华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

【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	283,769,884.89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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,598,046.63
2.本期利润	-113,598,150.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3949
4.期末基金资产净值	521,914,484.72
5.期末基金份额净值	1.8392

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。

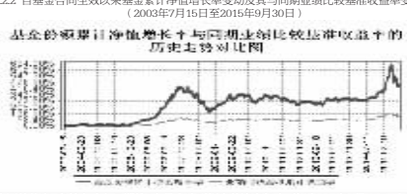
3.2 基金净值表现

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	-17.20%	1.84%	-9.16%	1.17%	-8.04%	0.67%

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		
季鹏	本基金基金经理、华宝国策导向混合基金经理、华宝兴业先进成长混合型基金经理	2013年8月27日	-	9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。2015年5月起任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理,2015年5月起任华宝兴业先进成长混合型证券投资基金的基金经理。
胡戈游	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业宝康消费品基金基金经理、华宝品质生活股票基金经理	2013年7月25日	-	10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,2015年1月兼任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。2015年3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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》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。

由于部分持有债券到期,宝康灵活配置证券投资基金在知期内出现过投资于股票、债券占基金资产净值比低于80%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

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

自2015年六月下旬开始,A股市场上演了一轮快速上涨后暴跌的行情,整个三季度,A股出现了一轮历史罕见的快速巨幅下跌。三季度中,沪深300下跌28.39%,上证指数下跌28.63%,中小板指数下跌26.57%,创业板指数下跌27.14%,自六月中旬以来,创业板指数下跌幅度最大,中小市值和创业板股票跌幅靠前。此轮市场下跌的背后主要原因仍是此前股票涨幅和融资盘积累过大导致,市场走势转变之后,市场情绪由此前的极度亢奋迅速转变成极度恐慌。

回顾六月份以来的操作,本基金在市场高位处逢高减持,降低仓位,整个三季度都基本维持了四成左右仓位,而跌幅较大的创业板持仓较少。预计未来我们将坚持大小盘兼顾的投资策略,保持本基金操作灵活、追求长期稳健收益的目标。经过此前大幅下跌,市场的风险已经得到大幅的释放,市场已经进入了可以操作的阶段,预计未来我们的操作将越来越积极。

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-17.20%,同期业绩比较基准收益率为-9.16%,基金表现落后于比较基准8.04%。

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2015年四季度,我们仍然对以创业板代表的新兴产业板块保持乐观态度。尽管中国经济整体增速在缓慢放缓,但经济结构调整的方向日益明显,互联网经济、环保、消费升级、医疗养老等产业方向正在蓬勃发展,这些行业的长期前景依然乐观。就市场而言,A股二季度市场的非理性繁荣在三季度以暴风骤雨般的下跌而结束,市场正在缓慢进入理性阶段,长期的投资机会逐渐增加。

就长期而言,我们对中国经济转型所带来的投资前景充满信心,但就未来一段时期国内的经济环境而言,形势依然复杂:固定资产投资增速放缓、房地产泡沫以及人民币汇率等问题依然是宏观决策的核心问题;但宽松的货币政策环境和中央政府经济改革的决心又使得投资者感到某种欣慰。预计在种种利多和利空的纠结之中,市场仍可能大幅波动,在下阶段完成建仓期之后,我们将继续保持此前小心谨慎的投资风格,仓位较为灵活;标的选择上将紧密跟踪各行业景气度变化,精选优秀的公司并长期持有,分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。本基金将继续保持本基金一贯的灵活操作风格,以追求基金长期稳定业绩。感谢基金持有人一直以来对我们的支持,我们将继续勤勉尽责,努力为持有人创造好的回报。

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	231,263,515.10	43.64
	其中:股票	231,263,515.10	43.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	194,925,000.00	36.78
	其中:债券	194,925,000.00	36.78
	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	99,924,790.31	18.86
8	其他资产	3,824,358.79	0.72
9	合计	529,937,664.20	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	429,150.93	0.08
B	采矿业	7,171,270.86	1.37
C	制造业	87,904,616.24	16.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,250,647.05	1.20
E	建筑业	8,198,727.74	1.57
F	批发和零售业	9,276,533.56	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	5,860,991.06	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,074,793.96	2.70
J	金融业	63,230,543.67	12.12
K	房地产业	9,696,241.58	1.86
L	租赁和商务服务业	12,788,260.18	2.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,454,687.72	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	208,405.60	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,279,524.57	0.44
S	综合	439,120.38	0.08
	合计	231,263,515.10	44.31

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	002206	海利得	836,400	10,162,260.00	1.95
2	600036	招商银行	484,719	8,613,456.63	1.65
3	601318	中国平安	260,486	7,778,111.96	1.49
4	002172	澳洋科技	900,000	6,948,000.00	1.33
5	002707	众信旅游	159,898	6,288,788.34	1.20
6	600172	黄河旋风	430,398	6,249,378.96	1.20
7	002649	博彦科技	149,977	6,134,059.30	1.18
8	600016	民生银行	717,821	6,065,587.45	1.16
9	600000	浦发银行	330,720	5,499,873.60	1.05
10	603368	柳州医药	80,000	5,418,400.00	1.04

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	53,335,000.00	10.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,590,000.00	27.13
	其中:政策性金融债	141,590,000.00	27.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	194,925,000.00	37.35

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	010107	21国债(7)	500,000	53,335,000.00	10.22
2	110314	11进出14	300,000	30,453,000.00	5.83
3	018001	国开1301	300,000	30,273,000.00	5.80
4	150206	15国开06	300,000	30,201,000.00	5.79
5	150408	15农发08	200,000	20,270,000.00	3.88

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

中国平安控股公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")于2014-12-8收到《中国证监会行政处罚决定书》(2014)103号,处罚原因是平安证券出具的保荐书存在虚假记载,且未审慎核查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性。中国证券监督管理委员会决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2,867万元,并处以440万元罚款。

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	261,235.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,561,027.27
5	应收申购款	1,976.28
6	其他应收款	120.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,824,358.79

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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	303,288,901.98
报告期期间基金总申购份额	4,905,196.04
减:报告期期间基金总赎回份额	24,424,213.13
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	283,769,884.89

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	314,174.94
报告期期间买入/申购总份额	9,564.36
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	323,739.30
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

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	9,564.36	20,000.00	1.20%
合计			9,564.36	20,000.00	

注:交易日期为确认日期,交易金额为确认金额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年9月28日发布《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金修改业绩比较基准并相应修改基金合同的公告》,决定自2015年10月1日起修改本基金业绩比较基准为"中证综合债指数收益率×65%+沪深300指数收益率×35%"。

§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。

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
2015年10月27日

华宝兴业宝康消费品证券投资基金

【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	646,888,537.78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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-61,994,035.50
2.本期利润	-344,740,247.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5295
4.期末基金资产净值	1,440,671,635.67
5.期末基金份额净值	2.2271

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	-18.47%	3.39%	-22.56%	2.66%	4.09%	0.73%

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	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业宝康灵活配置基金基金经理、华宝品质生活股票基金经理	2011年2月11日	-	10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,2010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,2015年1月兼任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。2015年3月起任助理投资总监。

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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》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

三季度市场继续走弱,上证指数累计下跌28.6%,创业板指数下跌27.14%。我们判断短期经济基本面存在低于预期的风险,因此本基金操作策略上较为谨慎,继续减持了高估值高弹性的个股,转而增持了基本面良好且有业绩支撑的个股。目前基金主要配置了具有成长性的消费领域。

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-18.47%,同期业绩比较基准收益率为-22.56%,基金表现领先于比较基准4.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计经济仍处于触底企稳的过程中,经济增速依然处于放缓的态势。股市经历了去杠杆的阵痛后,后期市场注意力会更多的放在行业和个股的基本面研究。我们后期重点关注几类投资机会,一是行业景气度高,能抵御经济周期波动,未来几年依然能保持较快增长的板块,比如受益于消费升级的休闲旅游行业,受益于新兴消费快速发展的娱乐传媒行业,受益于老龄化的医疗服务业;二是关注那些能够抓住经济转型的机会,积极创新,并有实力转型成功的企业,经过这轮股市系统性的下跌,个股高估值的风险得到有效释放,后期市场会分化,有核心竞争力,创新能力强,管理层优秀的企业会脱颖而出,结构上会更加集中于成长型行业的优质企业;三是寻找市场新的热点,把握好主题性的投资机会。

展望未来,我们看好中国经济由投资驱动向消费驱动转型的趋势。基于人口结构的变化和新兴消费的趋势我们认为消费行业的成长空间依然巨大,我们将继续寻找并持有优质公司。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。

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	1,057,506,312.84	71.40
	其中:股票	1,057,506,312.84	71.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	333,550,000.00	22.52
	其中:债券	333,550,000.00	22.52
	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	82,725,176.69	5.59
8	其他资产	7,345,040.90	0.50
9	合计	1,481,126,530.43	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	350,643,338.68	24.34
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	92,846,166.00	6.44
G	交通运输、仓储和邮政业	22,440,000.00	1.56
H	住宿和餐饮业	26,400,000.00	1.83
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,584,197.50	2.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	253,390,399.14	17.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,375,919.92	1.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,290,000.00	4.81
R	文化、体育和娱乐业	185,536,291.60	12.88
S	综合	-	-
	合计	1,057,506,312.84	73.40

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	300144	宋城演艺	3,800,000	85,804,000.00	5.96
2	300244	迪安诊断	1,000,000	69,290,000.00	4.81
3	002400	省广股份	3,500,000	63,910,000.00	4.44
4	300058	蓝色光标	5,500,000	58,685,000.00	4.07
5	600138	中青旅	2,599,902	52,258,030.20	3.63
6	300133	华策影视	2,100,836	51,260,398.40	3.56
7	300041	回天新材	2,300,000	45,471,000.00	3.16
8	002589	瑞康医药	1,300,000	41,405,000.00	2.87
9	002488	金固股份	2,000,000	38,700,000.00	2.69
10	600612	老凤祥	800,872	37,096,391.04	2.57

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	10,667,000.00	0.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	322,883,000.00	22.41
	其中:政策性金融债	322,883,000.00	22.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	333,550,000.00	23.15

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	140432	14农发32	500,000	50,660,000.00	3.52
2	140431	14农发31	500,000	50,615,000.00	3.51
3	120316	12进出16	500,000	50,040,000.00	3.47
4	150413	15农发13	500,000	49,980,000.00	3.47
5	070218	07国开18	300,000	30,783,000.00	2.14

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	987,483.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,278,050.66
5	应收申购款	79,506.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,345,040.90

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

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	300058	蓝色光标	58,685,000.00	4.07	重大事项停牌
2	002589	瑞康医药	41,405,000.00	2.87	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	684,533,801.73
报告期期间基金总申购份额	49,797,797.77
减:报告期期间基金总赎回份额	87,443,061.72
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	646,888,537.78

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	770,718.49
报告期期间买入/申购总份额	119,934.73
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	890,653.22
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	119,934.73	300,000.00	1.20%
合计			119,934.73	300,000.00	

注:交易日期为确认日期,交易金额为确认金额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年9月28日发布《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金修改业绩比较基准并相应修改基金合同的公告》,决定自2015年10月1日起修改本基金业绩比较基准为"沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%"。

§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