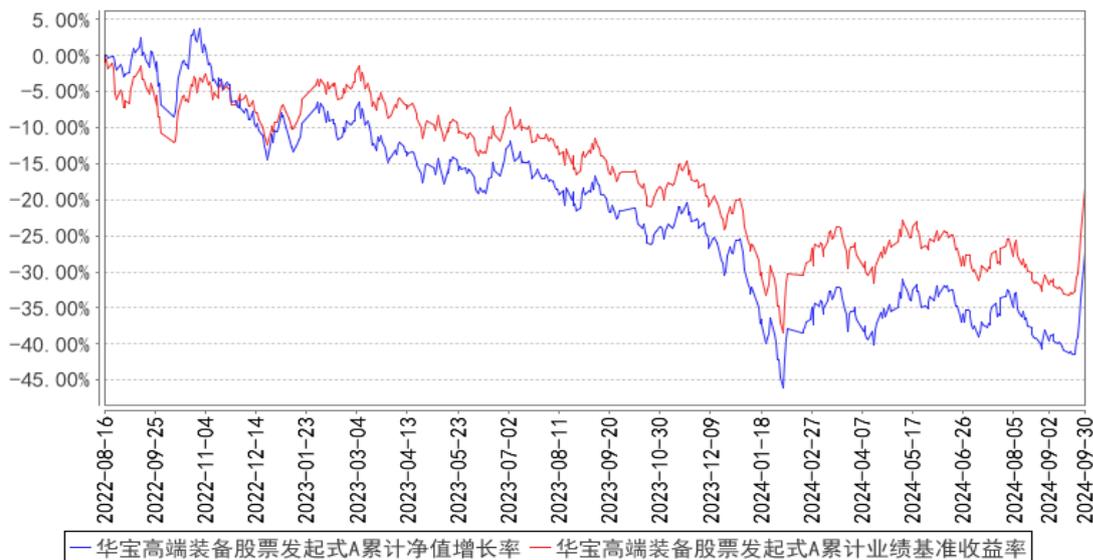
注：(1) 基金业绩基准：中证高端装备细分 50 指数收益率×80% + 中证港股通综合指数收益率

(经汇率调整) × 10% + 人民币活期存款税后利率 × 10%;

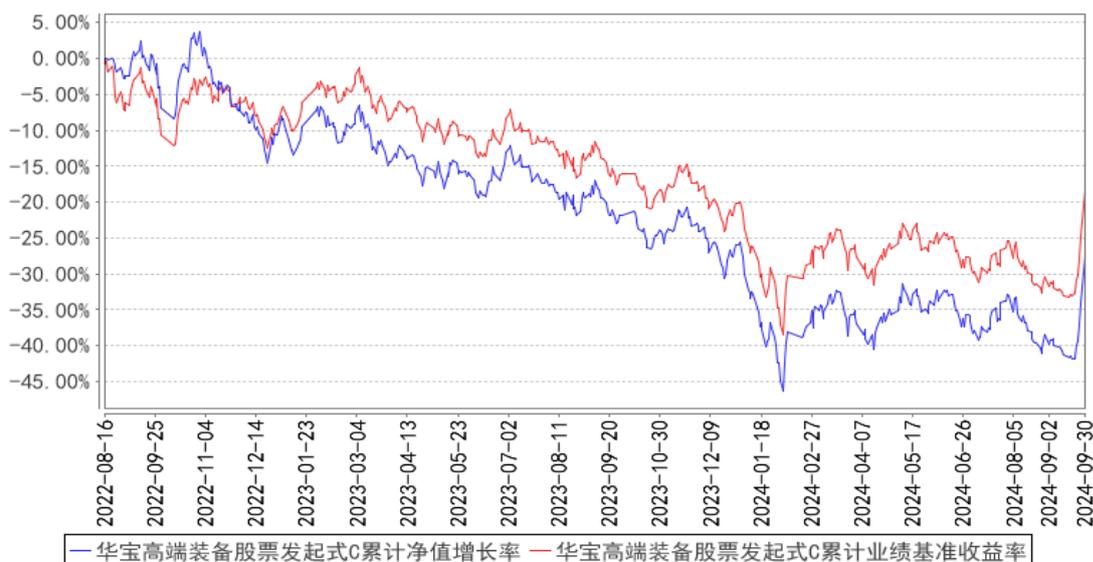
(2) 净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的, 包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

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率变动的比较

华宝高端装备股票发起式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



华宝高端装备股票发起式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 02 月 16 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 | | |
| 庄皓亮 | 本基金基金经理 | 2023-11-14 | - | 11 年 | 硕士。曾在长江证券、华夏基金从事证券研究、投资管理工作，2021 年 1 月加入华宝基金管理有限公司。2021 年 3 月至 2022 年 8 月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2024 年 7 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2023 年 8 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，2021 年 12 月起任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2023 年 11 月起任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理。 |

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、《华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金合同》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

资产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

2024 年三季度的国际宏观焦点主要集中在两方面：一方面中东局势在三季度持续发酵并呈现升级态势，这使得全球风险偏好有所降低，且后续存在进一步发酵可能。而另一方面则是美联储降息正式靴子落地，在 9 月份进行了 50bp 的降息。由于之前预期管理比较充分，对于全球资本市场冲击不大。整个 3 季度美股保持了震荡态势，大宗商品方面黄金保持强势，三季度依然上涨超过 10%，而代表全球总需求的原油则大幅度走低，预示着一定经济衰退的风险。国内市场表现则可以用平地起惊雷来形容，在 9 月底各部门联合出面并表态将发布一揽子政策用于刺激经济，这反映在 A 股则是市场在 9 月最后几个交易日呈现了快速的拉升，而这种短期的暴涨也通过互联网达到了“出圈”的效果，使得 A 股成为最近热度最高的全民讨论话题。本轮 A 股的上涨和放量之快也创造了历史记录，因此后续的市场波动加剧也是大概率事件。

国内 A 股市场整个季度呈现前期阴跌后期巨量上涨态势，市场波动率在季末急速攀升。截至季末，上证指数上涨 12.44%，沪深 300 指数上涨 16.07%，中证 500 指数上涨 16.19%，创业板指上涨 29.21%，中证 2000 指数上涨 17.67%。从风格上说，9 月下旬前风格较为均衡，但最后几个交易日小盘和成长风格异军突起。从行业维度上说，非银、半导体、计算机等涨幅居前，而银行、建筑、有色等板块涨幅靠后。市场在三季度大部分时间内因缺乏信心缩量下跌，但在 9 月底政策预期发力后迅速修复了前期的风险偏好折价，使得反转因子在最后一周左右的时间大幅度跑赢市场。

伴随三季度经济数据的压力，中央层面在 9 月末释放了加大幅度刺激经济的明确信号，这次的转向很大程度扭转了之前的悲观预期，使得市场风险偏好得到快速的修复，市场成交量冲击三万亿以上。季度末的市场的躁动会使得四季度初的波动率居高不下，也会使得短期操作较为困难。但这次的政策表态无疑给市场打了一剂强心针，相信后续在政策逐步落地和起效后，经济层面的

困难能得到较大幅度的改善，从而开始新一轮更有持续性的行情，我们对后续行情的展开保持乐观。

高端装备基金关注符合高端装备投资方向的各行业优质标的，注重对个股基本面质地的考察，甄选估值合理、经营稳健、成长能力良好、财务指标健康、有核心竞争力的优质公司。基金注重稳健投资组合的构建，力求获取长期超额回报。

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 12.37%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 12.28%；同期业绩比较基准收益率为 12.84%。

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 | 14,232,226.10 | 93.21 |
| | 其中：股票 | 14,232,226.10 | 93.21 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 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 | 820,944.72 | 5.38 |
| 8 | 其他资产 | 215,351.97 | 1.41 |
| 9 | 合计 | 15,268,522.79 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 14,118,684.84 | 93.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 113,541.26 | 0.75 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 14,232,226.10 | 94.27 |

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

| 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 | 600893 | 航发动力 | 30,100 | 1,242,829.00 | 8.23 |
| 2 | 600760 | 中航沈飞 | 24,600 | 1,149,066.00 | 7.61 |
| 3 | 002179 | 中航光电 | 23,920 | 1,041,476.80 | 6.90 |
| 4 | 000768 | 中航西飞 | 31,300 | 863,880.00 | 5.72 |
| 5 | 600372 | 中航机载 | 43,600 | 565,056.00 | 3.74 |
| 6 | 300395 | 菲利华 | 11,500 | 493,695.00 | 3.27 |
| 7 | 688122 | 西部超导 | 10,627 | 493,305.34 | 3.27 |
| 8 | 600765 | 中航重机 | 22,900 | 463,267.00 | 3.07 |
| 9 | 300699 | 光威复材 | 12,788 | 420,980.96 | 2.79 |
| 10 | 002465 | 海格通信 | 39,500 | 419,490.00 | 2.78 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

华宝高端装备股票发起式截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,西部超导材料科技股份有限公司因违反承诺履行事项;于 2024 年 08 月 23 日收到上海证券交易所警示的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 586.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 214,764.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 215,351.97 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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 | 华宝高端装备股票发起式 A | 华宝高端装备股票发起式 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 14,352,973.94 | 5,458,682.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,155,634.07 | 1,514,623.37 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 710,912.38 | 986,320.98 |
| 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 | 14,797,695.63 | 5,986,984.40 |

§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 | 华宝高端装备股票发起式 A | 华宝高端装备股票发起式 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(%) | 66.90 | 1.67 |

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 | 48.11 | 10,000,000.00 | 48.11 | 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 | 48.11 | 10,000,000.00 | 48.11 | - |

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自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 8 月 12 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|--|----------------|--------------------------|---------------|------|------------|---------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| 机构 | 1 | 20240701~20240930 | 10,000,000.00 | - | - | 10,000,000.00 | 48.11 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。 | | | | | | | |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 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；
 华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金合同；
 华宝高端装备股票型发起式证券投资基金招募说明书；
 华宝高端装备股票型发起式证券投资基金托管协议；
 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