华宝兴业医药生物优选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	华宝医药生物混合
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	540,558,397.33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	47,534,389.60
2.本期利润	-266,996,486.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4730
4.期末基金资产净值	821,805,507.14
5.期末基金份额净值	1.520

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。

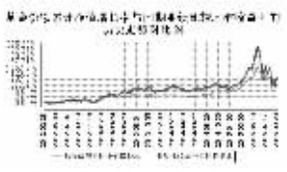
3.2 基金净值表现

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	-24.30%	3.91%	-18.85%	2.91%	-5.45%	1.00%

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、华宝行业精选混合基金经理	2012年2月28日	-	15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混合型证券投资基金基金经理,2010年7月至2014年10月任华宝兴业大盘精选混合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混合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混合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、华宝大盘精选混合基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2012年2月28日	-	14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混合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混合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

本报告期内,沪深两市经历了罕见的大幅快速下跌走势,尤其是创业板和中小板在上半年大幅上涨累积高估值和高泡沫风险过大的情况下,场外配资去杠杆化等一系列清查行为,短时间内导致快速的下跌以及短期流动性问题等富集效应,千股跌停不断地发展,恐慌情绪不断加大,后期随着国家维稳措施的出台,市场缓慢趋于平稳。本基金由于前期仓位偏高,虽然后期大幅减低仓位,但净值的下跌幅度不小,期间本基金通过一定仓位的波段操作和结构调整取得了一定的正收益,部分弥补了损失。由于本基金在上半年对高泡沫和题材炒作的个股配置不多,坚持长期基本面和真正价值股投资思路,截至前三个季度收益尚可。

报告期间,由于对市场的相对谨慎和行业增速下降的预期,本基金一直在适中的仓位运行,适度降低了医药行业中新兴技术和题材股的配置,增加业绩确定性一线龙头股的配置,效果不错。

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-24.30%,同期业绩比较基准收益率为-18.85%,基金表现落后于业绩基准5.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望年底或跨年度行情,由于市场非理性的杠杆风险因素已基本清理完成,在国家维稳和金融安全的背景下,市场未来将可能保持相对平稳的运行态势,如果以跨年度估值看,已经出现了一批估值合理、业绩增长比较确定的公司,未来本基金将保持适度积极的心态灵活地操作本基金,争取好的收益。本基金将始终坚持以公司基本面和安全边际作为主要考虑指标,以较强的成长性来选择优秀好公司。

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	720,320,885.18	87.15
	其中:股票	720,320,885.18	87.15
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	105,173,444.65	12.72
8	其他资产	1,024,143.42	0.12
9	合计	826,518,473.25	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	573,468,742.69	69.78
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	53,900,737.95	6.56
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	24,701,234.94	3.01
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	21,324,000.00	2.59
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	46,926,169.60	5.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	720,320,885.18	87.65

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	3,782,809	65,631,736.15	7.99
2	600276	恒瑞医药	1,102,845	50,940,410.55	6.20
3	300298	三诺生物	804,989	23,787,424.95	2.89
4	300273	和佳股份	1,214,219	23,422,284.51	2.85
5	002022	科华生物	1,028,800	22,252,944.00	2.71
6	300142	沃森生物	795,228	22,011,911.04	2.68
7	600645	中源协和	400,000	21,324,000.00	2.59
8	002223	鱼跃医疗	617,963	20,757,377.17	2.53
9	300009	安科生物	832,773	18,162,779.13	2.21
10	000963	华东医药	254,105	17,749,234.25	2.16

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

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	333,290.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,787.15
5	应收申购款	669,065.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,024,143.42

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	300142	沃森生物	22,011,911.04	2.68	重大事项停牌
2	600645	中源协和	21,324,000.00	2.59	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	521,030,486.87
报告期期间基金总申购份额	178,522,218.20
减:报告期期间基金总赎回份额	158,994,307.74
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	540,558,397.33

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	246,497.76
报告期期间买入/申购总份额	272,666.19
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	519,163.95
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.10

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	272,666.19	500,000.00	1.20%
合计			272,666.19	500,000.00	

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:

华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业医药生物优选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

华宝兴业行业精选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	华宝行业精选混合
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14日
报告期末基金份额总额	2,585,089,711.96份
投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率。
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	-65,727,246.59
2.本期利润	-1,147,959,077.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4343
4.期末基金资产净值	3,520,221,038.46
5.期末基金份额净值	1.3617

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。

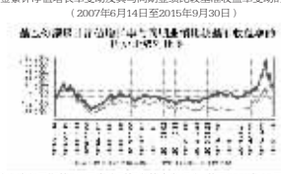
3.2 基金净值表现

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	-23.16%	3.51%	-28.39%	3.34%	5.23%	0.17%

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

(2007年6月14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2007年12月14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、华宝医药生物混合基金经理	2013年7月25日	-	15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混合型证券投资基金基金经理,2010年7月至2014年10月任华宝兴业大盘精选混合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混合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混合型证券投资基金基金经理。2014年6月任助理投资总监。
闫旭	助理投资总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业收益增长混合基金经理、华宝稳健回报混合基金经理	2014年7月9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。

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、《华宝兴业行业精选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

前三季度市场整体行情震荡较大,各指数在前5个月基本保持稳定向上,期间上证指数上涨42.57%,深证成指上涨46.17%,沪深300上涨36.99%,中小板指数上涨100.91%,创业板指数上涨140.72%。但进入6月中旬后,各指数开始大幅度调整:期间上证指数下跌33.8%,深证成指下跌37.96%,沪深300下跌33.83%,中小板指数下跌38.21%,创业板指数下跌41.21%。政策上对于杠杆资金的整体压制,IPO及再融资对资金需求不断加大等因素共同导致二季度后期的市场恐慌性下跌。整体来看,景气度向上及受益于改革红利的行业和公司表现相对稳健。

本基金根据市场环境的变化,在不同阶段采取了相应的投资策略。前5个月的单边上涨市里,公司对互联网、传媒、计算机等新兴产业的配置比重较高。6月后的单边下滑市中适度降低了仓位,对需求相对稳定的航空、影视、家电、电子等行业保持了一定的仓位,同时也阶段性参与了新能源汽车、国企改革等主题性投资机会。

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-23.16%,同期业绩比较基准收益率为-28.39%,基金表现领先于比较基准5.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计宏观经济仍然处于触底企稳的过程中,经济整体增速放缓的态势不变,但在政策调控下,经济结构已经在逐步调整。中期来看,通胀预计将继续保持在低位,但受全球经济的影响,汇率波动、美联储加息等扰动因素在增多。我们仍然维持资本市场流动性相对充裕的观点,但需要仔细分析和比较资金供需面的平衡情况。

我们对政府的改革充满信心,但也深刻认识到过程的曲折。我们预计市场机会将继续围绕真正具备成长性的优质成长股和中长期受益于改革的子行业,但是市场行情的结构分化将进一步加剧。相应的,我们将采取较为平衡的投资策略:对于细分行业的思考会更加全面、深刻,对成长性个股的选择会更加严格;同时,适当配置受益于改革的低估值板块,积极分享国企改革的红利。

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,努力实现本基金的良好表现。

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	2,605,157,476.69	73.23
	其中:股票	2,605,157,476.69	73.23
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	937,354,594.40	26.35
8	其他资产	14,879,459.60	0.42
9	合计	3,557,391,530.69	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	104,917,128.70	2.98
B	采矿业	284,106,146.03	8.07
C	制造业	663,804,066.26	18.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	169,348,321.81	4.81
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	393,014,853.70	11.16
G	交通运输、仓储和邮政业	38,206,816.18	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	318,311,827.53	9.04
J	金融业	168,121,277.16	4.78
K	房地产业	44,678,862.90	1.27
L	租赁和商务服务业	193,942,593.42	5.51
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	226,705,583.00	6.44
S	综合	-	-
	合计	2,605,157,476.69	74.01

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	300017	网宿科技	4,061,190	214,065,324.90	6.08
2	002739	万达院线	2,487,524	202,733,206.00	5.76
3	600060	海信电器	10,506,770	140,685,650.30	4.00
4	002273	水晶光电	6,336,136	113,987,086.64	3.24
5	601607	上海医药	6,356,737	110,861,493.28	3.15
6	002183	怡亚通	2,042,182	88,610,276.98	2.52
7	600058	五矿发展	3,391,769	87,541,557.89	2.49
8	601166	兴业银行	5,377,002	78,289,149.12	2.22
9	600674	川投能源	7,051,838	72,916,004.92	2.07
10	600598	北大荒	5,053,120	72,360,678.40	2.06

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

海信电器于2014年10月10日收到《国家新闻出版广电总局科技司关于暂停受理公司广播电视设备器材入网认定申请的通知》,因在江西省直播卫星户户通工程采购招标过程中,发现公司存在提供虚假入网检测报告的违规行为,给予暂停受理你公司广播电视设备器材入网认定申请的决定,要求公司自查整改并汇报结果。

北大荒于2014年10月28日收到上海证券交易所的通报批评。公司由于关联担保未履行相应的决策程序,也未及时履行信息披露义务,以及信息披露不真实、不准确,对对时任董事会秘书兼担保公司董事长史晓丹予以通报批评,同时此事件将记入上市公司诚信档案。此后公司于2014年11月17日就上述违规行为对公司董事长刘长友及总经理贾天元予以关注。

北大荒于2015年6月23日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚及市场禁入事先告知书》,公司由于通过多笔交易虚增2011年年度利润,对公司以及该节点严重的相关责任人进行罚款以及证券市场禁入措施,对其余情节较轻连带责任人给予警告。

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八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	3,667,740.42
2	应收证券清算款	10,902,555.41
3	应收股利	-
4	应收利息	176,183.33
5	应收申购款	132,980.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,879,459.60

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	002739	万达院线	202,733,206.00	5.76	重大事项停牌
2	002183	怡亚通	88,610,276.98	2.52	重大事项停牌
3	600058	五矿发展	87,541,557.89	2.49	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	2,889,809,562.15
报告期期间基金总申购份额	121,597,203.07
减:报告期期间基金总赎回份额	426,317,053.27
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	2,585,089,711.95

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	1,475,240.59
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	1,475,240.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.06

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;

华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业行业精选混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业行业精选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

华宝兴业新兴产业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	华宝新兴产业混合
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	656,361,452.96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%×中证新兴产业指数+25%上证国债指数。
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