华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

【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	华宝兴业宝康配置混合
基金主代码	240002
交易代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15日
报告期末基金份额总额	479,511,465.24份
投资目标	规避系统风险,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略,以债券投资为基础,并把握股市重大投资机会,获取超额回报,同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准	65%中信标普全债指数+35%上证180指数和深证100指数的复合指数。 复合指数=(上证180流通市值/成分指数总流通市值)×上证180指数+(深证100流通市值/成分指数总流通市值)×深证100指数 成分指数总流通市值=上证180流通市值+深证100流通市值
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	18,839,608.83
2.本期利润	56,792,831.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.1142
4.期末基金资产净值	681,128,797.09
5.期末基金份额净值	1.4205

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。

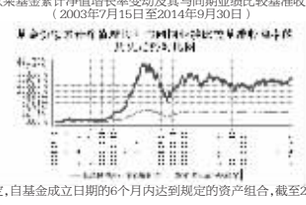
3.2 基金净值表现

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	8.78%	0.52%	5.55%	0.36%	3.23%	0.16%

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

(2003年7月15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2004年1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		
郭鹏飞	投资副总监,国内投资部总经理,本基金基金经理,华宝兴业新兴产业基金基金经理	2010年6月26日	-	10年	博士,拥有CFA资格。2004年2月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师,2007年9月任公司研究部副总经理,2009年3月至2010年6月任公司研究部总经理,2010年6月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年12月起兼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月起任国内投资部总经理,2014年6月任投资副总监。
季鹏	本基金基金经理	2013年8月27日	-	8年	硕士,拥有CFA资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理工作。2011年4月加入华宝兴业基金管理有限公司任高级策略分析师兼基金经理助理的职务。2013年8月起任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。
胡戈游	本基金基金经理,华宝兴业宝康消费品基金基金经理	2013年7月25日	-	9年	硕士,拥有CFA资格。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师,国内投资部基金经理助理的职务,2009年5月至2010年6月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年1月至2012年1月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2011年2月起任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业宝康灵活配置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、《华宝兴业宝康系列开放式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评当日成交量的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

回顾2014年三季度,在国内经济总体平稳的背景下,A股市场大幅反弹。2014年三季度,上证指数上涨15.4%,深成指上涨10.04%,沪深300上涨13.2%,中小板指数上涨16.9%,创业板指数上涨9.69%。板块上,国防军工、农林牧渔、交通运输、基础化工、商贸零售等板块涨幅靠前,银行、石油石化、传媒等板块涨幅靠后,总体而言,小市值股票总体表现较好,而大市值股票表现较差,但各个板块都录得明显正收益,市场赚钱效益明显,热点层出不穷。目前,多数基金都比较偏向专注于投资代表中国经济转型成功的少数新兴和消费行业,并集中持有此类公司股票,忽视传统的周期行业和风格轮动的趋势非常明显,从而造成业绩差距明显。

我们在今年三季度总体积极操作,维持较高仓位,并灵活投资了所持有的中小市值股票,在个股选择上明显偏向于转型和小市值公司,但是由于大部分仓位所投资的沪深300组合表现弱于个股,使得总体业绩表现处于市场中游。

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8.78%,同期业绩比较基准收益率为5.55%,基金表现领先于业绩比较基准3.23%。

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2014年四季度,在固定资产投资和房地产销售下滑趋势下,中国经济增速将继续走弱态势,在此背景下,这些传统行业难以有趋势性表现。正面因素是近期国家在货币政策放松上已经明显转向,而保投资和保增长的举措也频频出手,预计经济能保持目前的稳定状态,经济增速大幅提高或者降低恐怕短期都不可能。预计在此背景下,由于目前A股上市公司普遍存在着自下而上的改革和创新意识,而这种变革力量目前正成为股市最主要的上涨动力,预计这种正面力量仍将持续推动市场上涨。

因此,预计在2014年余下时间内,我们计划在操作上总体保持对个股积极,根据宏观经济和流动性情况灵活地把握指数的投资机会,关注改革红利和企业转型创新所带来的投资机会;而对于主动部分的个股选择将更加倾向于严格把关,操作上更加灵活,把握合理的估值安全边际和企业质地,但是由于目前中国经济正处在关键的转型期,就长期而言,我们仍愿意给与这些代表中国转型方向的行业更多的关注和权重,我们也坚信中国转型成功所带来的巨大投资机会;在三季度我们积极加仓,已经将仓位水平提高到较高的水平,预计四季度仍将延续目前的较高仓位和积极操作。

过去两年中,由于受制于本基金契约限制,本基金并不能在大幅上涨的创业板中过多持仓,作为基金管理人,我们也感到比较遗憾,但我们一直坚持稳健长期的投资观念,坚持长期看多经济转型的方向,预计在下阶段投资中,争取在契约允许的最大范围内,持仓中继续加大这些代表中国长期转型机遇的投资品种,精挑个股,更加努力地为本基金持有者带来持续回报,再次感谢广大持有人一直以来的信任。

§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	494,302,018.28	71.69
	其中:股票	494,302,018.28	71.69
2	固定收益投资	166,650,018.00	24.17
	其中:债券	166,650,018.00	24.17
	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	21,976,578.35	3.19
7	其他资产	6,531,298.13	0.95
8	合计	689,459,912.76	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	1,101,427.62	0.16
B	采矿业	30,393,123.28	4.46
C	制造业	234,213,805.13	34.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,691,262.80	1.57
E	建筑业	9,449,398.49	1.39
F	批发和零售业	7,226,725.33	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	7,841,004.32	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,072,954.33	12.93
J	金融业	82,105,500.75	12.05
K	房地产业	12,593,374.72	1.85
L	租赁和商务服务业	2,257,415.18	0.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,114,091.07	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,808,342.10	0.41
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,212,408.12	0.32
S	综合	1,221,185.04	0.18
	合计	494,302,018.28	72.57

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

代码	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	300271	华宇软件	279,015	13,638,253.20	2.00
2	300207	欣旺达	392,719	12,932,236.67	1.90
3	300229	拓尔思	469,860	12,930,547.20	1.90
4	300285	国瓷材料	319,061	12,810,299.15	1.88
5	300183	东软载波	229,864	12,111,534.16	1.78
6	000939	凯迪电力	1,339,940	12,059,460.00	1.77
7	002358	森源电气	370,123	11,436,800.70	1.68
8	300263	隆华节能	662,211	11,158,255.35	1.64
9	002551	尚荣医疗	370,000	10,034,400.00	1.47
10	002401	中海科技	398,900	9,098,909.00	1.34

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	26,469,018.00	3.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,181,000.00	20.58
	其中:政策性金融债	140,181,000.00	20.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	166,650,018.00	24.47

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	140204	14国开04	300,000	30,072,000.00	4.42
2	140207	14国开07	300,000	30,069,000.00	4.41
3	140410	14农发10	300,000	30,048,000.00	4.41
4	110418	11农发18	300,000	29,982,000.00	4.40
5	010107	21国债(7)	260,010	26,469,018.00	3.89

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	347,565.19
2	应收证券清算款	1,543,879.47
3	应收股利	-
4	应收利息	4,574,765.33
5	应收申购款	65,088.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,531,298.13

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

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	300207	欣旺达	12,932,236.67	1.90	重大事项停牌
2	300183	东软载波	12,111,534.16	1.78	重大事项停牌
3	000939	凯迪电力	12,059,460.00	1.77	重大资产重组
4	002358	森源电气	11,436,800.70	1.68	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	
	511,369,190.94
报告期期间基金总申购份额	2,308,047.95
减:报告期期间基金总赎回份额	34,165,773.65
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	479,511,465.24

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	436,169.25
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	436,169.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.09

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;

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同;

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书;

华宝兴业宝康系列开放式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

华宝兴业宝康消费品证券投资基金

【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	华宝兴业宝康消费品混合
基金主代码	240001
交易代码	240001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15日
报告期末基金份额总额	1,074,888,724.98份
投资目标	分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长;为基金份额持有人谋求长期稳定回报。
投资策略	本基金看好消费品的发展前景,长期持有消费品组合,并注重资产在其各相关行业的配置,适当进行时机选择。
业绩比较基准	上证180指数和深证100指数的复合指数×80%+中信标普全债指数×20%。 复合指数=(上证180流通市值/成分指数总流通市值)×上证180指数+(深证100流通市值/成分指数总流通市值)×深证100指数 成分指数总流通市值=上证180流通市值+深证100流通市值。
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	54,806,703.10
2.本期利润	132,541,987.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.1173
4.期末基金资产净值	1,872,946,977.52
5.期末基金份额净值	1.7425

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。

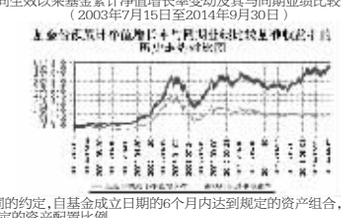
3.2 基金净值表现

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	7.43%	0.85%	10.65%	0.72%	-3.22%	0.13%

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

(2003年7月15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2004年1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		
胡戈游	本基金基金经理,华宝兴业宝康灵活配置基金基金经理	2011年2月11日	-	9年	硕士,拥有CFA资格。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师,华宝兴业宝康灵活配置基金基金经理助理的职务,2009年5月至2010年6月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年1月至2012年1月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2011年2月起兼任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业宝康灵活配置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、《华宝兴业宝康系列开放式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评当日成交量的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

2014年三季度经济数据和信贷数据并不理想,但代表着消费需求的社会消费品零售总额增速整体稳定,1-8月累计增速为12.1%,消费领域仍然具备持续的投资机会。基于对改革的预期和沪港通的催化,股票市场三季度整体向好,本基金维持仓位的稳定,持有优质消费类股票,主要投资于代表新经济方向的传媒、计算机、新能源汽车,以及需求相对稳定的医药、食品饮料等行业。报告期内持仓个股表现较好。

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7.43%,同期业绩比较基准收益率为10.65%,基金表现落后于基准3.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为稳增长和微刺激的政策将保障经济整体平稳,但经济转型的方向不会改变。传统行业增速缓慢,估值承压,新兴产业景气度高,行业分化严重,我们预期未来一段时间,股市依然表现为结构化的行情,受益于结构调整的行业和转型成功的企业在获得高成长的同时,也将享受估值的溢价,股价会有较好表现。

本基金继续看好消费领域的投资机会,经济结构转型的核心还是消费,扩大内需仍是解决中国经济结构失衡的最好方法。基于人口结构的变化和新兴消费的趋势,下阶段我们看好以下几个领域的投资机会:受益互联网盛宴的文化影视、游戏、数字营销、在线教育、软件服务等各个板块;受益于城镇化趋势的大众快消品;长期稳定增长的医疗行业;政策推动的新能源汽车和环保行业。我们会在这几个行业中优中选优,继续寻找和持有优质公司。

感谢持有人一直以来对我们的支持,在后续投资中,我们将继续总结经验,勤勉尽责,努力实现消费品基金的良好表现。

§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	1,291,809,529.08	68.32
	其中:股票	1,291,809,529.08	68.32
2	固定收益投资	411,746,000.00	21.78
	其中:债券	411,746,000.00	21.78
	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	166,306,432.10	8.80
7	其他资产	20,892,692.89	1.10
8	合计	1,890,754,654.07	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	417,897,743.95	22.31
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	26,559,000.00	1.42
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	402,066,042.25	21.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	12,791,483.64	0.68
L	租赁和商务服务业	247,570,000.00	13.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	92,805,092.64	4.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,933,500.00	2.19
R	文化、体育和娱乐业	51,186,666.60	2.73
S	综合	-	-
	合计	1,291,809,529.08	68.97

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	300058	蓝色光标	6,100,000	147,010,000.00	7.85
2	002400	省广股份	4,000,000	100,560,000.00	5.37
3	002065	东华软件	4,400,000	92,004,000.00	4.91
4	300315	掌趣科技	4,300,000	83,291,000.00	4.45
5	300144	宋城演艺	2,500,000	66,750,000.00	3.56
6	300339	润和软件	2,385,000	60,960,600.00	3.25
7	600066	宇通客车	2,900,000	52,867,000.00	2.82
8	000848	承德露露	1,904,868	41,868,998.64	2.24
9	600446	金证股份	1,000,000	41,230,000.00	2.20
10	600587	新华医疗	1,100,000	41,151,000.00	2.20

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	411,746,000.00	21.98
	其中:政策性金融债	411,746,000.00	21.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	411,746,000.00	21.98

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	140201	14国开01	800,000	82,096,000.00	4.38
2	140410	14农发10	500,000	50,080,000.00	2.67
3	130428	13农发28	500,000	50,030,000.00	2.67
4	110418	11农发18	500,000	49,970,000.00	2.67
5	140213	14国开13	500,000	49,930,000.00	2.67

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	270,838.31
2	应收证券清算款	7,751,304.13
3	应收股利	-
4	应收利息	12,040,846.97
5	应收申购款	829,703.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,892,692.89

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	002065	东华软件	92,004,000.00	4.91	重大资产重组
2	300315	掌趣科技	83,291,000.00	4.45	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,111,056,275.94
报告期期间基金总申购份额	81,935,550.86
减:报告期期间基金总赎回份额	118,103,101.82
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	1,074,888,724.98

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	1,917,552.18
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	1,917,552.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.18

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;

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同;

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书;

华宝兴业宝康系列开放式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

华宝兴业宝康债券投资基金

【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	华宝兴业宝康债券
基金主代码	240003
交易代码	240003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15日
报告期末基金份额总额	261,033,647.00份
投资目标	在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金财产安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用类属配置、久期偏离、收益率曲线配置和特定券种选择等积极投资策略,并把握市场创新机会。