华宝生态中国混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝生态中国混合
基金主代码	000612
交易代码	000612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月13日
报告期末基金份额总额	369,315,194.36份
投资目标	把握生态主题相关行业和上市公司的稳步成长,力争实现基金资产的长期稳健增值。
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;本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对生态主题相关行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享我国生态文明建设所带来的投资机会;本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合;在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	华宝基金管理有限公司
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-72,677,929.92
2.本期利润	-80,236,835.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2159
4.期末基金资产净值	589,936,910.40
5.期末基金份额净值	1.597

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

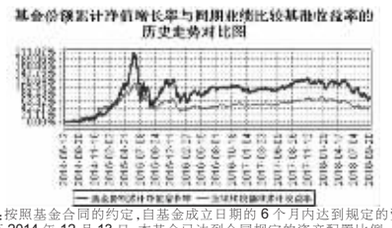
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	-11.91%	1.63%	-2.58%	1.06%	-9.33%	0.57%

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



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2014年12月13日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.3 其他指标

无。

§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		
夏林锋	本基金基金经理华宝大家主导混合、华宝绿色主题混合基金经理	2015年2月17日	-	8年	硕士,曾在上海高压电器研究所从事研究工作,2010年7月加入华宝基金管理有限公司,曾任分析师,2012年10月至2014年10月担任华宝大盘精选混合型证券投资基金基金经理助理,2014年10月至2016年8月担任华宝大盘精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝生态中国混合型证券投资基金基金经理,2015年6月至2017年3月兼任华宝睿价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年11月起兼任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年9月任华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理。
区伟良	本基金基金经理	2015年4月9日	2018年7月2日	8年	硕士,2010年4月加入华宝基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理的职务。2015年4月至2018年7月任华宝生态中国混合型证券投资基金基金经理,2015年12月至2018年7月兼任华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年9月至2017年10月兼任华宝创新优选混合型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

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、《华宝生态中国混合型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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度,市场持续震荡下行。政策方面,全年维持积极的财政政策和稳健中性的货币政策,同时强调六稳——稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期;流动性方面,资管新规落地略好于市场悲观预期,期限较宽、摊余成本计量适用范围较广, 同时金融去杠杆的节奏略有放缓; 经济形势方面,前期韧性较强,但"金九银十"表现较为一般,不过市场预期也不算太高;海外市场方面,美元持续加息,同时中美贸易战愈演愈烈,油价持续高位,叠加人民币贬值预期,对市场产生了较大冲击。

在上述背景下,3季度持续震荡下行。本基金在3季度维持中性仓位,并持续进行结构优化,持续挖掘中长期看好的成长股,并更加重视成长性与估值的匹配。

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-11.91%,同期业绩比较基准收益率为-2.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	540,676,556.98	90.91
	其中:股票	540,676,556.98	90.91
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	53,686,196.92	9.03
8	其他资产	377,305.03	0.06
9	合计	594,740,058.93	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	11,875,566.08	2.01
B	采矿业	1,195,201.80	0.20
C	制造业	419,538,525.68	71.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,472,683.60	1.94
F	批发和零售业	1,158,665.60	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	25,085,004.44	4.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,567,596.00	2.13
J	金融业	7,351,699.75	1.25
K	房地产业	3,029,344.40	0.51
L	租赁和商务服务业	34,853,301.60	5.91
M	科学研究和技术服务业	8,143,344.52	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	592,882.96	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,812,740.55	0.65
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	540,676,556.98	91.65

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 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	002202	金风科技	3,819,420	45,871,234.20	7.78
2	002384	东山精密	3,567,820	43,705,795.00	7.41
3	000858	五粮液	525,000	35,673,750.00	6.05
4	002456	欧菲科技	2,643,816	35,665,077.84	6.05
5	002127	南极电商	4,761,380	34,853,301.60	5.91
6	300409	道氏技术	1,637,816	26,303,324.96	4.46
7	600271	航天信息	865,200	24,078,516.00	4.08
8	600038	中直股份	473,672	18,880,565.92	3.20
9	000768	中航飞机	1,126,609	17,890,550.92	3.03
10	002463	沪电股份	2,740,994	17,679,411.30	3.00

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2

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	292,018.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,951.14
5	应收申购款	72,335.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	377,305.03

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	373,189,665.22
报告期期间基金总申购份额	5,233,081.83
减:报告期期间基金总赎回份额	9,107,552.69
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	369,315,194.36

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	188,546.53
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	188,546.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.05

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝生态中国混合型证券投资基金基金合同;

华宝生态中国混合型证券投资基金招募说明书;

华宝生态中国混合型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。

9.2 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。

9.3 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

2018年10月26日

华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年10月25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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝稳健回报混合
基金主代码	000993
交易代码	000993
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月27日
报告期末基金份额总额	427,577,301.05份
投资目标	本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 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。 2.股票投资策略 本基金采取积极的股票选择策略,将"自上而下"的行业配置策略和"自下而上"的股票精选策略相结合,根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断,进行投资组合的动态优化,实现基金资产长期稳定增值。 3.固定收益类投资工具投资策略 本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益率投资工具,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。 5.股指期货投资策略 本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险及转移错误下的流动性风险,以达到降低投资组合整体风险的目的。 6.其他金融工具投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人可根据法律法规及监管机构的规定及本基金的投资目标,制定与本基金相适应的投资策略,比例限制,信息披露方式等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-29,655,431.41
2.本期利润	-46,781,853.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0981
4.期末基金资产净值	334,382,477.04
5.期末基金份额净值	0.782

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

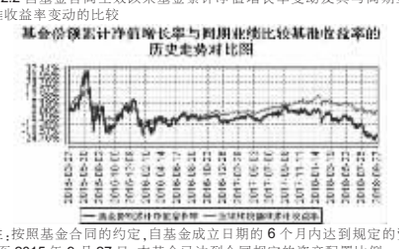
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	-10.73%	1.41%	-0.59%	0.75%	-10.14%	0.66%

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



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2015年9月27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		
同旭	投资总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝行业精选混合、华宝收益增长混合、华宝稳健回报混合基金经理	2015年3月27日	-	18年	硕士,曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作,2004年10月至2010年7月任职于华宝基金管理有限公司,先后任基金经理助理、基金经理的职务。2010年7月至2014年2月任恒银金融(天津)有限公司投资总监兼基金经理,2014年3月加入华宝基金管理有限公司,2015年3月起任国内投资部总经理,2014年7月起任华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理,2015年3月兼任华宝稳健回报混合型证券投资基金基金经理,2017年5月至2018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。2017年5月任投资总监。

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

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、《华宝稳健回报灵活配置混合型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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年前三季度市场在一月份短暂冲高后,便呈现了逐级震荡的下跌走势。各行业指数都呈现负收益,其中石油石化、银行、餐饮旅游、食品饮料、医药、等行业下跌幅度相对较小,而电子、传媒、通信、电力设备、有色等行业跌幅较大。

一方面经济增速放缓的压力,叠加贸易摩擦冲击,对企业盈利产生不确定性,从而带来估值的压力。另一方面,去杠杆也带来资金的压力,使得市场的风险偏好急剧下降。而A股市场的相对高估值与国际市场估值体系的接轨带来了市场估值的整体大幅下调。对于盈利具有不确定性、负债率高、质押比例高、现金流较差、解禁比例大的公司股票被持续抛售。本基金前三季度保持了医药、消费等行业的超配,降低了部分资金压力较大的建筑行业的权重,增加了计算机行业的配置权重, 但本基金在市场持续低迷的情况下也承受了估值下调的压力。

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-10.73%,同期业绩比较基准收益率为-0.59%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	272,787,878.63	80.75
	其中:股票	272,787,878.63	80.75
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	59,315,432.16	17.56
8	其他资产	5,715,777.67	1.69
9	合计	337,819,088.46	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	3,354,944.00	1.00
C	制造业	144,777,231.80	43.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,485,163.00	1.94
F	批发和零售业	12,332,970.80	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	6,782,058.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,097,762.41	9.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,526,090.00	1.65
L	租赁和商务服务业	49,978,333.62	14.95
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	12,453,325.00	3.72
S	综合	-	-
	合计	272,787,878.63	81.58

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 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	601888	中国国旅	365,500	24,861,310.00	7.43
2	000333	美的集团	438,904	18,464,691.28	5.52
3	002065	东华软件	1,844,648	16,601,832.00	4.96
4	601828	美凯龙	1,116,111	14,978,209.62	4.48
5	600315	上海家化	466,438	13,759,921.00	4.12
6	000858	五粮液	191,000	12,978,450.00	3.88
7	000860	顺鑫农业	274,700	12,526,320.00	3.75
8	000538	云南白药	177,800	12,486,894.00	3.73
9	300144	宋城演艺	559,700	12,453,325.00	3.72
10	002027	分众传媒	1,191,400	10,138,814.00	3.03

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2

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	159,766.83
2	应收证券清算款	5,495,367.88
3	应收股利	-
4	应收利息	13,704.73
5	应收申购款	46,938.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,715,777.67

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	18,464,691.28	5.52	重大事项停牌
2	000538	云南白药	12,486,894.00	3.73	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	486,448,682.18
报告期期间基金总申购份额	2,178,951.39
减:报告期期间基金总赎回份额	61,050,332.52
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	427,577,301.05

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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

报告期期初基金份额总额	1,343,890.78
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,343,890.78
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.31

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同;

华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;

华宝稳健回报灵活配置混合型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。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

9.3 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

2018年10月26日

华宝行业精选混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝行业精选混合
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14日
报告期末基金份额总额	1,607,865,978.41份
投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与趋势三力分析,加强对有限引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	华宝基金管理有限公司
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-153,357,065.18
2.本期利润	-233,292,742.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1445
4.期末基金资产净值	1,859,543,191.14
5.期末基金份额净值	1.1565

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

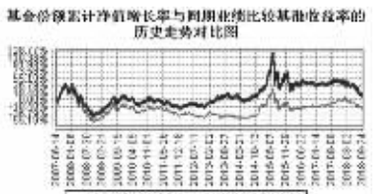
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	-11.09%	1.38%	-2.05%	1.36%	-9.04%	0.02%

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



注:按照基金合同的约定,自