

华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

国证券投资基金) 及其各项实施规则;《华宝第三产业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、监管部门的有关规定,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 额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市场的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,华宝第三 产业灵活配置混合型证券投资基金在报告期内出现过基金资产总值占基金资产净 值超过140%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有 给投资者带来额外风险或损失。

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、防火墙制度、系统中的公平交易程序、每日交易日 终结报告、定期基金投资绩效评价体系机制,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控制度要求,分 析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益差异,分投资类别(股票、债券) 的收益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公开竞价时间日反 向交易成交较多的单边交易且其超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年四季度面内的内外环境仍较为复杂,全球经济增长势头趋弱,各资产 波动率明显抬升,而国内在内外需疲弱的背景下,宏观经济亦出现较明显的下行 迹象。政策层面,逆周期调控不进一步加强,积极的货币政策、基建补短板、减税降费等 各项措施持续发力。报告期内A股估值水平进入历史低位,期间随着股权质押风 险化解、支持民营、小微企业的政策出台,市场风险偏好有所提升,但整体呈现宽 幅震荡状态。本报告期末蓝筹为代表的沪深300和沪深100指数分别下跌12.46% 和12.50%,成长股为代表的创业板指和中证500指数也分别下跌11.39%和 13.18%。

截至本报告期末本基金公允价值为0.0819元;本报告期基金份额净值增长率 为-0.32%,业绩比较基准收益率为-6.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金基金合同生效于2017年5月25日,本基金自2018年8月17日起,截止本 报告期末,已连续超过二十个工作日基金资产净值低于5000万元。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	34,063,330.46	79.73
1.1	其中:股票	34,063,330.46	79.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,172,008.01	20.27
8	其他资产	20,520.49	0.05
9	合计	43,255,858.96	100.00

注:由于四舍五入的原因,合计数可能不等于分项之和。

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

序号	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	采矿业	911,083.00	0.13
C	制造业	91,167,973.23	37.08
D	电力、热力、燃气及生产供应业	1,027,096.00	0.01
E	建筑业	1,522,128.02	0.02
F	批发和零售业	688,628.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,079,201.80	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	966,307.83	0.02
J	金融业	4,934,979.00	0.11
K	房地产业	5,547,088.00	0.06
L	租赁和商务服务业	427,386.00	0.01
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	建筑业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	545,113.00	0.01
9	合计	34,063,330.46	79.73

本基金和所有份额持有人均于10月10日,以货币政策等有所调整,金融监管政策比前月和前时期有所宽松,市场逐步企稳。

本基金组合中基金持仓不变,持仓中科技股占比较高,继续持有医疗医药及器械类个股,新能源等前期明确的成长性板块,特设进一步集中到少数优质个股公司。

4.5 报告期内基金的投资业绩表现

截至本报告期末本基金资产净值值为1.376亿元;本报告期基金份额净值增值率-13.73%,业绩比较基准收益率为-7.80%。

4.6 报告期内基金持有人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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	34,063,330.46	79.73
1.1	其中:股票	34,063,330.46	79.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,172,008.01	20.27
8	其他资产	20,520.49	0.05
9	合计	43,255,858.96	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
3.2	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	220,629,709.06	25.26
8	其他资产	9,120,025.18	1.04
9	合计	874,539,084.01	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	644,581,349.76	72.71
1.1	其中:股票	644,581,349.76	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-