

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、持有人名册和投资组合报告等信息,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基金的招募说明书。

本报告所载财务数据未经审计。

本基金报告期2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金

基金代码 001118

交易方式 灵活开放式

基金合同生效日 2015/4/8

报告期末基金份额总额 3,754,838,261.89份

投资目标 本基金通过积极配置股票、债券等资产,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的利益。

本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基金的招募说明书。

本报告所载财务数据未经审计。

本基金报告期2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 1,142,465.10

2.本期利润 61,501,318.97

3.期初至报告期基金份额总额 0.0157

4.期末基金份额净值 2,852,292.5588

5.期末基金净值增长率 0.76%

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.本基金基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2.1 本期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 22% 0.74% 32% 0.47% -14% 0.27%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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:1.报告期以定期报告日期为基准日,按报告期每个自然日的收盘价除以报告期每个自然日的开盘价,取其孰低的平均数,计算期间内每日涨跌幅,然后将每日涨跌幅相加,乘以2/3,得出报告期涨跌幅。

2.证券从业从行业又遵从行业分类(证券从业从行业资格管理办法)的相关规定。

3.2.3 本基金净值表现

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 6,051,318.97

2.本期利润 0.0157

3.期初至报告期基金份额总额 2,852,292.5588

4.期末基金份额净值 2,852,292.5588

5.期末基金净值增长率 0.76%

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.本基金基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2.4 本期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 22% 0.74% 32% 0.47% -14% 0.27%

3.2.5 本基金合同生效以来基金份额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:1.报告期以定期报告日期为基准日,按报告期每个自然日的收盘价除以报告期每个自然日的开盘价,取其孰低的平均数,计算期间内每日涨跌幅,然后将每日涨跌幅相加,乘以2/3,得出报告期涨跌幅。

2.证券从业从行业又遵从行业分类(证券从业从行业资格管理办法)的相关规定。

3.2.6 本基金净值表现

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 37,294,308.64

2.本期利润 96,875,024.3

3.期初至报告期基金份额总额 0.4265

4.期末基金份额净值 1,306,384,175.95

5.期末基金净值增长率 6.05%

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.本基金基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2.7 本期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 7.76% 0.77% 16% 0.29% 6.12% 0.48%

3.2.8 本基金合同生效以来基金份额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:2006年6月15日至2017年9月30日

3.2.9 本基金合同生效以来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

历史走势对比如图

# 信息披露

# Disclosure

## 华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

42 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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、《华宝兴业事件驱动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,建立健全的内部控制制度,监督管控制度的健全规定,以诚实信用、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的利益的行为。

43 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会议规则、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,每日交易日结束报告、定期基金投资价值评估评价机制等机制,确保所持有的所有投资组合在授权、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差额,分析投资类别(股票、债券)的收益率差异,并进行适当调整。

44 报告期内基金的业绩表现

本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基金的招募说明书。

本报告所载财务数据未经审计。

本基金报告期2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 5 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、持有人名册和投资组合报告等信息,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基金的招募说明书。

本报告所载财务数据未经审计。

本基金报告期2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 6 基金产品概况

基金简称 华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金

基金代码 001118

交易方式 灵活开放式

基金合同生效日 2015/4/8

报告期末基金份额总额 3,754,838,261.89份

投资目标 本基金通过积极配置股票、债券等资产,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的利益。

本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基金的招募说明书。

本报告所载财务数据未经审计。

本基金报告期2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 7 基金净值表现

7.1 本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

7.2 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

7.3 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

7.4 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

7.5 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

7.6 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

7.7 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

7.8 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

7.9 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

7.10 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

7.11 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

7.12 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

7.13 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

7.14 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

7.15 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

7.16 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

7.17 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

7.18 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

7.19 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

7.20 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

7.21 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

7.22 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

7.23 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

7.24 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

7.25 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

7.26 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

7.27 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

7.28 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

7.29 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

7.30 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

7.31 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

7.32 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

7.33 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

7.34 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

7.35 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

7.36 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

7.37 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

7.38 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