华富健康文娱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:华富基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富健康文娱灵活配置混合
基金主代码	001563
交易代码	001563
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月4日
报告期末基金份额总额	60,550,155.17份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于健康文娱主题相关的优质上市公司,精选个股,分享其发展和成长的机会,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及健康文娱相关行业的发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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	599,907.16
2.本期利润	3,326,822.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0503
4.期末基金资产净值	59,452,262.77
5.期末基金份额净值	0.982

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。

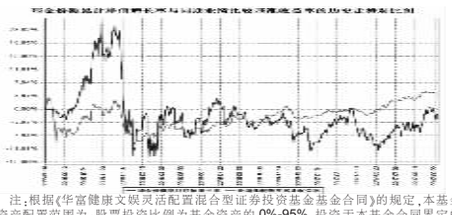
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.36%	0.97%	2.41%	0.30%	2.95%	0.67%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注:根据《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票投资比例为基金资产的0%-95%,投资于本基金合同界定的健康文娱主题相关证券不低于非现金基金资产的80%;权证投资比例不得超过基金资产净值的3%;保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为2015年8月4日到2016年2月4日。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§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		
陈启明	华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富价值增长灵活配置混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富产业升级灵活配置混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会委员、基金投资部总监	2015年8月4日	-	十一年	复旦大学会计学硕士,本科学历。历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理,2010年2月加入华富基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究发展部副总监,2013年3月1日至2014年9月25日任华富成长趋势股票型基金基金经理助理。
高靖瑜	华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理	2015年8月4日	-	十七年	复旦大学金融学硕士,本科学历。历任金鼎综合证券(维京)股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员,2007年7月加入华富基金管理有限公司,任行业研究员,2013年3月1日至2014年12月14日任华富价值增长混合型基金基金经理助理,2014年12月15日至2016年1月12日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理。

注:这里的任职日期指基金合同生效之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同,招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度沪深300指数累计上涨4.63%,创业板指累计上涨2.69%。三季度看,市场分化趋势有所缓解,周期股在经济数据出现预期差的背景下走出大波机会,成长股也出现明显反弹,消费白马在季末周期调整时趁势而起有所表现,大体都有所表现。三季度上涨较好的行业主要是有色、钢铁、煤炭、食品饮料、通信等。

本基金三季度持仓中仍以健康与文娱这两大基金主题相关行业配置为主,季中重点配置行业包括生物医药、消费电子、新能源车、食品饮料等,结构相对均衡。

2017年三季度,经济预计总体平稳运行,前三季度经济表现优于年初市场预期,9月宏观经济景气度较8月环比回升,预计四季度经济增速没有失速下行风险,经济增速总体趋稳微降。9月官方制造业PMI创近5年内新高,9月中国官方制造业PMI指数52.4,远超市场预期值(51.6)和前值(51.7),升至近5年来高点,但官方制造业PMI与财新制造业PMI出现背离,主要因素在于后者统计口径上更偏向中小民营企业,后期这种趋势可能将继续。

展望2017年四季度,我们认为存量资金市场中,还是以结构性行情为主,主要思路还是以精选个股以及抓阶段性优势板块的操作为主。目前市场预期下半年经济压力相对较大,但回落幅度有限,全年总体平稳,在这种背景下,存在预期差调整带来的板块轮动机会,我们在四季度仍将关注消费、周期行情,另外,2018年即将到来,蛰伏两年的成长股慢慢出现机会,也需要重点挖掘。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2015年8月4日正式成立。截止2017年9月30日,本基金份额净值为0.982元,累计份额净值为0.982元。报告期,本基金份额净值增长率为5.36%,同期业绩比较基准收益率为2.41%。

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出现基金份额持有人数量不满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	49,183,899.14	81.99
	其中:股票	49,183,899.14	81.99
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	-	-
	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	7,209,444.33	12.02
8	其他资产	3,592,654.31	5.99
9	合计	59,985,997.78	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	2,418,700.00	4.07
C	制造业	40,715,499.14	68.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,142,400.00	1.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,456,250.00	2.45
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,560,000.00	2.62
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	1,891,050.00	3.18
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	49,183,899.14	82.73

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无

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	600276	恒瑞医药	53,000	3,176,290.00	5.34
2	300070	碧水源	105,000	1,891,050.00	3.18
3	000915	山大华特	54,000	1,860,840.00	3.13
4	603589	口子窖	38,000	1,857,440.00	3.12
5	002202	金风科技	140,000	1,828,400.00	3.08
6	603686	龙马环卫	55,000	1,801,250.00	3.03
7	000725	京东方A	400,000	1,760,000.00	2.96
8	600585	海螺水泥	70,000	1,747,900.00	2.94
9	002562	兄弟科技	90,000	1,728,000.00	2.91
10	603626	科森科技	40,000	1,723,600.00	2.90

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注:本报告期末本基金无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,587.12
2	应收证券清算款	3,520,106.40
3	应收股利	-
4	应收利息	4,512.51
5	应收申购款	3,448.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,592,654.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	70,622,125.20
报告期期间基金总申购份额	198,504.65
减:报告期期间基金总赎回份额	10,270,474.68
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	60,550,155.17

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,600.00
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
报告期末管理人持有的本基金份额	10,002,600.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	16.52

注:基金管理人投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求,申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额、赎回卖出总份额里包含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§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

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富强化回报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:华富基金管理有限公司
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24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富强化回报债券
基金主代码	164105
交易代码	164105
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2010年9月8日
报告期末基金份额总额	291,924,807.10份
投资目标	在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素,研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险,以确定各类金融资产的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
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

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	2,386,606.92
2.本期利润	3,001,718.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0114
4.期末基金资产净值	364,485,548.66
5.期末基金份额净值	1.249

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。

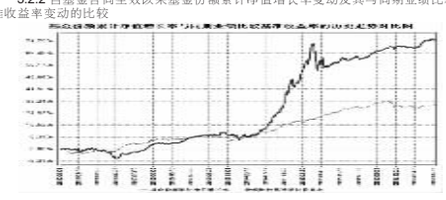
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.05%	0.13%	0.56%	0.04%	0.49%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注:根据《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资,并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%。在封闭期结束后,本基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2010年9月8日到2011年3月8日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定。

§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		
尹培俊	华富强化回报债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富安享保本混合型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富华鑫灵活配置混合型基金基金经理、固定收益部副总监、公司公募投资决策委员会委员	2014年3月6日	-	十一年	华东师范大学经济学学士,本科学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理,2012年加入华富基金管理有限公司,曾任固定收益部信用研究员、固定收益部总监助理。

注:这里的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同,招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

基本面来看,2017年三季度经济走势稳健,经济增长惯性仍在。资金面和政策面来看,央行仍然维持稳健中性货币政策,资金面阶段性波动,金融去杠杆仍在进行,市场风险偏好受到压制。三季度债市仍延续震荡走势,市场整体机会有限。本基金三季度基本维持债券较短的久期和较低的杠杆,坚持配置为主的策略,同时自下而上寻找转债等风险资产的机会,基金净值稳健上涨。

目前来看,经济基本面较我们之前的预期更为强劲,债券市场趋势性机会仍需要耐心等待,从绝对回报角度,债券收益率具备较好的配置价值。货币政策方面,央行仍将维持稳健中性的货币政策,但"普惠式降准"有助于市场对后续资金面预期的稳定,修复短端资金利率水平。政策面市场虽然仍将面对金融去杠杆的压力,但尾部风险逐步释放,整体风险可控。展望四季度,我们对债市的观点仍然相对中性,长端利率债或有波段机会,短端1-3年中高等级资产仍然是更为明确的机会。因此本基金将继续适度杠杆和久期,严控信用风险,弱化资本利得,风险资产及时做好波段操作和结构调整。本基金将在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,稳健地做好配置策略,均衡投资,降低业绩波动,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2010年9月8日正式成立。截止2017年9月30日,本基金份额净值为1.249元,累计份额净值为1.700元。本报告期,本基金净值增长率为1.05%,同期业绩比较基准收益率为0.56%。

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出现基金份额持有人数量不满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	17,330,757.49	4.47
	其中:股票	17,330,757.49	4.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	344,628,863.02	88.80
	其中:债券	344,628,863.02	88.80
	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	6,241,358.17	1.61
8	其他资产	19,897,640.61	5.13
9	合计	388,098,619.29	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	13,599,208.00	3.73
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	-	-
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	-	-
J	金融业	3,731,549.49	1.02
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	17,330,757.49	4.75

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: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	002241	歌尔股份	496,700	10,053,208.00	2.76
2	601336	新华保险	65,847	3,731,549.49	1.02
3	600422	昆药集团	300,000	3,546,000.00	0.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,894,136.00	5.18
	其中:政策性金融债	18,894,136.00	5.18
4	企业债券	225,099,522.26	61.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	63,132,600.00	17.32
7	可转债(可交换债)	37,502,604.76	10.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	344,628,863.02	94.55

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101553005	15金发MTN001	200,000	20,596,000.00	5.65
2	112129	12华锦债	200,000	20,004,000.00	5.49
3	136032	15红美01	200,000	19,898,000.00	5.46
4	136026	15蒙阜丰	200,000	19,676,000.00	5.40
5	122671	12扬子江	185,000	19,182,650.00	5.26

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

注: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

注: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

注: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国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	32,388.22
2	应收证券清算款	12,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,864,158.95
5	应收申购款	1,093.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,897,640.61

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	8,264,200.00	2.27
2	113008	电气转债	6,920,550.00	1.90

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	243,649,991.40
报告期期间基金总申购份额	117,432,529.52
减:报告期期间基金总赎回份额	69,157,713.82
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	291,924,807.10

§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

注:本报告期本基金管理人没有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

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	74,543.01
2	应收证券清算款	376,993.57
3	应收股利	-
4	应收利息	27,787,580.75
5	应收申购款	20,324.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,259,442.12

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132006	16皖新EB	40,544,000.00	2.69
2	110034	九州转债	22,968,420.80	1.52
3	110032	三一转债	15,834,207.20	1.05
4	113008	电气转债	12,800,888.10	0.85
5	120001	16以岭EB	5,347,000.00	0.35
6	113010	江南转债	706,999.20	0.05

5.10.5 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	300145	中金环境	24,364,800.00	1.61	重大事项停牌

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
报告期期初基金份额总额	732,312,449.67	65,644,247.97
报告期期间基金总申购份额	341,162,113.50	102,269,681.55
减:报告期期间基金总赎回份额	332,969,986.49	64,785,509.99
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	740,504,576.68	103,128,419.53

§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

注:本报告期内本基金管理人没有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

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§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	7.1-9.30	125,391,222.57	0.00	0.00		125,391,222.57	42.95%
	2	7.1-9.30	31,327,694.24	39,967,226.22	0.00		71,294,920.46	24.42%
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品特有风险								
无								

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富强化回报债券型证券投资基金基金合同

2、华富强化回报债券型证券投资基金托管协议

3、华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富强化回报债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富收益增强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:华富基金管理有限公司
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24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富收益增强债券
基金主代码	410004
交易代码	410004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月28日
报告期末基金