华宝兴业稳健回报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	602,439,305.32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特殊情况下的流动性风险,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	12,970,578.41
2.本期利润	23,654,963.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0368
4.期末基金资产净值	599,351,305.81
5.期末基金份额净值	0.995

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。

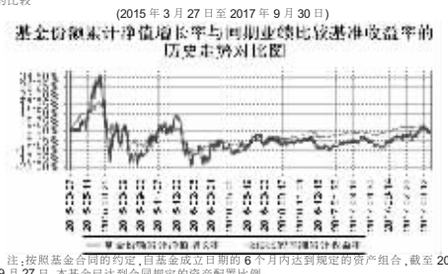
3.2 基金净值表现

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	3.65%	1.00%	2.63%	0.33%	1.02%	0.67%

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

(2015年3月27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、华宝兴业收益增长、华宝智慧产业混合基金经理	2015年3月27日	-	17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月任职于华宝兴业基金管理有限公司,先后任基金经理助理、基金经理的职务。2010年7月至2014年2月任招银梅隆西部基金管理有限公司投资副总监兼基金经理,2014年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,现任助理投资总监,2015年3月起兼任国内投资部总经理,2014年7月起任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理,2015年3月兼任华宝兴业稳健回报混合型证券投资基金基金经理,2017年5月任华宝兴业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、《华宝兴业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

从主要指数来看,2017年三季度主板和创业板均有相应的投资机会;在此期间,上证指数上涨5.05%,沪深300上涨4.57%;创业板上涨2.95%。随着宏观经济整体运行平稳,供给侧改革逐步看到效果,部分周期板块如有色、钢铁、煤炭等在7、8月份有非常良好的表现,同时,企业盈利的改善让以银行为代表的金融机构潜在坏账率出现一定的改善趋势,金融股在三季度也有一定表现。新兴产业方面,消费电子、半导体、新能源汽车、自动化等随着产业不断往前推进优质公司表现持续强势。整体来看,三季度不缺乏投资机会,但对于甄选优质行业和个股的要求在提升。观察宏观经济走势和阶段,判断产业景气度,更好的将自上而下和自下而上相结合来寻找优质投资标的,是本基金一直以来考量的重点。

三季度本基金根据市场环境的变化,除了在审慎控制仓位外,更多的对组合结构进行优化:一方面,增加了价值蓝筹的配置比重,如增持了汽车、金融等行业的龙头个股持股比重;另一方面,加大了周期板块的配置比重,如房地产、钢铁、有色等;最后,在新兴产业里面,本基金也对部分优质成长股保留了一定仓位。

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3.65%,同期业绩比较基准收益率为2.63%,基金表现领先比较基准1.02%。

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	502,439,842.82	82.17
	其中:股票	502,439,842.82	82.17
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	108,791,362.15	17.79
8	其他资产	244,985.50	0.04
9	合计	611,476,190.47	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	54,925,315.50	9.16
C	制造业	288,013,096.96	48.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	8,631,411.50	1.44
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	2,760,060.00	0.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	67,810,135.40	11.31
K	房地产业	65,045,647.69	10.85
L	租赁和商务服务业	6,434,008.90	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,591,572.00	1.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	502,439,842.82	83.83

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	000002	万科A	1,219,766	32,018,857.50	5.34
2	600036	招商银行	1,184,500	30,263,975.00	5.05
3	601699	潞安环能	2,657,225	27,236,556.25	4.54
4	000933	神火股份	2,000,580	22,746,594.60	3.80
5	600104	上汽集团	689,503	20,816,095.57	3.47
6	600309	万华化学	448,800	18,916,920.00	3.16
7	600196	复星医药	531,650	18,177,113.50	3.03
8	000983	西山煤电	1,576,115	16,249,745.65	2.71
9	000538	云南白药	177,029	16,056,530.30	2.68
10	600750	江中药业	498,513	15,030,166.95	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

稳健回报基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的神火股份(000933)于2017年8月30日收到河南煤矿安全监察局的处罚决定。因薛湖煤矿发生安全事故,经认定为煤与瓦斯突出事故,死亡3人,属于较大事故,是一起责任事故。对薛湖煤矿处300万元罚款,并对各负责人给予不同程度的处分。

稳健回报基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的万华化学(600309)于2017年7月6日收到烟台市安监局的处罚决定。因公司烟台工业园在大修停车处理过程中,缓冲罐发生爆炸,造成4人死亡,4人受伤,直接经济损失573.62万元。对万华化学集团股份有限公司处以80万元罚款,并对相关责任人给予相应责任追究。

稳健回报基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的复星医药(600196)于2017年3月2日收到美国食品药品监督管理局的警告。因控股子公司重庆医药工业研究院实验室数据规范性不足。对其出具警告信,并提出整改要求。

稳健回报基金截至2017年9月30日持仓前十名证券中的西山煤电(000983)于2017年8月15日收到山西省发展和改革委员会的处罚决定。因公司涉嫌垄断,对公司所属电厂按2016年度相关销售额1%处以罚款,计505.3216万元。

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六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	179,105.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,968.25
5	应收申购款	49,911.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,985.50

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	673,267,504.24
报告期期间基金总申购份额	3,769,853.42
减:报告期期间基金总赎回份额	74,598,052.34
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	602,439,305.32

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	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(%)	0.22

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;

华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业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。

华宝兴业基金管理有限公司

2017年10月25日

华宝兴业先进成长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	华宝先进成长混合
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	399,815,893.89份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
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	56,210,319.81
2.本期利润	42,168,452.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.1014
4.期末基金资产净值	1,170,708,920.55
5.期末基金份额净值	2.9281

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。

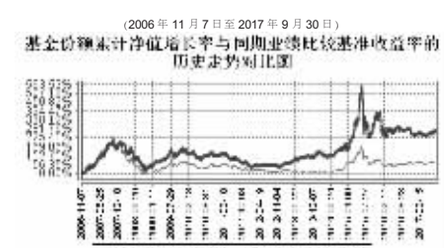
3.2 基金净值表现

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	3.52%	0.93%	4.89%	0.52%	-1.37%	0.41%

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

(2006年11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2007年5月7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		
季鹏	本基金基金经理、华宝兴业宝康配置混合、华宝第三产业混合基金经理	2015年5月7日	-	11年	硕士,拥有CFA资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理工作。2011年4月加入华宝兴业基金管理有限公司任高级策略分析师兼基金经理助理的职务。2013年8月起任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。2015年5月至2017年5月任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。2015年5月起兼任华宝兴业先进成长混合型证券投资基金基金经理。2017年5月任华宝兴业第三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、《华宝兴业先进成长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年三季度经济增速相比上半年有所回落,但依然处于平稳增长状态;经济内在的恢复动力依然很强,经济持续的恢复状态已经从之前的早周期性行业明显扩展到中晚周期,经济形势总体良好,金融系统负债表逐步改善。A股市场三季度整体小幅度上涨,上证综指上涨4.9%,中小板综指上涨5.3%,深证综指上涨4.79%,沪深300上涨4.6%,创业板综指上涨4.04%。各指数也表现良好;但是内部行业轮动和波动很大。三季度在市场温和上涨情况下,先是周期性行业在环保限产带动下出现了较大幅度上涨然后大幅回落,此外,新能源行业也出现了大幅上涨然后回落,消费行业表现持续性较好。行业上涨幅靠前是有色金属、钢铁、食品饮料、采掘、通讯;落后板块主要是公用事业、传媒、纺织服装、家用电器。本基金本月初重仓周期和新能源在三季度初表现较好,但是随后出现较大幅度的下跌,净值回落较大,使得本基金本季度业绩落后,目前本基金持仓适当调整了持仓,展望四季度,本基金倾向于消费和一些估值和成长增速匹配合理的股票,寻找一些确定性机会。

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3.52%,同期业绩比较基准收益率为4.89%,基金表现落后比较基准1.37%。

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	1,022,432,738.27	86.15
	其中:股票	1,022,432,738.27	86.15
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	93,623,017.90	7.89
8	其他资产	70,684,614.71	5.96
9	合计	1,186,740,370.88	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	36,145,400.00	3.09
C	制造业	706,850,863.18	60.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,236,000.00	1.64
F	批发和零售业	4,345,509.04	0.37
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	72,326,952.32	6.18
J	金融业	139,425,149.32	11.91
K	房地产业	9,887,446.00	0.84
L	租赁和商务服务业	1,296,514.88	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,222,000.00	1.47
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	15,696,903.53	1.34
S	综合	-	-
	合计	1,022,432,738.27	87.33

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	300409	道氏技术	850,300	45,150,930.00	3.86
2	601717	郑煤机	4,500,000	34,875,000.00	2.98
3	600197	伊力特	1,500,000	34,500,000.00	2.95
4	300241	瑞丰光电	2,380,000	32,844,000.00	2.81
5	000546	金圆股份	2,350,000	32,806,000.00	2.80
6	601398	工商银行	5,000,000	30,000,000.00	2.56
7	600779	水井坊	699,990	29,273,581.80	2.50
8	002635	安洁科技	705,150	28,671,399.00	2.45
9	002777	久远银海	743,728	27,361,753.12	2.34
10	002460	赣锋锂业	303,700	26,513,010.00	2.26

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

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	562,075.69
2	应收证券清算款	70,141,542.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-157,809.44
5	应收申购款	138,806.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,684,614.71

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	601717	郑煤机	34,875,000.00	2.98	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	425,259,293.78
报告期期间基金总申购份额	3,131,509.59
减:报告期期间基金总赎回份额	28,574,909.48
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	399,815,893.89

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	217,642.44
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	217,642.44
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

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;

华宝兴业先进成长混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业先进成长混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业先进成长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

华宝兴业现金宝货币市场基金

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