

# 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

## 2014 第一季度报告

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:2014年7月18日

1 重要提示

基金管理人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2014年7月15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预示其未来表现。投资者有风险,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。

本报告期为2014年4月1日起至6月30日止。

### 2 基金产品概况

基金名称	华宝兴业新兴产业股票
基金代码	240017
交易代码	240020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月17日
报告期末基金份额总额	1,655,050,241.14份
投资目标	分享新兴产业所带来的投资机会,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置策略,通过宏观研判,对相关行业类别的预期收益进行动态跟踪,通过对新兴产业相关行业的基本面、估值、流动性等因素进行综合研判,选择具有中长期投资价值、分享新兴产业发展所带来的超额回报。本基金通过分散投资,分散新兴产业投资集中度,降低单一行业、单一公司投资带来的投资风险。
业绩比较基准	75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。
风险收益特征	本基金属于中高风险证券投资基金,预期收益和风险高于股票型基金。
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

主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-25,921,664.67
2.本期利润	16,661,997.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0980
4.期末基金净值	2,560,027,718.33
5.期末基金份额净值	1.5466

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。

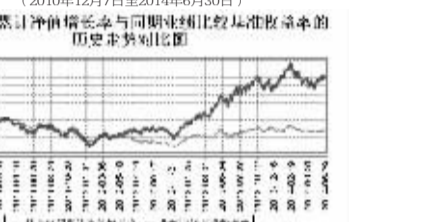
### 3.2 基金净值表现

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	7.25%	1.26%	8.41%	0.76%	-1.16%	0.50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

(2010年12月17日至2014年6月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立之日起90个月内达到规定的资产组合,截至2011年6月6日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 4 管理人报告

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业资格	说明
魏志军	基金经理	2004年7月	是	硕士,曾任CFAI研究员,2004年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,历任研究员、基金经理,2007年9月任中国银河证券基金部副经理,2009年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,2010年12月担任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2012年4月担任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2014年6月担任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
魏志军	基金经理	2013年7月25日	是	硕士,曾在普华永道(中国)会计师事务所担任审计师,2007年加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理,2012年4月担任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2014年6月担任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
魏志军	基金经理	2013年7月25日	是	硕士,曾在普华永道(中国)会计师事务所担任审计师,2007年加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理,2012年4月担任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2014年6月担任华宝兴业新兴产业股票型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.证券从业定义遵照中国证监会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,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、系统性的公平交易程序,每日交割日报告,定期基金投资绩效考评机制,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环节不存在不公平对待。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,分析了本基金旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资组合(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方向价差,分析结果未发现异常情形。

### 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金额超过该证券当日成交量的5%。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.4.3 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、系统性的公平交易程序,每日交割日报告,定期基金投资绩效考评机制,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环节不存在不公平对待。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,分析了本基金旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资组合(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方向价差,分析结果未发现异常情形。

### 4.4.3.2 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金额超过该证券当日成交量的5%。

### 4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.4.4.3 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、系统性的公平交易程序,每日交割日报告,定期基金投资绩效考评机制,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环节不存在不公平对待。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,分析了本基金旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资组合(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方向价差,分析结果未发现异常情形。

### 4.4.4.3.2 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金额超过该证券当日成交量的5%。

### 4.4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.4.4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的有关规定,恪尽职守,勤勉尽责,严格控制投资风险,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.4.4.4.3 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、系统性的公平交易程序,每日交割日报告,定期基金投资绩效考评机制,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环节不存在不公平对待。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,分析了本基金旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资组合(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方向价差,分析结果未发现异常情形。

### 4.4.4.4.3.2 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金额超过该证券当日成交量的5%。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	2,087,207,209.75	79.18
	其中:股票	2,087,207,209.75	79.18
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产投资	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
	其中:应收利息	438,152,878.58	16.87
6	银行存款和结算备付金合计	103,272,307.96	3.95
7	其他资产	2,957,982,481.28	109.60
8	合计	5,526,562,867.57	209.60

### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	82,008,846.12	3.20
C	制造业	838,363,202.17	32.75
D	电力、热力、燃气及生产供应业	16,293,047.72	0.64
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	48,443,769.56	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	498,319,475.55	19.47
J	房地产业	645,355.48	0.03
K	租赁和商务服务业	216,370,604.52	8.45
L	科学研究和技术服务业	26,139,209.66	0.95
M	水利、环境和公共设施管理业	201,659,472.33	10.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	37,707,573.56	1.47
R	文化、体育和娱乐业	33,085,629.29	1.29
S	综合	-	-
合计		2,087,207,209.75	80.36

### 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	300070	睿米网	7,083,372	206,321,663.68	8.06
2	002538	盛通电气	5,711,322	134,965,464.92	5.27
3	300090	通威股份	7,046,316	119,979,477.00	4.34
4	300212	易世达	3,362,405	105,310,246.61	4.11
5	002400	中印股份	4,180,116	102,747,251.28	4.01
6	300058	富春环保	3,434,106	91,441,173.24	3.56
7	300063	耀世光电	5,500,000	83,475,000.00	3.28
8	300026	冠石电子	2,656,742	77,842,560.60	3.04
9	300025	华谊集团	4,200,000	68,659,600.00	2.68
10	300157	鼎泰新材	5,193,918	67,209,298.92	2.63

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期内,基金管理人未持有债券投资。

### 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

本报告期内,基金管理人未持有债券投资。

### 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五名资产支持证券投资明细

本报告期内,基金管理人未持有资产支持证券。

### 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

本报告期内,基金管理人未持有贵金属投资。

### 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

本报告期内,基金管理人未持有权证。

### 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

本报告期内,基金管理人未持有股指期货。

### 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 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.10.2 本基金投资国债期货的投资政策

本基金未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,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特别提示。

### 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	703,302.30
2	应收证券清算款	100,041,127.85
3	应收股利	-
4	应收利息	75,129.93
5	应收申购款	1,834,148.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,627,329.90

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期内,基金管理人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	流通受限部分公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300025	华谊集团	68,659,600.00	2.68	重大资产重组
2	002538	盛通电气	63,970,000.00	2.54	非公开发行

### 5.11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本报告期内,基金管理人未持有股指期货。

### 5.11.7 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国债期货投资明细

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.8 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

本报告期内,基金管理人未持有权证。

### 5.11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,基金管理人未持有股指期货。

### 5.11.10 本基金投资国债期货的情况

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.12 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 5.11.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	259,548.68
2	应收证券清算款	3,221,853.18
3	应收股利	-
4	应收利息	958,166.28
5	应收申购款	1,716,317.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,155,911.28

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128002	华东转债	284,905.80	0.02

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期内,基金管理人未持有处于流通受限情况的股票。

### 5.11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本报告期内,基金管理人未持有股指期货。

### 5.11.7 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国债期货投资明细

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.8 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

本报告期内,基金管理人未持有权证。

### 5.11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,基金管理人未持有股指期货。

### 5.11.10 本基金投资国债期货的情况

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.12 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 5.11.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	259,548.68
2	应收证券清算款	3,221,853.18
3	应收股利	-
4	应收利息	958,166.28
5	应收申购款	1,716,317.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,155,911.28

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300147	碧生源	3,188,890	0.12
2	300298	奇信生物	1,499,604	0.06
3	00963	华信国际	688,368	0.03
4	600094	盛润股份	893,416	0.03
5	000209	中航地产	900,441	0.03
6	600196	易世达	1,789,753	0.07
7	300171	东富龙	965,309	0.04
8	600207	南京东	2,243,493	0.09
9	300015	宏源证券	1,422,857	0.05
10	601607	上海医药	2,547,043	0.10

### 5.11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,基金管理人未持有股指期货。

### 5.11.10 本基金投资国债期货的情况

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,基金管理人未持有国债期货。

### 5.11.12 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 5.11.13 其他资产构成