华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

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

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝油气
场内简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年9月29日
报告期末基金份额总额	6,224,373,493.26份
投资目标	通过严格的指数化投资策略,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过5%(以美元资产计价)。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
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
境外投资顾问	英文名称:-
	中文名称:-
境外资产托管人	英文名称:The Bank of New York Mellon Corporation
	中文名称:纽约梅隆银行

注:
1.本基金另设美元份额,基金代码001481,与人民币份额并表披露。
2.截止本报告期末,本基金人民币份额净值0.495元,人民币总份额6,624,437,240.94份;本基金美元份额净值0.0762美元,美元总份额2,384,927.19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(2017年7月1日－2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,370,268.72
2.本期利润	205,064,802.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0324
4.期末基金资产净值	3,517,703,835.87
5.期末基金份额净值	0.565

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。

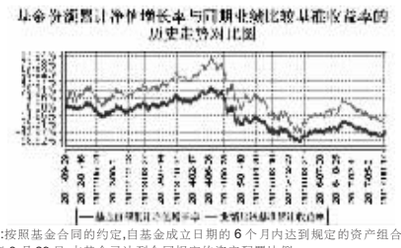
3.2 基金净值表现

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	4.44%	1.45%	5.03%	1.52%	-0.59%	-0.07%

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

(2011年9月29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2012年3月29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		
周晶	国际业务部总经理,本基金基金经理,美国消费,华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数(LOF),华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数(场内简称"香港大盘")基金经理	2014年9月18日	-	11年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、达太平洋证券(美国)和汇丰证券(美国)从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005年至2007年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管。2011年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼百席策略分析师,现任国际业务部总经理。2013年6月至2015年11月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理,2014年9月起兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2015年9月至2017年8月任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理,2016年3月任华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2016年6月兼任华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金经理,2017年4月任华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理(香港)有限公司董事

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)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,分析了本基金与公司旗下所有其他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业绩表现说明

本基金采用全复制方法跟踪标普石油天然气上游股票指数,在报告期内按照这一原则比较好的实现了基金跟踪指数表现的目的。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

17年三季度全球油价震荡上行。截止9月30日,WTI油价收至51.64美元一桶,相对今年二季度末上涨11.5%。油价的上涨牵连跟踪石油上游股票的基金标的指数走强。整个三季度,本基金跟踪的标普石油天然气上游股票指数上涨7.2%,上涨幅度略低于国际油价涨幅,主要还是因为标的指数中的公司业绩不达预期的拖累。三季度标普油气指数年化日均波幅24.1%,超过标500指数日均波幅7.1%的水平。

日常操作过程中,人民币汇率方面,2017年三季度人民币汇率呈现升值走势。三季度人行中间价从6.7744升值至6.6369,相对于美金升值2.0%。同期,人民币交易价也相对于美金升值2.0%左右。汇率三季度整体而言对基金的人民币计价业绩有负面影响。

截止至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为4.44%,同期业绩比较基准收益率为5.03%,基金表现落后业绩比较基准0.59%。

4.5 报告期内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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,357,913,125.50	86.53
	其中:普通股	3,357,913,125.50	86.53
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	23,791,973.26	0.61
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	336,781,279.28	8.68
8	其他资产	162,228,317.57	4.18
9	合计	3,880,714,695.61	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	3,357,913,125.50	95.46
合计	3,357,913,125.50	95.46

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	3,357,913,125.50	95.46
合计	3,357,913,125.50	95.46

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CARRIZO OIL & GAS INC	Carrizo Oil & Gas Inc	CRZO US	纳斯达克	美国	762,810	86,723,942.89	2.47
2	WHITING PETROLEUM CORP	怀汀石油公司	WLL US	纽约	美国	2,170,196	78,642,421.12	2.24
3	SM ENERGY CO	SM能源公司	SM US	纽约	美国	636,421	74,931,321.37	2.13
4	OASIS PETROLEUM INC	Oasis Petroleum Inc	OAS US	纽约	美国	1,222,646	74,004,962.65	2.10
5	PDC ENERGY INC	PDC Energy Inc	PDCE US	纳斯达克	美国	217,727	70,849,934.96	2.01
6	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	MRO US	纽约	美国	767,532	69,075,089.25	1.96
7	NEWFIELD EXPLO-RATION CO	新田石油勘探公司	NFX US	纽约	美国	350,032	68,927,189.39	1.96
8	WPX ENERGY INC	WPX能源公司	WPX US	纽约	美国	902,369	68,872,727.39	1.96
9	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油	APC US	纽约	美国	212,140	68,778,453.54	1.96
10	QEP RESOURCES INC	QEP资源公司	QEP US	纽约	美国	1,203,992	68,480,937.51	1.95

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	23,791,973.26	0.68

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	153,931,428.73
3	应收股利	792,889.14
4	应收利息	38,142.34
5	应收申购款	7,465,857.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	162,228,317.57

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资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。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,688,001,541.05
报告期期间基金总申购份额	1,657,933,405.16
减:报告期期间基金总赎回份额	1,121,561,452.95
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	6,224,373,493.26

§7 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.的事项目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;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金合同;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)招募说明书;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)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

华宝兴业创新优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	华宝创新优选混合
基金主代码	000601
交易代码	000601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月14日
报告期末基金份额总额	140,850,215.44份
投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的企业,在控制风险的前提下为基金持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1)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)本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对拥有持续创新能力的企业相关股票的深入分析,积极挖掘企业的创新溢价,分享其投资机会; (3)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。 (4)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,以提高投资收率,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和股票型基金,高于货币市场基金、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	11,466,688.36
2.本期利润	15,351,681.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.1180
4.期末基金资产净值	147,439,222.34
5.期末基金份额净值	1.047

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。

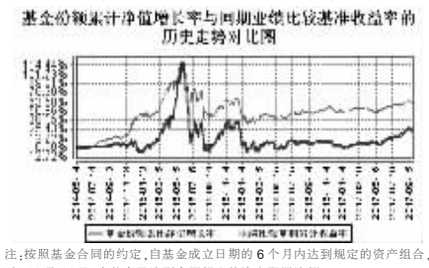
3.2 基金净值表现

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	12.94%	1.01%	4.39%	0.50%	8.55%	0.51%

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5月14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2014年11月14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		
区伟良	本基金基金经理,华宝转型升级混合,华宝生态中国混合基金经理	2016年9月7日	-	7年	硕士。2010年4月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理的职务。2015年4月起任华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金经理助理的职务。2015年4月起任华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金经理,2015年12月兼任华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月起兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月起兼任华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金基金经理。2017年3月兼任华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金和华宝兴业新优选一年定期开放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。
3、基金管理人于2017年10月17日发布公告,本基金的基金经理自2017年10月17日由区伟良变更为代云锋。

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、《华宝兴业创新优选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

2017年三季度宏观经济运行整体稳健,通胀相对温和,市场流动性也比较平稳。随着供给侧改革持续推进,部分周期性行业数据表现良好。同时,人口结构变化以及居民可支配收入的提升也带来三四线城市越来越明显的消费升级。因此,整体来看三季度的A股市场表现不差,具体指数来看,上证指数上涨5.05%,沪深300上涨4.57%;创业板上涨2.95%。从具体子行业来看,周期板块如有色、钢铁、煤炭等在7-8月份表现强劲;消费领域如白酒、家电等有良好表现;新兴产业方面,新能源、消费电子、半导体等都有板块性机会,相关业绩扎实,具备中长期竞争力的优质成长股取得较好的涨幅。

本基金根据市场环境的变化,不断对组合结构进行优化:一方面,继续在新兴产业如消费电子、高端制造、新能源、文化传媒等成长性子行业精选个股;另一方面,也参与了白酒、家电等具备良好景气度板块的投资机会。同时,密切关注市场的整体流动性,对于行业和个股的估值考量也更加重视。

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12.94%,同期业绩比较基准收益率为4.39%,基金表现领先比较基准8.55%。

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	120,818,389.08	79.87
	其中:股票	120,818,389.08	79.87
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	28,577,359.33	18.89
8	其他资产	1,881,778.04	1.24
9	合计	151,277,526.45	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	79,961,940.26	54.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.02
E	建筑业	5,756,740.00	3.90
F	批发和零售业	6,522,393.00	4.42
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	14,213,694.34	9.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,080,695.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	102,300.88	0.07
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	11,149,532.16	7.56
S	综合	-	-
	合计	120,818,389.08	81.94

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	002475	立讯精密	382,265	7,897,594.90	5.36
2	300409	道氏技术	130,910	6,951,321.00	4.71
3	002555	三七互娱	298,543	6,657,508.90	4.52
4	002310	东方园林	274,000	5,756,740.00	3.90
5	002456	欧菲光	263,319	5,579,729.61	3.78
6	300081	恒信东方	342,100	5,073,343.00	3.44
7	000858	五粮液	79,464	4,551,697.92	3.09
8	002343	慈文传媒	115,700	4,478,747.00	3.04
9	600519	贵州茅台	8,108	4,197,025.12	2.85
10	300426	唐德影视	149,100	4,159,890.00	2.82

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 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

可转债基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的海印转债(127003)发行主体海印股份(000861)于2017年8月21日受到深圳证券交易所通报批评。因海印股份迟于规定日期披露可转债付息公告。对公司予以通报批评的处分。

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,340.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	162,434.24
5	应收申购款	5,688.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,464.09

5.10.4 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	127,031,552.47
报告期期间基金总申购份额	27,728,681.46
减:报告期期间基金总赎回份额	13,910,018.49
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	140,850,215.44

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	49,558.43
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	49,558.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.04

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;
华宝兴业创新优选混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业创新优选混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业创新优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

华宝兴业可转债债券型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	华宝兴业可转债债券
基金主代码	240018
交易代码	240018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
报告期末基金份额总额	51,395,372.59份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,主要通过对可转债的投资,力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金采用自上而下的宏观投资策略,通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,在固定收益类资产和权益类资