华宝兴业生态中国混合型证券投资基金

【2015】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:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝生态中国混合
基金主代码	000612
交易代码	000612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月13日
报告期末基金份额总额	687,122,777.73份
投资目标	把握生态主题相关行业和上市公司的稳步成长,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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;本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对生态主题相关行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享我国生态文明建设所带来的投资机会;本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合;在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
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

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-279,486,035.94
2.本期利润	-400,259,958.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5780
4.期末基金资产净值	1,082,722,379.91
5.期末基金份额净值	1.576

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。

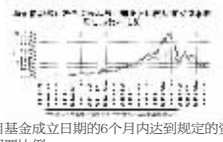
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-24.85%	4.03%	-23.49%	2.73%	-1.36%	1.30%

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
(2014年6月13日至2015年9月30日)



注: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2014年12月13日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		
夏林锋	本基金基金经理、华宝大盘精选混合基金经理、华宝新价值混合基金经理	2015年2月17日	-	5年	硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任分析师,2012年10月至2014年10月担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金基金经理助理,2014年10月起担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金经理。2015年6月起任华宝新价值混合基金经理。
区伟良	本基金基金经理	2015年4月9日	-	5年	硕士。2010年4月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理的职务,2015年4月起任华宝兴业生态中国混合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 管理人对投资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、《华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金合同》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,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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度A股市场延续了二季度的下跌趋势,上证指数和创业板指下跌都超过25%,基于对市场比较谨慎的态度,本基金保持了偏低的仓位水平,持仓结构仍然以长期看好的成长股为主。三季度本基金净值下跌24.85%,小幅落后于业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为-24.85%,同期业绩比较基准收益率为-23.49%,基金表现落后比较基准1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股市场经过近4个月的大幅回调,估值泡沫已经有所消化,成长股整体估值水平回到一个相对合理的水平,市场的杠杆水平也明显下降。我们对市场的看法要比之前更乐观一些,但我们也深知市场信心的重建仍然需要较长时间,反弹过程也可能是比较曲折的。我们仍然会将重点放在个股精选上,目前不少新兴行业中有核心竞争力、良好商业模式、优秀管理层的公司的发展仍然欣欣向荣,前景值得期待。我们相信新兴行业的新蓝筹的崛起不会就此中止,市场经过大幅调整也给了投资者一个更好的介入机会。

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	769,656,881.90	70.64
	其中:股票	769,656,881.90	70.64
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	314,471,262.83	28.86
8	其他资产	5,417,943.90	0.50
9	合计	1,089,546,088.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	462,757,515.06	42.74
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	40,451,776.54	3.74
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	103,518,642.44	9.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	50,632,844.69	4.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	941,323.92	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	49,080,393.57	4.53
R	文化、体育和娱乐业	62,274,385.68	5.75
S	综合	-	-
	合计	769,656,881.90	71.09

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	002665	首航节能	2,874,320	70,133,408.00	6.48
2	300041	回天新材	3,077,856	60,849,213.12	5.62
3	300244	迪安诊断	708,333	49,080,393.57	4.53
4	300171	东富龙	2,355,190	47,551,286.10	4.39
5	300144	宋城演艺	1,814,436	40,969,964.88	3.78
6	300017	网宿科技	749,848	39,524,488.08	3.65
7	300207	欣旺达	1,514,890	37,841,952.20	3.50
8	002215	诺普信	2,611,478	31,494,424.68	2.91
9	002657	中科金财	460,496	28,048,811.36	2.59
10	300409	道氏技术	669,922	27,466,802.00	2.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。

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
本基金本报告期末未持有债券投资。

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
云投生态于2014年5月15日至2014年10月16日陆续收到昆明市中级人民法院民事虚假责任纠纷86个案件的《应诉通知书》、《民事起诉状》及《云南省昆明市中级人民法院民事传票》。公司由于在《招股说明书》、2007年-2009年年报和半年报中虚增资产和虚增收入,被法院判决赔偿其中部分原告经济损失,判决公司法定代表人、董事长,以及时任财务总监承担连带赔偿责任。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2
基金投资的前十名股票未超出合同规定备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,134,519.19
2	应收证券清算款	2,172,066.05
3	应收股利	-
4	应收利息	59,959.29
5	应收申购款	2,051,399.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,417,943.90

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
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	756,320,481.83
报告期期间基金总申购份额	266,468,919.92
减:报告期期间基金总赎回份额	335,666,624.02
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	687,122,777.73

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	54,917.59
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	54,917.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.01

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	2015年7月15日	54,917.59	100,000.00	1.50%
合计			54,917.59	100,000.00	

注:本表交易日期为确认日期,交易金额为确认金额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业生态中国混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业生态中国混合型证券投资基金托管协议;
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。

8.2 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。

8.3 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
2015年10月27日

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

【2015】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:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业收益增长混合
基金主代码	240008
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月15日
报告期末基金份额总额	265,911,587.52份
投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,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。股票投资部分采用定量与定性分析相结合,行业配置与定期调整策略;债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-115,334,746.07
2.本期利润	-440,742,824.73
3.加权平均基金份额本期利润	-1.6253
4.期末基金资产净值	1,313,926,778.72
5.期末基金份额净值	4.9412

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。

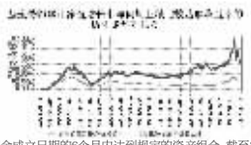
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-23.68%	3.54%	-19.96%	2.33%	-3.72%	1.21%

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
(2006年6月15日至2015年9月30日)



注: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2006年12月15日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		
闫旭	助理投资总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝行业精选混合基金经理、华宝稳健回报混合基金经理	2015年2月17日	-	15年	硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作,2004年10月至2010年7月任职于华宝兴业基金管理有限公司,先后任基金经理助理、基金经理的职务。2010年7月至2014年2月任纽银梅隆西部基金管理有限公司投资副总监兼基金经理,2014年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,现任助理投资总监,2015年3月起兼任国内投资部总经理。2014年7月起任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理,2015年3月兼任华宝兴业稳健回报混合型证券投资基金基金经理。
毛文博	本基金基金经理	2015年4月9日	-	5年	硕士。曾任智库合力管理咨询有限公司研究部研究员,2010年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理的职务。2015年4月起任宝兴业收益增长混合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 管理人对投资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、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,市场依旧处于泡沫破灭的大幅调整过程之中。上证综指当季度下跌28.63%,深成指下跌30.34%,创业板综指下跌28.13%。泡沫破灭阶段的卖出力量总是超乎市场想象。去杠杆的过程使市场需要更长的时间来自我修复。

在泡沫破灭阶段,本基金净值也不可避免的受到了较大损失。在操作方面,本基金在前期减持了部分估值较高的个股,买入了部分流动性较好的股票,保持了组合流动性。在三季度末,本基金适度增加了一些仓位,精选了部分下跌幅度较大的优秀个股。总体来讲,虽然对市场风险有比较清醒的预判,在操作上进行了避险,在结构上进行了调整,但不够极致和彻底,没有能够更大程度的避免损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为-23.68%,同期业绩比较基准收益率为-19.96%,基金表现落后于比较基准3.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管政策已进入放松周期,2015年下半年中国经济仍然面临比较严峻的挑战。从和种迹象上看,单纯的货币政策放松已经出现流动性陷阱的迹象。未来政策将会出现两种路径:一种是适应常态,政策缓慢托底。另一种是加大财政政策在政策组合中的作用。

证券市场方面,随着市场大幅下跌,市场机制正在缓慢修复。IPO的暂停、限制大股东减持,控制了市场的供给。需求方面,去杠杆带来的需求塌缩已度过最剧烈的阶段。伴随着市场的自我修复,短期具备操作空间。在货币政策持续宽松情况下,中长期走势取决于上市公司盈利状况的变化趋势。

基于以上判断,我们在操作上将更加积极,重点挑选前期调整幅度较大、业绩持续增长的优质标的。在板块方面,工业自动化、医药、电子、新能源等领域都是我们选股的重点。周期性板块方面,重点选择稳增长政策利好的地产等板块。

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	1,092,242,063.77	81.17
	其中:股票	1,092,242,063.77	81.17
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	235,768,470.65	17.52
8	其他资产	17,549,328.85	1.30
9	合计	1,345,559,863.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	27,173,461.70	2.07
B	采矿业	34,458,802.55	2.62
C	制造业	581,916,154.48	44.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,424,749.28	2.54
E	建筑业	18,629,780.84	1.42
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	37,388,263.27	2.85
J	金融业	75,569,985.47	5.75
K	房地产业	260,249,192.12	19.81
L	租赁和商务服务业	23,431,674.06	1.78
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	1,092,242,063.77	83.13

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	000024	招商地产	2,593,139	73,878,530.11	5.62
2	600048	保利地产	8,330,161	66,557,986.39	5.07
3	002308	威创股份	3,275,618	46,022,432.90	3.50
4	300038	梅泰诺	1,517,916	43,685,622.48	3.32
5	600266	北京城建	3,384,950	39,231,570.50	2.99
6	300230	永利带业	1,899,304	36,751,532.40	2.80
7	002531	天顺风能	3,737,943	36,482,323.68	2.78
8	002206	海利得	2,959,786	35,961,399.90	2.74
9	000002	万科A	2,533,062	32,245,879.26	2.45
10	002200	云投生态	1,799,567	27,173,461.70	2.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。

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
本基金本报告期末未持有债券投资。

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
云投生态于2014年5月15日至2014年10月16日陆续收到昆明市中级人民法院民事虚假责任纠纷86个案件的《应诉通知书》、《民事起诉状》及《云南省昆明市中级人民法院民事传票》。公司由于在《招股说明书》、2007年-2009年年报和半年报中虚增资产和虚增收入,被法院判决赔偿其中部分原告经济损失,判决公司法定代表人、董事长,以及时任财务总监承担连带赔偿责任。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2
基金投资的前十名股票未超出合同规定备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	987,505.93
2	应收证券清算款	16,016,439.37
3	应收股利	-
4	应收利息	48,114.68
5	应收申购款	497,268.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,549,328.85

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

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	300230	永利带业	36,751,532.40	2.80	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	296,028,774.40
报告期期间基金总申购份额	16,832,181.99
减:报告期期间基金总赎回份额	46,949,368.87
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	265,911,587.52

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	353,437.80
报告期期间买入/申购总份额	8,255.72
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	361,693.52
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.14

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	2015年7月15日	8,255.72	50,000.00	1.50%
合计			8,255.72	50,000.00	

交易日期为确认日期,交易金额为确认金额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业收益增长混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业收益增长混合型证券投资基金托管协议;
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。

8.2 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。

8.3 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
2015年10月27日

华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝稳健回报混合
基金主代码	000993
交易代码	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
报告期末基金份额总额	991,715,643.73份
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	1、大类资产配置策略 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。 2、股票投资策略 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。 3、固定收益类投资工具投资策略 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。 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。 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,运用股指期货对冲系统性风险及特殊情况下的流动性风险,以达到降低投资组合整体风险的目的。 6、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,基金管理人可根据法律法规及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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
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(2015年7月1日 -