

## 华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

## [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:中国工商银行股份有限公司  
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、完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人中国工商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、投资组合报告和投资收益等数据，除特别说明外，数据截至2015年9月30日，本期报告期为2015年7月1日起至9月30日止。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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期利润2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:华宝兴业新机遇

基金主代码:162414

交易代码:162414

基金运作方式:上市的契约型开放式(LOF)

基金合同生效日:2015年6月11日

报告期末基金份额总额:512,875,500.00份

投资目标:在充分考虑风险的前提下，本基金通过大类资产的配置和多样化的投资策略，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增值。

投资策略:本基金将根据宏观经济、政策、制度、市场环境的变化，适时调整大类资产配置比例。

2.股票投资策略:

本基金将根据股票市场的整体估值水平，择机对股票的配置和风格进行定期调整。

3.债券投资策略:

本基金将根据利率预期和信用评价，选择合适的债券品种，以获得稳定的收益。

4.权证投资策略:

本基金将根据权证的定价模型，在采用数量化模型分析和综合定价的基础上，把握市场的短线波动，进行积极操作，在风险可控的前提下努力获取超额的回报。

5.资产支持证券投资策略:

本基金将根据法律法规规定的范围，对本基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据法律法规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，让利理财，防范投资风险。

6.其他金融工具投资策略:

本基金将根据法律法规的规定，选择适当的金融工具，以获得超额的收益。

7.其他金融工具投资策略:

本基金将根据法律法规的规定，选择适当的金融工具，以获得超额的收益。

8.其他金融工具投资策略:

本基金将根据法律法规的规定，选择适当的金融工具，以获得超额的收益。

9.合 计:

512,875,500.00份

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 - -

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 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 酒、饮料和烟草制造业 - -

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、技术服务与地质勘查业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 交通运输、仓储和邮政业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和计划生育 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 30,010,000.00份 5.69%

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 601388 工商银行 4,000,000 17,280,000.00 5.39%

2 000000 五粮液 1,000,000 12,730,000.00 2.50%

5.4 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 3,941,266.70

2.本期利润 -825,666.63

3.期初至报告期末的平均基金份额利润 -0.0008

4.期末基金资产净值 609,710,978.65

5.期末基金份额净值 1.000

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.按照基金的规定,基金管理人对本期基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末,本基金未达到。

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2015年6月11日至2015年9月30日)

基金净值增长率

华宝兴业基金管理有限公司

中国工商银行股份有限公司

§ 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 3,941,266.70

2.本期利润 -825,666.63

3.期初至报告期末的平均基金份额利润 -0.0008

4.期末基金资产净值 609,710,978.65

5.期末基金份额净值 1.000

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.按照基金的规定,基金管理人对本期基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末,本基金未达到。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2015年6月11日至2015年9月30日)

基金净值增长率

华宝兴业基金管理有限公司

中国工商银行股份有限公司

§ 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间 证券从业年限 说明

蔡慧君 国内投资部副总监、本基金基金经理 2015年6月11日 - 12年 硕士,在华宝兴业基金管理有限公司从事研究工作,2008年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任高级研究员、研究报告经理、助理研究员、基金经理助理、基金投资总监,2012年9月起任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2013年6月起任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2015年6月11日起任华宝兴业基金管理有限公司基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。  
2.本公司确认蔡慧君先生从其处获得的报酬符合《基金管理人高级管理人员、基金经理等人员公平交易制度》的相关规定。

3.2015年6月11日,蔡慧君先生因个人原因辞去华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,并自动辞职。

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,基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国投资基金法》(以下简称“基金法”)和其他相关法律、法规的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的职责,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 公平交易执行的情况

本报告期内,基金管理人通过对比公司旗下所有投资组合的收益率和重仓股偏离度,对旗下所有投资组合执行了公平交易制度。

4.3.2 公平交易执行的结果

本报告期内,基金管理人对旗下所有投资组合进行了定期报告,未发现不公平交易行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人对旗下所有投资组合执行了公平交易制度。

4.3.4 公平交易制度的执行效果

本报告期内,基金管理人对旗下所有投资组合执行了公平交易制度。

4.3.5 公平交易制度的执行监督

本报告期内,基金管理人对旗下所有投资组合执行了公平交易制度。

4.4 报告期内本基金的异常交易行为专项说明

本报告期内,基金管理人对旗下所有投资组合执行了公平交易制度。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和运作特点的说明

本基金为股票型基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金,债券型基金和股票型基金,预期收益和风险水平居中。

本基金为股票型基金,主要通过投资于目标行业,从而实现基金资产的增值。

本基金为股票型基金,主要投资于目标行业,从而实现基金资产的增值。

本基金为股票型基金