华宝兴业资源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	华宝资源优选混合
基金主代码	240022
交易代码	240022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月21日
报告期末基金份额总额	637,196,468.56份
投资目标	把握资源相关行业的投机会,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,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。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对资源相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享资源稀缺性所带来的行业高回报。本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况,将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具(包括但不限于可转换债券、央行票据、以捕捉市场机会,提高基金资产的使用效率。
业绩比较基准	80%×中证内地资源主题指数收益率+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	49,827,592.87
2.本期利润	90,281,116.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.1696
4.期末基金资产净值	942,755,681.73
5.期末基金份额净值	1.480

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	20.61%	1.41%	18.43%	1.35%	2.18%	0.06%

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

(2012年8月21日至2017年9月30日)

注:按照基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6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2013年2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		
蔡目荣	国内投资部副总经理、本基金基金经理、华宝兴业多策略基金经理	2012年8月21日	-	14年	硕士,曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作,2008年6月进入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理和交易员的职务。2012年8月起任华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金经理。2015年6月至2017年3月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。2015年11月任华宝兴业多策略绝长开放式证券投资基金基金经理。2015年3月起任国内投资部副总经理。

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《华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规规定、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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,资源优选混合型证券投资基金在短期内出现过持有现金及一年内到期的政府债券占基金净资产高于40%及持有股票占基金净资产低于60%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,没有给投资人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,国内经济数据再次出现波折,8月份出台的投资、消费以及工业增加值等数据均出现了明显回落,因此市场再次对未来经济增长有所担忧。8月份数据下滑有其自身因素,一方面第四批环保督查进行前很多地方开始自查导致经济活动受到明显影响,另一方面去年同期基数也有偏高因素。由于环保督查影响减弱,根据目前一些微观数据如发电企业煤耗等数据看,整体看3季度国内经济形势依然处于平稳增长状态。三季度美国经济依然表现较好,制造业PMI不断走高,失业率不断走低,美联储在三季度决定自10月起开始缩表。三季度日本下修了二季度的GDP数据,但日本经济依然实现了六个季度正增长,经济表现良好。欧洲三季度继续保持良好的复苏势头,欧央行上调了2017年GDP增长预测。海外经济继续保持复苏。

A股市场三季度整体小幅度上涨,从风格上看创业板指数小幅上涨,中小板指数涨幅较大、上证指数也表现良好。三季度在市场温和上涨情况下主题板块继续成为市场关注焦点,如新能源汽车、5G等板块表现较好。从行业板块看,受益于供给侧改革的有色、钢铁和煤炭行业表现较好,而传媒、电力和纺织行业表现较差。三季度上证指数涨幅4.9%,深成指涨幅5.3%,创业板指数涨幅2.69%。内地资源指数涨幅23.26%,煤炭指数涨幅17.26%,有色指数涨幅30.34%。

三季度资源板块表现较好,主要是因为受益于供给侧改革导致电解铝、煤炭行业供需结构改善,产品价格上涨或者持续维持高位,企业盈利较好。另外,由于环保导致部分资源行业供给受限产品价格上涨。同时新能源汽车行业未来良好发展前景导致锂、钴和稀土永磁材料受到市场高度关注。三季度本基金仓位大部分时间维持了中等偏高仓位,报告期末由于对资源板块偏谨慎而降低了基金仓位。

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20.61%,同期业绩比较基准收益率为18.43%,基金表现领先比较基准2.18%。

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	687,396,958.24	71.99
	其中:股票	687,396,958.24	71.99
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	141,000,000.00	14.77
	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	118,774,183.48	12.44
8	其他资产	7,724,866.16	0.81
9	合计	954,896,007.88	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	386,110,558.51	40.96
C	制造业	284,389,477.68	30.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	4,600,000.00	0.49
F	批发和零售业	12,240,256.70	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	687,396,958.24	72.91

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	600028	中国石化	8,840,591	52,159,486.90	5.53
2	601857	中国石油	5,630,985	44,991,570.15	4.77
3	601899	紫金矿业	10,000,000	38,700,000.00	4.10
4	601088	中国神华	1,790,000	37,482,600.00	3.98
5	601600	中国铝业	4,213,691	31,897,640.87	3.38
6	600348	阳泉煤业	3,600,000	29,376,000.00	3.12
7	600549	厦门钨业	872,000	28,017,360.00	2.97
8	601699	潞安环能	2,700,000	27,675,000.00	2.94
9	600366	宁波韵升	1,231,910	25,796,195.40	2.74
10	002128	露天煤业	1,899,953	24,946,382.89	2.65

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

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	186,562.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	127,942.55
5	应收申购款	7,410,360.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,724,866.16

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	601600	中国铝业	31,897,640.87	3.38	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	292,824,065.43
报告期期间基金总申购份额	821,686,399.45
减:报告期期间基金总赎回份额	477,313,996.32
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	637,196,468.56

注:总申购份额含转换入份额和红利再投;总赎回份额含转换出份额和红利再投。

§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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170908~20170930	0.00	131,215,104.95	0.00	131,215,104.95	20.59%
	2	20170724~20170905	0.00	133,688,741.60	53,688,741.60	80,000,000.00	12.55%
	3	20170721~20170822	0.00	200,437,916.08	200,437,916.08	0.00	0.00%
产品持有风险							

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况,在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如该投资者集中赎回,可能会增加基金的流动性风险。此外,由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产,可能对持有资产的价格形成冲击,增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产,加强防范流动性风险、市场风险,保护持有人利益。

8.2 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 SA.)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 SA.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;

华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业资源优选混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业资源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

上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

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	上证180成长ETF
场内简称	成长ETF
基金主代码	510280
交易代码	510280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月4日
报告期末基金份额总额	46,754,441.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金股票标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑),以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	上证180成长指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。
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	1,325,881.17
2.本期利润	3,849,360.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0841
4.期末基金资产净值	75,589,020.79
5.期末基金份额净值	1.617

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	5.96%	0.64%	4.17%	0.65%	1.79%	-0.01%

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8月4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2月4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		
胡洁	本基金基金经理、华宝兴业上证180成长ETF联接、华宝兴业中证医疗指数分级、华宝兴业中证1000指数分级、华宝兴业中证军工ETF、华宝兴业标普中国A股红利机会指数(LOF)、华宝兴业中证银行ETF基金经理	2012年10月16日	-	11年	金融学硕士,量化投资部总经理助理。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作,2012年10月起任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理,2015年6月起任华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金基金经理。2016年8月起兼任华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017年1月兼任华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理。2017年7月任华宝兴业中证银行交易型开放式指数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《华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规规定、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,国内经济数据再次出现波折,8月份出台的投资、消费以及工业增加值等数据均出现了明显回落,因此市场再次对未来经济增长有所担忧。8月份数据下滑有其自身因素,一方面第四批环保督查进行前很多地方开始自查导致经济活动受到明显影响,另一方面去年同期基数也有偏高因素。由于环保督查影响减弱,根据目前一些微观数据如发电企业煤耗等数据看,整体看3季度国内经济形势依然处于平稳增长状态。三季度美国经济依然表现较好,制造业PMI不断走高,失业率不断走低,美联储在三季度决定自10月起开始缩表。三季度日本下修了二季度的GDP数据,但日本经济依然实现了六个季度正增长,经济表现良好。欧洲三季度继续保持良好的复苏势头,欧央行上调了2017年GDP增长预测。海外经济继续保持复苏。

A股市场三季度整体小幅度上涨,从风格上看创业板指数小幅上涨,中小板指数涨幅较大、上证指数也表现良好。三季度在市场温和上涨情况下主题板块继续成为市场关注焦点,如新能源汽车、5G等板块表现较好。从行业板块看,受益于供给侧改革的有色、钢铁和煤炭行业表现较好,而传媒、电力和纺织行业表现较差。三季度上证指数涨幅4.9%,深成指涨幅5.3%,创业板指数涨幅2.69%。内地资源指数涨幅23.26%,煤炭指数涨幅17.26%,有色指数涨幅30.34%。

三季度资源板块表现较好,主要是因为受益于供给侧改革导致电解铝、煤炭行业供需结构改善,产品价格上涨或者持续维持高位,企业盈利较好。另外,由于环保导致部分资源行业供给受限产品价格上涨。同时新能源汽车行业未来良好发展前景导致锂、钴和稀土永磁材料受到市场高度关注。三季度本基金仓位大部分时间维持了中等偏高仓位,报告期末由于对资源板块偏谨慎而降低了基金仓位。

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20.61%,同期业绩比较基准收益率为18.43%,基金表现领先比较基准2.18%。

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	74,660,587.41	98.18
	其中:股票	74,660,587.41	98.18
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	1,383,893.44	1.82
8	其他资产	605.03	0.00
9	合计	76,045,085.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	21,365,171.94	28.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,203,234.00	2.91
E	建筑业	3,083,744.00	4.08
F	批发和零售业	701,283.75	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	165,675.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,750,107.50	2.32
J	金融业	38,053,952.34	50.34
K	房地产业	5,900,902.86	7.81
L	租赁和商务服务业	423,909.00	0.56
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	73,647,980.39	97.43

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	20,552.49	0.03
C	制造业	763,677.88	1.01
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	26,385.45	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	43,651.27	0.06
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	115,299.99	0.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,012,607.02	1.34

5.2.3 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

5.3.1 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	150,856	8,170,360.96	10.81
2	600036	招商银行	228,518	5,838,634.90	7.72
3	600519	贵州茅台	11,152	5,772,721.28	7.64
4	601166	兴业银行	276,200	4,775,498.00	6.32
5	600016	民生银行	523,800	4,200,876.00	5.56
6	600887	伊利股份	134,700	3,704,250.00	4.90
7	600000	浦发银行	249,037	3,205,106.19	4.24
8	601668	中国建筑	332,300	3,083,744.00	4.08
9	601169	北京银行	323,462	2,413,026.52	3.19
10	600276	恒瑞医药	37,427	2,243,000.11	2.97

5.3.2 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	600485	信威集团	25,800	376,422.00	0.50
2	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.15
3	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.11
4	603321	梅轮电梯	2,725	54,309.25	0.07
5	603055	台华新材	2,047	48,124.97	0.06

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投资。

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	334.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	270.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	605.03

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

5.11.6 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.7 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

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	600485	信威集团	376,422.00	0.50	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	37,754,441.00
报告期期间基金总申购份额	12,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	3,000,000.00
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	46,754,441.00

§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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金