

华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

2017年度报告摘要

2017年1月31日
基金管理人：华宝基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：2018年3月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 基金管理人的董事会、监事会在报告期间所获得的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法律责任。本基金在报告期间经审计的财务报告不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2018年3月21日复核了本报告书中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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，投资者购买基金时应认真阅读基金合同、招募说明书及其摘要等法律文件，全面认识基金的风险收益特征和可能存在的风险，充分考虑自身的风险承受能力，谨慎投资。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金的财务资料已经审计，华夏永乐忠先生为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告书全文已于2017年1月31日起登载于本公司网站。

§ 2 基金简介

基金名称 华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 华宝稳健回报

基金主代码 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

基金管理人 华宝基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 547,266,534.67份

基金合同存续期 不定期

本基金目标

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，追求超越基金业平均水平的稳定收益，力争实现基金资产的长期增值。

1.1 大类资产配置策略

本基金在资产配置的大类资产配置策略，通常宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等因素，对相关资产类别的配置比例进行动态调整，以求达到最大资产配置效率。

2.1 股票投资策略

本基金股票投资的选股策略将“自下而上”的行业配置策略和“自上而下的个股精选策略”相结合，侧重于对行业和个股的研究，通过深入分析行业基本面，挖掘行业景气度较高的行业，选择具有持续竞争优势的公司，进行价值投资。

3. 债券投资策略

本基金债券投资的债券投资策略是通过深入研究宏观经济、政策环境、资金面、利率水平、信用利差、期限利差等影响债券价格的因素，结合对宏观经济的判断，把握债券市场的投资机会。

4. 固定收益类资产投资策略

本基金将严格按照法律法规的规定，加强对固定收益类资产的控制，加强对信用风险的防范，通过信用评级、久期管理、分散投资、定期评估、止损机制等方法，降低信用风险。

5. 其他金融衍生品投资策略

本基金将根据法律法规的规定，审慎地选择金融衍生品投资，通过套期保值、对冲等手段，降低投资组合的波动率，提高投资组合的稳定性。

6. 其他金融工具投资策略

本基金将根据法律法规的规定，审慎地选择金融衍生品投资，通过套期保值、对冲等手段，降低投资组合的波动率，提高投资组合的稳定性。

7. 风险特征

沪深300指数成份股占基金资产的比例为45%。

风险特征

本基金是一只风险收益适中、风格稳定的混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币基金，低于股票基金。

2.2 基金产品说明

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，追求超越基金业平均水平的稳定收益，力争实现基金资产的长期增值。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

华宝基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 陈月华 王洪波

性别 男 男

联系电话 021-38505888 010-66596996

电子邮箱 xpp@fundchina.com fond@fundchina.com

客户服务电话 400-700-5998, 021-38245588 95566

传真 021-38505777 010-66594942

2.4 信息披露方式

基金管理人通过基金客户服务网站（www.fund.com）

基金份额持有人通过基金管理人或销售机构网站

基金份额持有人通过基金管理人或销售机构网站

3.1 主要财务指标和财务数据

金额单位：人民币元

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -26,783,651.71 -62,643,671.07

本期利润 -128,044,436.95 -128,788,069.46

加权平均基金份额净值 0.9884 -0.1636

本期末基金资产净值 92.27% -17.94%

基金份额净值增长率 8.93% -15.71%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042

本期末基金资产净值 0.9527 -0.0669

基金份额净值增长率 5.41% -22.06%

6.30%

2017年 2016年

2017年1月1日至2015年12月31日

本期已实现收益 -24.0% -10.40%

本期利润 -13,352,272.65 -75,880,135.00

加权平均基金份额净值 1.0045 -0.1042