华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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2017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	华宝大盘精选混合
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月7日
报告期末基金份额总额	54,446,732.58份
投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景,注重价值挖掘,通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股,通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识,调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大至小排名在前1/3的股票。
业绩比较基准	沪深300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	华宝兴业基金管理有限公司
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（2017年7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	6,959,539.04
2.本期利润	5,503,019.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0992
4.期末基金资产净值	98,100,190.05
5.期末基金份额净值	1.8018

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。

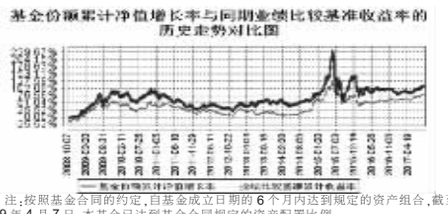
3.2 基金净值表现

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	5.85%	0.76%	3.74%	0.47%	2.11%	0.29%

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

(2008年10月7日至2017年9月30日)



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2009年4月7日,本基金已达到基金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		
夏林锋	本基金基金经理、华宝生态中国混合、华宝未来主导混合基金经理	2014年10月22日	-	7年	硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任分析师,2012年10月至2014年10月担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理助理,2014年10月起担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝兴业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月兼任华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年11月起兼任华宝兴业未来主导产业灵活配置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、《华宝兴业大盘精选股票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

2017年3季度,市场震荡上行。政策方面,整体定调仍是稳字当头,坚持积极的财政政策和稳健中性的货币政策，不过市场预期有所修正,5月中旬市场预期极低之时的监管表态存在“稳”的基调,流动性方面,金融去杠杆持续推进,但预期最为悲观的阶段已经过去,推动市场偏好有所提升。经济形势方面,行业景气延续2016年以来的较好态势,基建、地产均表现出较强韧性,整体呈现淡季不淡、旺季略旺的态势,但市场对高景气的持续性一直存有担忧,叠加取暖季限产推进,整体预期波动较大。海外市场方面,美元加息预期兑现,美元支持维持低位,新兴市场压力有所减缓,同时油价较为平稳,资源输入性压力不是太大。

在上述背景下,3季度市场呈现震荡下行态势,同时市场风格趋于平稳。本基金在3季度维持中性略高仓位,并持续进行结构调整、优化,持续重视大盘价值与大盘成长之间的轮换。

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5.85%,同期业绩比较基准收益率为3.74%,基金表现领先比较基准2.11%。

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者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	82,425,404.84	80.36
	其中:股票	82,425,404.84	80.36
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	16,793,784.19	16.37
8	其他资产	3,351,065.46	3.27
9	合计	102,570,254.49	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	-	-
C	制造业	46,237,999.54	47.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,859,481.56	6.99
F	批发和零售业	1,954,060.70	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	976,540.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,385,432.10	4.47
J	金融业	17,208,750.19	17.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	591,277.27	0.60
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	4,211,863.48	4.29
S	综合	-	-
	合计	82,425,404.84	84.02

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	601318	中国平安	94,302	5,107,396.32	5.21
2	601628	中国人寿	168,756	4,681,291.44	4.77
3	000858	五粮液	70,976	4,065,505.28	4.14
4	000568	泸州老窖	71,000	3,983,100.00	4.06
5	002665	首航节能	472,638	3,908,716.26	3.98
6	000001	平安银行	351,247	3,902,354.17	3.98
7	002304	洋河股份	30,100	3,055,150.00	3.11
8	300197	铁汉生态	222,300	3,009,942.00	3.07
9	002273	水晶光电	113,654	2,902,723.16	2.96
10	002624	完美世界	88,298	2,892,642.48	2.95

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。

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。

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

大盘精选基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的平安银行(000001)于2016年12月2日收到中国银行间市场交易商协会的通报批评和整改通知,因其作为主承销商,对青岛海湾集团有限公司未按规照相关自律规则的规定及时披露公司重大资产无偿划转相关事项,未能及时召开持有人会议,给予平安银行通报批评处分,责令平安银行立即纠正违规行为,并针对本次事件中暴露出的问题进行整改。

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股票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九名证券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	50,322.92
2	应收证券清算款	3,274,028.39
3	应收股利	-
4	应收利息	3,409.86
5	应收申购款	23,304.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,351,065.46

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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	56,356,657.64
报告期期间基金总申购份额	2,166,028.07
减:报告期期间基金总赎回份额	4,075,953.13
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	54,446,732.58

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	134,626.57
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	134,626.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.25

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

1. 基金管理人于2017年8月9日发布公告,华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“公司”)原外方股东领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)将所持有的公司49%的股权转让给Warburg Pincus Asset Management, L.P.的事项日前已经分别获得中国证监会核准和中华人民共和国商务部批准。变更后公司的股权结构为:华宝信托有限责任公司持股51%,Warburg Pincus Asset Management, L.P.持股49%。公司股东会已就上述股权转让等事宜对公司章程进行了相应修订,9月12日,Warburg Pincus Asset Management, L.P.完成了收购Lyxor Asset Management S.A.持有的华宝兴业基金公司49%的股份的交割。

2. 基金管理人于2017年10月20日发布公告,2017年10月17日,公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续,公司法定名称由“华宝兴业基金管理有限公司”变更为“华宝基金管理有限公司”。

3. 基金管理人于2017年9月29日发布公告,常务副总经理Alexandre Werno先生自2017年9月29日起不再担任常务副总经理的职务。

4. 基金管理人于2017年9月29日发布公告,聘请欧江洪先生担任公司副总经理。

§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;
华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业大盘精选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。

华宝兴业基金管理有限公司
2017年10月25日

华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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2017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	华宝核心优势混合
基金主代码	002152
交易代码	002152
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月21日
报告期末基金份额总额	99,820,783.78份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过深入研究并积极投资具备核心优势的优质上市公司,分享其发展和成长的机会,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,根据对宏观经济、中观行业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类投资工具,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。 6.资产支持证券投资策略 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 7.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，基金管理人将根据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

3.1 主要财务指标

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	4,016,495.69
2.本期利润	3,837,377.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0318
4.期末基金资产净值	110,497,747.29
5.期末基金份额净值	1.107

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	3.46%	0.66%	2.63%	0.33%	0.83%	0.33%

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

(2016年1月21日至2017年9月30日)

注:按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六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2016年7月21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		
胡戈游	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业制造股票、华宝国策导向混合、华宝未来主导混合基金经理	2016年1月21日	-	12年	硕士,拥有CFA资格。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师、国内投资部基金经理助理的职务,2009年5月至2010年6月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年1月至2012年1月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。2011年2月起任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理,2013年7月至2015年12月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2015年1月兼任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。2015年3月起任助理投资总监。2016年1月兼任华宝兴业核心优势灵活配置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、《华宝兴业核心优势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

三季度市场表现较好,周期股、消费股都有所表现。本基金仓位变化不大,主要增持旅游、传媒、新能源汽车等景气度高且估值较合理的板块,积极参与了有色、钢铁等周期股的反弹,这些板块表现较好,对净值有较大正贡献。另外,基金增持了银行保险等大市值股票,后期同样看好低估值蓝筹股。

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3.46%,同期业绩比较基准收益率为2.63%,基金表现领先业绩比较基准0.83%。

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	86,881,373.03	77.66
	其中:股票	86,881,373.03	77.66
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	24,904,204.97	22.26
8	其他资产	94,025.05	0.08
9	合计	111,879,603.05	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	-	-
C	制造业	33,649,592.15	30.45
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	8,752,200.00	7.92
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,657,500.00	6.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,543,170.00	6.83
J	金融业	8,642,300.00	7.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,594,200.00	5.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,023,100.88	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,760,000.00	1.59
Q	卫生和社会工作	1,791,300.00	1.62
R	文化、体育和娱乐业	10,468,010.00	9.47
S	综合	-	-
	合计	86,881,373.03	78.63

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	002624	完美世界	150,000	4,914,000.00	4.45
2	002665	首航节能	550,000	4,548,500.00	4.12
3	601888	中国国旅	130,000	4,483,700.00	4.06
4	600258	首旅酒店	150,000	4,459,500.00	4.04
5	601328	交通银行	700,000	4,424,000.00	4.00
6	300309	吉艾科技	180,000	4,410,000.00	3.99
7	600741	华域汽车	170,993	3,855,892.15	3.49
8	300426	唐德影视	130,900	3,652,110.00	3.31
9	002343	慈文传媒	90,000	3,483,900.00	3.15
10	601628	中国人寿	100,000	2,774,000.00	2.51

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

核心优势灵活配置基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的慈文传媒(002343)于2016年12月19日收到浙江证监局整改通知。因公司未披露合并范围内控股子公司的重大经营合同，责令慈文传媒股份有限公司立即披露上述重大经营合同,加强相关法律法规学习,做好信息披露工作。

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股票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九名证券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	75,196.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,877.90
5	应收申购款	13,950.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,025.05

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	141,241,009.50
报告期期间基金总申购份额	1,649,481.05
减:报告期期间基金总赎回份额	43,069,706.77
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	99,820,783.78

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	197,628.46
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	197,628.46
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

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

1.基金管理人于2017年8月9日发布公告,华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“公司”)原外方股东领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)将所持有的公司49%的股权转让给Warburg Pincus Asset Management, L.P.的事项日前已经分别获得中国证监会核准和中华人民共和国商务部批准。变更后公司的股权结构为:华宝信托有限责任公司持股51%,Warburg Pincus Asset Management, L.P.持股49%。公司股东会已就上述股权转让等事宜对公司章程进行了相应修订,9月12日,Warburg Pincus Asset Management, L.P.完成了收购Lyxor Asset Management S.A.持有的华宝兴业基金公司49%的股份的交割。公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜。

2.基金管理人于2017年10月20日发布公告,2017年10月17日,公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续,公司法定名称由“华宝兴业基金管理有限公司”变更为“华宝基金管理有限公司”。

3.基金管理人于2017年9月29日发布公告,常务副总经理Alexandre Werno先生自2017年9月29日起不再担任常务副总经理的职务。

4.基金管理人于2017年9月29日发布公告,聘请欧江洪先生担任公司副总经理。

§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;
华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业核心优势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。

华宝兴业基金管理有限公司
2017年10月25日

华宝兴业动力组合混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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2017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	华宝动力组合混合
基金主代码	240004
交易代码	240004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年11月17日
报告期末基金份额总额	992,562,568.44份
投资目标	通过对基金组合的动态优化管理,使基金收益持续稳定超越比较基准,并追求单位风险所获得的超额收益最大化。
投资策略	本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势,调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例,自下而上精选个股,获取超额收益。
业绩比较基准	80%上证180指数收益率与深证100指数收益率的流通市值加权平均×20%上证国债指数收益率。
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	华宝兴业基金管理有限公司
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（2017年7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	6,959,539.04
2.本期利润	5,503,019.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0992
4.期末基金资产净值	98,100,190.05
5.期末基金份额净值	1.8018

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