

华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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23日
1.1 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，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的责任。
本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。
本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称 华宝转型升级混合

基金代码 001967

交易方式 约定开放型

基金合同生效日 2016年12月15日

报告期末基金份额总额 111,725,724.92份

投资目标 在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

1.3 基金的业绩表现

本基金采用积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，考察宏观经济、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，对相关资产类别进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。

2. 报告期投资策略

股票投资场域国民经济的周期性，一个国家的经济周期性波动，将影响该国的股票投资环境，从而影响整个市场的投资环境。本基金将根据不同的行业处

于发展的阶段，选择具有代表性的行业，通过行业分析，把握上市公司的基本面，结合其他宏观经济转

变情况，适时调整资产配置比例，决定大类资产配

置比例。

3. 固定收益类投资策略

本基金主要投资于货币市场工具和资产支持证券，以有效降低组合波动率，提高基金资产的稳定性。

4. 权益投资策略

本基金将根据宏观周期的框架下，运用行业权

益投资模型，结合行业分析，选择具有代表性的

行业，通过行业分析，把握上市公司的基本面，结

合其他宏观经济变化情况，适时调整资产配置比

例，决定大类资产配置比例。

5. 资产支持类投资策略

本基金主要投资于资产支持证券的组合投资策

略，以降低组合的波动率，提高基金资产的稳定性。

6. 资产支持类投资策略

本基金主要投资于资产支持证券的组合投资策

略，以降低组合的波动率，提高基金资产的稳定性。

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

他品种，本基金将在履行适当程序后，纳入基金的投

资范围，具体规则按法律法规或监管机构的规定执

行。

8. 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

预期收益率高于货币市场基金，低于债券型基

金，低于股票型基金。

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

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 11,139,126.04

2.本期利润 14,979,892.96

3.期初基金份额总额 0.09091

4.期末基金份额净值 120,109,354.12

5.期末基金份额净值 1.195

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.根据《华宝兴业1号混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范

围包括国内依法发行的股票（包括创业板、中小板和其他经中国证监会批准上市

的股票）、债券、国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债及其它信用类债券、中小企业私募债），货币市场基金、存款、股权回购、股票期权、股指期货、权证、衍生品投资等其他金融工具。本基金的组合比例为：股票、权证、衍生品投资占总资产的比例不高于90%，其中基金持有的定期权证的比例不超过净资产的3%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占总资产的比例不高于50%，其中每个交易日终，保持现金或到期日在一年以内国债或政府债券的最大比例，没有货币市场份额持有人利益的保护。

3.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

预期收益率高于货币市场基金，低于债券型基

金，低于股票型基金。

基金管理人承诺诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基

金一定盈利。

基金管理人承诺诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基