# 华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

## 【2014】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:2014年10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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华宝兴业大盘精选股票 |
| 基金主代码 | 240011 |
| 交易代码 | 240011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年10月7日 |
| 报告期末基金份额总额 | 192,264,688.90份 |
| 投资目标 | 在控制风险的前提下,争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。 |
| 投资策略 | 本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景,注重价值挖掘,通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股,通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识,调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大至小排名在前1/3的股票。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。 |
| 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(2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,375,185.34 |
| 2.本期利润 | 26,820,711.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1234 |
| 4.期末基金资产净值 | 296,680,392.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5431 |

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。

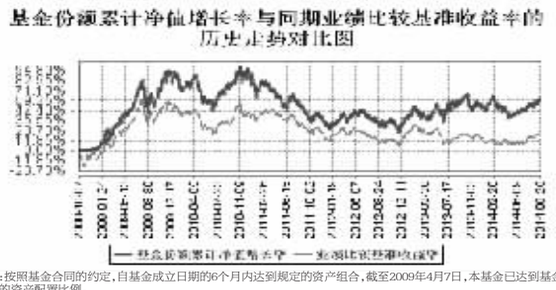
3.2 基金净值表现

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 | 8.94% | 0.83% | 10.72% | 0.72% | -1.78% | 0.11% |

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

(2008年10月7日至2014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2009年4月7日,本基金已达到基金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 | | |
| 范红兵 | 助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金基金经理、华宝兴业行业精选基金基金经理 | 2010年7月28日 | - | 14年 | 硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作,于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2014年6月任助理投资总监。 |
| 王智慧 | 助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理 | 2012年1月19日 | - | 13年 | 管理学博士。曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理和研究部总经理的职务,2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金的基金经理,2013年2月起兼任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2014年6月任助理投资总监。 |

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、《华宝兴业大盘精选股票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,本基金没有发现异常交易行为。

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

本报告期内,政府在坚持经济结构调整背景下,兼顾国民经济的中长期和短期发展的考虑,出台了一系列撬活实体经济的措施,包括货币的定量精准宽松、简化或取消政府审批手续、减免中小微企业的相关税负等。虽然三季度经济指标表现一般,但国内新增就业人数却保持良好势头,社会的诸多改革相继出台,如取消国民二元的户口制度等等。在国内强力反腐的高压下,国内的营商环境逐步得到净化,全民的发展和改革信心得到很大的恢复。由于国内房地产在过去十几年超常规的发展,在供求关系、相对高房价、价格上涨预期可能会产生反转变化的情况下,围绕房地产产业链的资金压力大,投资收益比吸引力的下降等加快了社会资本寻找可投资领域,此时此刻,股市的吸引力在明显增强,股市的赚钱效应也逐步开始显现。三季度,尽管IPO开闸了,但沪深股指出现了久违的量价齐升的可喜势头,创业板指数连创历史新高,中小板指数、上证指数、深成指等连创十几个月的新高。对医药行业来说,行业长期增长的内在因素未来不断有利于行业发展。

报告期间,由于相对看好市场和行业前景,本基金一直保持高仓位运行,相对看好中成药的成长性、医疗服务和医疗器械等子行业未来良好的发展前景,兼顾价值和成长的原则重点配置在中成药和医疗服务领域。

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8.76%,同期业绩比较基准收益率为10.42%,基金表现落后业绩基准1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为医药行业运行数据有望逐步好转。政策层面,我们认为下半年招标将加速推进;低价药政策将进入落实阶段;反商业贿赂将加速国产替代。另外影响增速的几个因素将逐步好转,如2013年底无菌制剂的新GMP认证对企业生产销售的影响、去年底GSP到期的流通企业在今年6月30日之前必须完成新版GSP认证导致流通渠道的去库存影响。

由于医药行业的稳定增长的长期性,沪深两市每年医药板块年底都可能发生医药股上市公司的估值切换行情,个人看好今年潜在的行业投资机会。与此同时,在国家鼓励创新背景下,我们将加大研究医药上市公司中研发型企业可能的投资机会。

本基金未来投资策略将集中在优化持仓结构,继续重点持有发展格局清晰、业绩增长明确、估值合理的细分领域龙头公司;同时增加一线蓝筹股的行业配置机会。

§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 | 269,753,246.26 | 88.44 |
| | 其中:股票 | 269,753,246.26 | 88.44 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 26,844,809.10 | 8.80 |
| 7 | 其他资产 | 8,408,037.94 | 2.76 |
| 8 | 合计 | 305,006,093.30 | 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 | 5,883,912.39 | 1.98 |
| B | 采矿业 | 6,555,858.45 | 2.21 |
| C | 制造业 | 186,742,824.43 | 62.94 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,513,591.22 | 0.51 |
| E | 建筑业 | 16,840,434.80 | 5.68 |
| F | 批发和零售业 | 10,025,198.70 | 3.38 |
| 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 | 6,367,927.98 | 2.15 |
| J | 金融业 | 16,711,461.00 | 5.63 |
| K | 房地产业 | 8,128,345.68 | 2.74 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,551,847.82 | 0.86 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 5,871,970.80 | 1.98 |
| 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 | 2,559,872.99 | 0.86 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 269,753,246.26 | 90.92 |

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 | 600820 | 隧道股份 | 2,065,868 | 12,601,794.80 | 4.25 |
| 2 | 002341 | 新纶科技 | 496,000 | 10,554,880.00 | 3.56 |
| 3 | 000816 | 江淮动力 | 1,720,000 | 10,509,200.00 | 3.54 |
| 4 | 600104 | 上汽集团 | 560,000 | 10,124,800.00 | 3.41 |
| 5 | 000028 | 国药一致 | 193,911 | 10,025,198.70 | 3.38 |
| 6 | 002038 | 双鹭药业 | 233,981 | 9,920,794.40 | 3.34 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 239,150 | 9,886,461.00 | 3.33 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 256,300 | 9,501,041.00 | 3.20 |
| 9 | 002690 | 美亚光电 | 182,911 | 8,278,551.86 | 2.79 |
| 10 | 600535 | 天士力 | 195,800 | 8,141,364.00 | 2.74 |

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。

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。

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

2013年10月14日中国平安公告其控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2013]48号),中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,585万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

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,认为该处罚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 | 117,487.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,233,756.86 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,597.40 |
| 5 | 应收申购款 | 51,196.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,408,037.94 |

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 | 002341 | 新纶科技 | 10,554,880.00 | 3.56 | 临时停牌 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 232,357,887.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,387,495.02 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 44,480,693.91 |
| 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 | 192,264,688.90 |

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 | 266,740.28 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 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 | 266,740.28 |
| 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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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;

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业大盘精选股票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

2014年10月24日

# 华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

## 【2014】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:2014年10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2014年10月22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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华宝兴业医药生物 |
| 基金主代码 | 240020 |
| 交易代码 | 240020 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年2月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 961,534,151.27份 |
| 投资目标 | 把握医药生物相关行业的投资机会,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,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。通过对医药生物相关行业的辨识,精选以及对医药生物行业相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中较高预期风险和预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |
| 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(2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 21,436,178.04 |
| 2.本期利润 | 107,486,465.83 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1052 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,278,273,853.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.329 |

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 | 8.76% | 0.90% | 10.42% | 0.65% | -1.66% | 0.25% |

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

(2012年2月28日至2014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2012年8月28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 | | |
| 范红兵 | 助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金基金经理、华宝兴业行业精选基金基金经理 | 2012年2月28日 | - | 14年 | 硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作,于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2014年6月任助理投资总监。 |
| 王智慧 | 助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理 | 2012年2月28日 | - | 13年 | 管理学博士。曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务,研究部总经理的职务,2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年2月起兼任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2014年6月任助理投资总监。 |

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、《华宝兴业医药生物优选股票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,本基金没有发现异常交易行为。

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

本报告期内,政府在坚持经济结构调整背景下,兼顾国民经济的中长期和短期发展的考虑,出台了一系列撬活实体经济的措施,包括货币的定量精准宽松、简化或取消政府审批手续、减免中小微企业的相关税负等。虽然三季度经济指标表现一般,但国内新增就业人数却保持良好势头,社会的诸多改革相继出台,如取消国民二元的户口制度等等。在国内强力反腐的高压下,国内的营商环境逐步得到净化,全民的发展和改革信心得到很大的恢复。由于国内房地产在过去十几年超常规的发展,在供求关系、相对高房价、价格上涨预期可能会产生反转变化的情况下,围绕房地产产业链的资金压力大,投资收益比吸引力的下降等加快了社会资本寻找可投资领域,此时此刻,股市的吸引力在明显增强,股市的赚钱效应也逐步开始显现。三季度,尽管IPO开闸了,但沪深股指出现了久违的量价齐升的可喜势头,创业板指数连创历史新高,中小板指数、上证指数、深成指等连创十几个月的新高。对医药行业来说,行业长期增长的内在因素未来不断有利于行业发展。

报告期间,由于相对看好市场和行业前景,本基金一直保持高仓位运行,相对看好中成药的成长性、医疗服务和医疗器械等子行业未来良好的发展前景,兼顾价值和成长的原则重点配置在中成药和医疗服务领域。

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8.76%,同期业绩比较基准收益率为10.42%,基金表现落后业绩基准1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为医药行业运行数据有望逐步好转。政策层面,我们认为下半年招标将加速推进;低价药政策将进入落实阶段;反商业贿赂将加速国产替代。另外影响增速的几个因素将逐步好转,如2013年底无菌制剂的新GMP认证对企业生产销售的影响、去年底GSP到期的流通企业在今年6月30日之前必须完成新版GSP认证导致流通渠道的去库存影响。

由于医药行业的稳定增长的长期性,沪深两市每年医药板块年底都可能发生医药股上市公司的估值切换行情,个人看好今年潜在的行业投资机会。与此同时,在国家鼓励创新背景下,我们将加大研究医药上市公司中研发型企业可能的投资机会。

本基金未来投资策略将集中在优化持仓结构,继续重点持有发展格局清晰、业绩增长明确、估值合理的细分领域龙头公司;同时增加一线蓝筹股的行业配置机会。

§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 | 1,184,156,571.96 | 90.71 |
| | 其中:股票 | 1,184,156,571.96 | 90.71 |
| 2 | 固定收益投资 | 30,254,894.90 | 2.32 |
| | 其中:债券 | 30,254,894.90 | 2.32 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 65,968,444.82 | 5.05 |
| 7 | 其他资产 | 25,086,730.97 | 1.92 |
| 8 | 合计 | 1,305,466,642.65 | 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 | 1,012,975,331.29 | 79.25 |
| 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 | 142,834,959.35 | 11.17 |
| 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 | - | - |
| 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 | 28,346,281.32 | 2.22 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,184,156,571.96 | 92.64 |

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 | 300147 | 香雪制药 | 4,820,045 | 109,366,821.05 | 8.56 |
| 2 | 600511 | 国药股份 | 1,608,480 | 43,348,536.00 | 3.39 |
| 3 | 600267 | 海正药业 | 2,343,501 | 40,261,347.18 | 3.15 |
| 4 | 300298 | 三诺生物 | 965,302 | 40,137,257.16 | 3.14 |
| 5 | 600594 | 益佰制药 | 1,011,348 | 37,925,550.00 | 2.97 |
| 6 | 000028 | 国药一致 | 717,503 | 37,094,905.10 | 2.90 |
| 7 | 300026 | 红日药业 | 1,154,976 | 33,875,446.08 | 2.65 |
| 8 | 002022 | 科华生物 | 1,217,519 | 32,799,961.86 | 2.57 |
| 9 | 002001 | 新和成 | 1,999,440 | 30,151,555.20 | 2.36 |
| 10 | 300204 | 舒泰神 | 1,160,155 | 29,305,515.30 | 2.29 |

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 | 30,015,000.00 | 2.35 |
| | 其中:政策性金融债 | 30,015,000.00 | 2.35 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 239,894.90 | 0.02 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 30,254,894.90 | 2.37 |

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 | 130243 | 13国开43 | 300,000 | 30,015,000.00 | 2.35 |
| 2 | 128002 | 东华转债 | 1,660 | 239,894.90 | 0.02 |

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 | 334,985.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 21,814,052.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,295,208.15 |
| 5 | 应收申购款 | 1,642,484.74 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,086,730.97 |

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 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 128002 | 东华转债 | 239,894.90 | 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 974,922,030.11 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 215,429,642.03 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 228,817,520.87 |
| 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 | 961,534,151.27 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,026,541.76 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 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 | 1,026,541.76 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.11 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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;

华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业医药生物优选股票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

2014年10月24日

# 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

## 【2014】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:2014年10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2014年10月22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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华宝兴业新兴产业股票 |
| 基金主代码 | 240017 |
| 交易代码 | 240017 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月7日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,731,384,630.48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 | 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产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辨识,精选以及对新兴产业相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享新兴产业发展所带来的较高回报。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 75%中证新