

华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资 基金（LOF）2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 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 4 月 24 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 4 月 20 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华宝新机遇混合 |
| 场内简称 | 新机遇 |
| 基金主代码 | 162414 |
| 交易代码 | 162414 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 11 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 621,492,080.03 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，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 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>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金融产品，基金管理人将根据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。</p> | |
| 业绩比较基准 | 1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，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 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华宝新机遇混合 A | 华宝新机遇混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 162414 | 003144 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 155,726,964.74 份 | 465,765,115.29 份 |

§ 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1月1日—2017年3月31日） | |
|-----------------|---------------------------|--------------|
| | 华宝新机遇混合 A | 华宝新机遇混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 1,388,842.20 | 4,505,365.94 |
| 2. 本期利润 | 2,717,529.66 | 9,015,536.64 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0163 | 0.0156 |

| | | |
|-------------|----------------|----------------|
| 4. 期末基金资产净值 | 169,144,880.35 | 505,570,117.60 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0862 | 1.0855 |

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

华宝新机遇混合 A

| 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 | 1.51% | 0.07% | 1.11% | 0.01% | 0.40% | 0.06% |

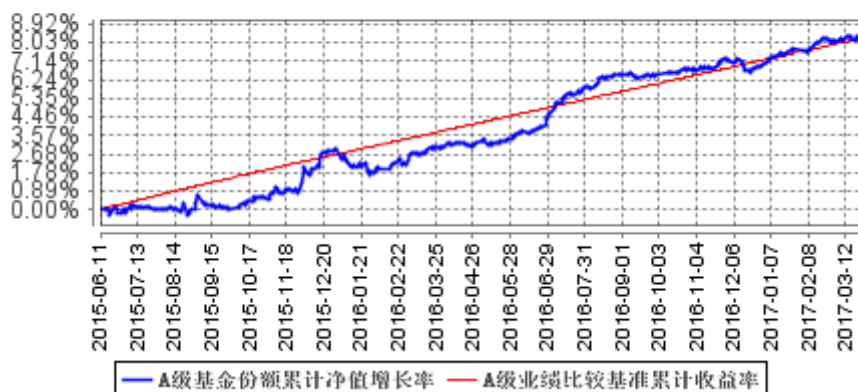
华宝新机遇混合 C

| 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 | 1.49% | 0.07% | 1.11% | 0.01% | 0.38% | 0.06% |

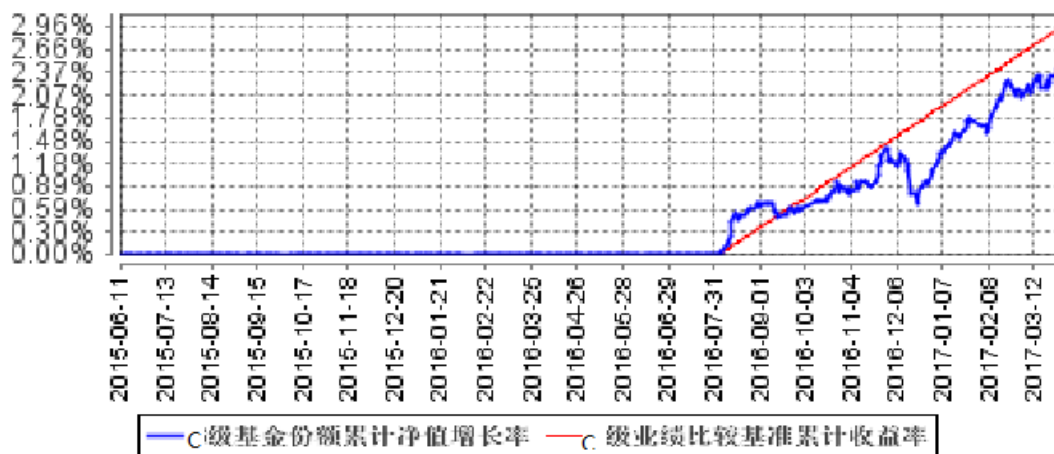
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2015年6月11日至2017年3月31日)

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、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 12 月 11 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、华宝兴业新机遇 C 成立于 2016 年 8 月 4 日，本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图的数据的计算起始日期为 2016 年 8 月 4 日。

§ 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 | | |
| 李栋梁 | 固定收益部副总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康债券、华宝兴业增强收益债券、华宝新价值混合、华宝兴业可转债债券、华宝宝鑫 | 2015 年 10 月 16 日 | - | 14 年 | 硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资，2010 年 9 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师，2010 年 12 月至 2011 年 6 月任华宝兴业宝康债券基金经理助理，2011 年 6 月起担任华宝兴业宝康债券基金经理，2014 年 10 月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）和华宝兴业新价值灵活配置混合型证券 |

| | | | | | |
|-----|--|-----------------|-----------------|------|---|
| | 债券、华宝新活力混合、华宝新起点混合、华宝新动力混合、华宝新飞跃混合、华宝新回报混合、华宝新优选混合基金经理 | | | | 投资基金基金经理。2016 年 4 月兼任华宝兴业宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016 年 5 月任固定收益部副总经理。2016 年 6 月兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月兼任华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月兼任华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 2 月兼任华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月兼任华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金和华宝兴业新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 林昊 | 本基金基金经理、华宝新价值混合、华宝新活力混合基金经理 | 2017 年 3 月 17 日 | - | 11 年 | 本科。2006 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起担任华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 蔡目荣 | 国内投资部副总经理、本基金基金经理、华宝兴业多策略股 | 2015 年 6 月 11 日 | 2017 年 3 月 17 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 |

| | | | | |
|--|----------------|--|--|---|
| | 票、华宝资源优选混合基金经理 | | | 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增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合规守信情况的说明

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、《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 1-2 月份，固定资产投资完成额同比增长 8.9%，1-2 月份固定资产投资增速较去年全

年反弹。分行业来看，制造业投资完成额同比增速稳定在 4.3%，房地产开发投资完成额同比增速反弹至 8.9%，房地产的销售和投资均好于市场预期；基础设施投资同比增速高达 27.3%，增速比去年全年提高 9.9 个百分点。1-2 月份固定资产投资增速超过市场预期。1-2 月份出口金额同比上升 4.0%，出口增速受到海外经济好转的影响而上升；1-2 月份进口金额同比上升 26.4%，进口增速大幅上升主要受到进口商品价格大幅上升的影响，同时国内经济好转也带动了进口量的上升。三驾马车中唯一较差的是消费增速，1-2 月份社会消费品零售总额同比增长 9.5%，名义和实际消费增速均较去年大幅下滑，其中汽车消费增速大幅下滑是主要原因。物价水平分化明显，CPI 水平较为温和，PPI 大幅上升，1-2 月份 CPI 为 1.7%，2 月份 CPI 为 0.8%；2 月份 PPI 为 7.8，PPI 向 CPI 的传导并不顺畅。1 季度央行实际采取了从紧的货币政策，央行提高了公开市场操作利率，货币市场收益率也始终处在较高的水平。1-2 月份信贷和社会融资总量超过预期，表内信贷中长期贷款总量很高，表外融资中委托贷款和信托贷款多增，中长期信贷中房贷总量依然维持在高位。

1 季度债券市场继续下跌，部分经济和金融数据超过预期以及央行实质从紧的货币政策是导致债券市场下跌的主要原因，债券收益率曲线以向上平移为主。银行存单发行利率不断上升，带动了短融收益率的上升。长久期利率债收益率期间有过两次反弹，但是反弹力度都较弱。经济增速稳定、央行货币政策从紧、金融机构去杠杆等始终对债券市场构成抑制。

1 季度股票市场整体上涨，不同指数和行业之间分化较为明显。期初周期股以及一带一路主题表现较好，后来受益于消费升级的行业表现较好，如家电、家装、消费电子、白酒等行业表现较好；创业板因估值较高、权重股表现暗淡而整体表现较差。可转债整体波动较小，个券分化较大，部分转股溢价率较低的品种跟随正股同步上涨。因转债整体扩容压力极大，转债整体的估值水平持续下降，表现为转债的转股溢价率压缩，攻击性转债的上涨幅度远低于正股，而纯债溢价率和转股溢价率双高的品种则持续下跌。转债市场估值经过持续压缩之后，转债的安全性将逐步体现，攻击性也较以往大幅提升。

2017 年 1 季度新机遇混合型基金提高了债券和货币市场工具的投资比例，提高了股票的配置比例，并积极参与新股网下申购来提高收益。本基金始终坚持绝对收益的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内新机遇 A 基金份额净值增长率为 1.51%，同期业绩比较基准收

益率为 1.11%；新机遇 C 基金份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为 1.11%

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 | 124,238,528.35 | 16.48 |
| | 其中：股票 | 124,238,528.35 | 16.48 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 587,660,758.10 | 77.97 |
| | 其中：债券 | 587,660,758.10 | 77.97 |
| | 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 | 34,109,787.22 | 4.53 |
| 8 | 其他资产 | 7,652,311.13 | 1.02 |
| 9 | 合计 | 753,661,384.80 | 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 | 17,313,155.08 | 2.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,322,655.36 | 1.97 |
| E | 建筑业 | 25,029.52 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 74,088.00 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 131,314.89 | 0.02 |
| 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 | 73,463,695.50 | 10.89 |
| K | 房地产业 | 5,540,000.00 | 0.82 |
| 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 | 14,368,590.00 | 2.13 |
| 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 | 124,238,528.35 | 18.41 |

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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 | 000001 | 平安银行 | 2,650,000 | 24,300,500.00 | 3.60 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 4,490,000 | 21,731,600.00 | 3.22 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 386,000 | 16,598,000.00 | 2.46 |
| 4 | 601288 | 农业银行 | 4,895,000 | 16,349,300.00 | 2.42 |
| 5 | 000069 | 华侨城 A | 1,968,300 | 14,368,590.00 | 2.13 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 1,003,968 | 13,322,655.36 | 1.97 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 2,995,215 | 11,082,295.50 | 1.64 |
| 8 | 000402 | 金融街 | 500,000 | 5,540,000.00 | 0.82 |
| 9 | 603833 | 欧派集团 | 2,329 | 223,560.71 | 0.03 |
| 10 | 601228 | 广州港 | 32,911 | 131,314.89 | 0.02 |

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 | 3,497,000.00 | 0.52 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 49,735,000.00 | 7.37 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,042,000.00 | 5.93 |
| 4 | 企业债券 | 33,015,758.10 | 4.89 |
| 5 | 企业短期融资券 | 309,522,000.00 | 45.87 |
| 6 | 中期票据 | 119,125,000.00 | 17.66 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,078,000.00 | 0.60 |

| | | | |
|----|------|----------------|-------|
| 8 | 同业存单 | 68,688,000.00 | 10.18 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 587,660,758.10 | 87.10 |

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 | 011698387 | 16 锡产业 SCP005 | 500,000 | 50,035,000.00 | 7.42 |
| 2 | 011698404 | 16 佛公用 SCP008 | 500,000 | 50,015,000.00 | 7.41 |
| 3 | 011698927 | 16 中航机电 SCP004 | 500,000 | 49,895,000.00 | 7.39 |
| 4 | 041656027 | 16 大宁资产 CP001 | 500,000 | 49,815,000.00 | 7.38 |
| 5 | 041653066 | 16 首机场股 CP001 | 500,000 | 49,750,000.00 | 7.37 |

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 | 26,803.02 |
| 2 | 应收证券清算款 | 179,943.19 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,445,465.07 |
| 5 | 应收申购款 | 99.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,652,311.13 |

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

| 项目 | 华宝新机遇混合 A | 华宝新机遇混合 C |
|-------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 176,638,229.70 | 608,227,673.21 |

| | | |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,204,081.98 | 55,532,469.49 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 24,115,346.94 | 197,995,027.41 |
| 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 | 155,726,964.74 | 465,765,115.29 |

注: 1. 总申购份额含转换入份额; 总赎回份额含转换出份额。

2. C 类份额自 2016/8/4 开始申赎交易。

§ 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

7.1.1 基金管理人持有 A 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 | 1,386,337.38 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 730,739.35 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 2,117,076.73 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 1.36 |

7.1.2 基金管理人持有 C 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该份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|-----------|------|------------|------------|------------|-------|
| 1 | 申购 | 2017年3月20日 | 730,739.35 | 800,000.00 | 1.20% |
| 合计 | | | 730,739.35 | 800,000.00 | |

注: 交易日期为确认日期, 交易金额为确认金额。

申购为 A 类份额。

§ 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 | 20170103~20170331 | 187,562,281.5 | 0 | 0 | 187,562,281.5 | 30.18% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> | | | | | | | |

§ 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；
 华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同；
 华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书；
 华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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办公场所备投资者查阅。

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 4 月 24 日