华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业增强收益债券
基金主代码	240012
交易代码	240012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年2月17日
报告期末基金份额总额	281,737,492.90份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A / 华宝兴业增强收益债券B
下属分级基金的交易代码	240012 / 240013
报告期末下属分级基金的份额总额	86,147,485.27份 / 195,590,007.63份

§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10月1日 - 2015年12月31日)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1. 本期已实现收益	1,791,142.01	3,765,022.08
2. 本期利润	1,761,866.78	3,999,262.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0249	0.0250
4. 期末基金资产净值	123,600,005.88	272,936,072.16
5. 期末基金份额净值	1.4347	1.3954

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

华宝兴业增强收益债券A

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	2.12%	0.09%	2.37%	0.11%	-0.25%	-0.02%

华宝兴业增强收益债券B

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	2.02%	0.09%	2.37%	0.11%	-0.35%	-0.02%

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

(2009年2月17日至2015年12月31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8月16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		
李栋梁	本基金基金经理,华宝兴业宝康债券、华宝新机遇混合、华宝新价值混合基金经理	2014年10月11日	-	12年	硕士,曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资,2010年9月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师,2010年12月至2011年6月任华宝兴业宝康债券基金经理助理,2011年6月起担任华宝兴业宝康债券基金经理,2014年10月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2015年10月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)和华宝兴业新价值灵活配置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、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证100指数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运作分析

2015年1-11月份,固定资产投资完成额同比增长10.2%,1-11月份固定资产投资增速持续下滑,2季度和4季度固定资产投资增速有所稳定,但是1季度和3季度持续下滑。分行业来看,制造业投资完成额同比增速下降至8.4%,房地产开发投资完成额同比增速下降至1.3%;制造业投资增速和房地产投资增速降幅持续下滑,基建投资增速总体较为稳定。1-11月份出口金额同比下降3%,出口增速在3,4季度再度下滑;1-11月份进口金额同比下降15.1%,进口增速较低表明内需很不乐观。1-11月份社会消费品零售总额同比增长11.2%,名义和实际消费增速稳中有升。物价水平低于市场预期,7,8月份物价水平受到猪肉的影响上涨有所加快,进入4季度物价水平再度下降,11月份CPI为1.5%,1-11月份 CPI为1.4%。为了应对经济的下滑和因贬值导致的资金外流,4季度央行再度降低存贷款基准利率,同时降低存款准备金率。3,4季度金融数据有所改善,M2增速提升,但是表外融资持续压缩,信贷在社会融资总量的占比不断提高,信贷中除了居民房贷持续增长之外,企业中长期贷款投放较差。10月份以来利率债和中高等级信用债收益率持续下行,11月份新股重启推动利率债和中高等级信用债收益率短期快速反弹,新股重启的冲击结束之后债券收益率继续下降,其中利率债和中高等级信用债均创年内新低。对于低等级信用债来说,由于信用事件频发,低等级信用债分化加剧,信用恶化的行业和个券收益率上升较多,信用分化明显。4季度股票持续反弹,创业板反弹幅度较大,可转债走势和股票基本一致,转债供给的重启以及部分转债正股接近赎回价,转债整体的转股溢价率持续压缩。

2015年4季度增强收益债券基金提高了利率债的投资比例,提高了信用债的投资比例,降低了股票的配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内增强收益A 基金份额净值增长率为2.12%,同期业绩比较基准收益率为2.37%;增强收益B 基金份额净值增长率为2.02%,同期业绩比较基准收益率为2.37%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,899,979.36	95.71
	其中:债券	406,899,979.36	95.71
	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	6,083,202.36	1.43
8	其他资产	12,172,939.89	2.86
9	合计	425,156,121.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资,故无股票投资明细。

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	28,143,901.30	7.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,195,000.00	10.64
	其中:政策性金融债	42,195,000.00	10.64
4	企业债券	276,146,078.06	69.64
5	企业短期融资券	60,229,000.00	15.19
6	中期票据	-	-
7	可转债	186,000.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	406,899,979.36	102.61

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	111051	09怀化债	369,102	39,652,627.86	10.00
2	010107	21国债(7)	231,910	25,146,001.30	6.34
3	122112	11沪大众	213,700	22,331,650.00	5.63
4	126018	08江铜债	216,950	21,441,168.50	5.41
5	041558082	15华电江苏CP003	200,000	20,082,000.00	5.06

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投资。

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

14长证债(112232)于2015年5月22日收到湖北证监局关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定,因公司未与部分研究报告转载机构签订协议,公司部分研究报告的报送审核人员和对外发送渠道不符合公司内部规定,决定对公司采取出具警示函的监管措施,同时要求在2015年5月29日前向湖北证监局提交书面报告,接受检查验收。

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债券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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	88,991.40
2	应收证券清算款	923,503.08
3	应收股利	-
4	应收利息	9,979,846.98
5	应收申购款	1,180,598.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,172,939.89

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
报告期期初基金份额总额	40,572,949.05	112,806,085.84
报告期期间基金总申购份额	85,141,484.97	107,025,306.33
减:报告期期间基金总赎回份额	39,566,948.75	24,241,384.54
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	86,147,485.27	195,590,007.63

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	743,018.15
报告期期间买入/申购总份额	948,520.18
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	1,691,538.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.60

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12月14日	948,520.18	1,360,000.00	0.80%
合计			948,520.18	1,360,000.00	

注: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;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业增强收益债券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
2016年1月21日

华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝中国互联股票
基金主代码	001767
交易代码	001767
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月23日
报告期末基金份额总额	52,518,300.68份
投资目标	把握中国互联网相关行业在中国境内外资本市场的投资机会,在控制风险的前提下,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稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金投资于全球市场,包括境内市场和境外市场。本基金将通过宏观策略研究,构造适当的量化模型,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,从而决定全球资产配置比例。 2、股票投资策略 本基金主要投资于在境内和境外上市的互联网主题相关的中国公司,对于股票投资,本基金将主要采用基于基本面研究、成长导向的主动性管理策略,自下而上地选择个股,同时兼顾行业变化。 3、个股投资策略 本基金将依靠定量与定性相结合的方法,自下而上地精选个股。 4、固定收益类投资工具投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等,投资的目的是保证基金资产流动性、有效利用基金资产、提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 5、股指期货投资策略 本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,达到管理投资组合风险的目的。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊纳汇下的流动性风险,利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 6、资产支持证券投资策略 本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券α策略等策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行资产支持证券产品的投资。
业绩比较基准	中证互联网指数×50%+中证海外中国互联网指数×50%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

注:1、本基金另设美元份额,基金代码001768,与人民币份额并表披露。

2、截止本报告期末,本基金人民币份额净值1.049元,人民币总份额49,983,779.48份;本基金美元份额净值0.1615美元,美元总份额2,534,521.20份。

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	State Street Bank and Trust Company
	中文	-	美国道富银行有限公司
注册地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		-	02111

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	3,035,197.04
2.本期利润	4,834,779.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0488
4.期末基金资产净值	55,098,731.24
5.期末基金份额净值	1.049

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。

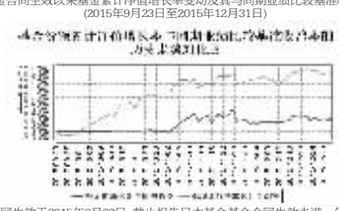
3.2 基金净值表现

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	4.90%	1.26%	28.59%	1.60%	-23.69%	-0.34%

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

(2015年9月23日至2015年12月31日)



注:1、本基金基金合同生效于2015年9月23日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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		
周晶	国际业务部总经理,本基金基金经理、华宝油气基金经理、华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理	2015年9月23日	-	9年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券(美国)和汇丰证券(美国)从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2006年至2007年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管,2011年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师,现任国际业务部总经理。2013年6月至2015年11月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理,2014年9月起兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2015年9月兼任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理。
周欣	本基金基金经理、华宝海外中国混合基金经理华宝兴业资产管理(香港)有限公司投资部经理	2015年9月23日	-	16年	北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士,曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009年12月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任海外投资管理部总经理。2009年12月至今担任华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金基金经理,2015年9月兼任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理(香港)有限公司投资部经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中国互联网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,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运作分析

本基金于2015年9月23日成立,目前基金仍然处于建仓期。整个四季度,考虑到A股以及海外中概股仍然处于震荡期间,因此基金建仓比较谨慎,仓位增加比较缓慢。此外,本基金自10月结束封闭期后,赎回量非常大,也影响了基金的建仓。在整个四季度,A股和海外中概互联网公司经历了一轮比较大的反弹,中证A股互联网指数四季度反弹24.23%,中证海外互联网指数反弹32.27%,由于仓位的原因,基金表现在四季度明显落后于指数表现。

但是出于对于中国互联网整体产业发展的信心,以及经历股灾之后境内外中国互联网公司的估值都明显趋近于合理空间,基金四季度还是选择了一些成长性比较确定的品种进行了投资,取得了一定的正收益。

在海外和国内的投资比例上,出于审慎性原则和考虑到大额赎回的因素,以及美国12月可能开始加息对人民币汇率和人民币资产的压力,因此海外中概股的配置比较低。后续随着基金规模趋于稳定以及美国加息效应的充分释放,将逐步增加海外互联网中概股的投资。海外市场部分,四季度我们选股的主要标准为互联网商业模式较为独特,护城河较宽,利润率稳定,盈利增长趋势确定,并且估值合理的互联网龙头公司。此外我们也投资了部分已经宣布私有化计划回归A股,私有化成功的确定性较高,且私有化建议价格较现行股价有显著溢价的海外上市中国互联网公司。

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为4.90%,同期业绩比较基准收益率为28.59%,基金表现落后于比较基准23.69%。

4.5 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	35,613,123.70	59.34
	其中:普通股	32,557,424.18	54.25
	优先股	-	-
	存托凭证	3,055,699.52	5.09
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,964,683.25	39.93
8	其他资产	436,423.27	0.73
9	合计	60,014,230.22	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国	30,505,621.00	55.37
中国香港	1,474,392.27	2.68
美国	3,633,110.43	6.59
合计	35,613,123.70	64.64

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	3,639,374.47	6.61
工业	6,800,521.00	12.34
公用事业	873,600.00	1.59
金融	1,927,200.00	3.50
信息技术	19,342,428.23	35.11
医疗保健	2,242,800.00	4.07
原材料	787,200.00	1.43
合计	35,613,123.70	64.64

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	JIANGSU LINYANG ENERGY CO-A	林洋能源	601222	上交所	中国	50,000	1,836,500.00	3.33
2	BEIJING VRV SOFTWARE CORP-A	北信源	300352	深交所	中国	25,000	1,560,000.00	2.83
3	MIG TECHNOLOGY INC-A	明家科技	300242	深交所	中国	30,000	1,498,800.00	2.72
4	WUXI BOTON TECHNOLOGY CO-A	宝通科技	300031	深交所	中国	46,000	1,444,400.00	2.62
5	BEIJING TRUST&FAR TECHNOLO-A	银信科技	300231	深交所	中国	50,000	1,344,000.00	2.44
6	YGSOFT INC-A	远光软件	002063	深交所	中国	60,000	1,268,400.00	2.30
7	XILINMEN FURNITURE CO LTD-A	喜临门	603008	上交所	中国	50,000	1,245,000.00	2.26
8	SUMAVISION TECHNOLOGIES CO-A	数码视讯	300079	深交所	中国	100,000	1,212,000.00	2.20
9	WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	网宿科技	300017	深交所	中国	20,000	1,199,800.00	2.18
10	WUHAN ZHONGYUAN HUADIAN-A	中元华电	300018	深交所	中国	33,300	1,177,821.00	2.14

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

报告期末,本基金未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

报告期末,本基金未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	25,751.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	873,600.00
5	应收申购款	407,195.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	436,423.27

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 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	公司名称(英文)	流通受限部分的公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300242	明家科技	1,498,800.00	2.72	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	276,501,195.48
报告期期间基金总申购份额	2,375,554.99
减:报告期期间基金总赎回份额	226,358,449.79
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	52,518,300.68

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	22,204,874.51
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	22,204,874.51
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.98

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;

华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业中国互联网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。

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
2016年1月21日

华宝兴业中证100指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证100指数
基金主代码	240014
交易代码	240014
前端交易代码	240014
后端交易代码	240015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	445,815,690.95份
投资目标	本基金通过指数化投资,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%、年跟踪误差不超过4%,实现对中证100指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证