

# 华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金

## [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报告中的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本基金报告期自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1日
报告期末基金份额总额	468,446,278.03份
基金类别	股票型
基金投资目标	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较好的回报。
本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关行业进行深入的分析，从而选择出具有较好配置价值的行业并进行配置，同时结合新兴产业发展的深入分析，挖掘新兴产业的高成长性。本基金通过采取自上而下的法定定投和长期持有，结合自下而上的个券选择方法进行操作。	
业绩比较基准	60%×沪深300指数+25%×上证国债指数。
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其长期平均预期风险和预期收益水平均高于货币基金、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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期末现金余额	163,081,779.86
2.本期利润	338,730,033.06
3.期末可供分配基金份额利润	0.6499
4.期末基金份额净值	1,231,721,508.03
5.期末总资产净值	2,629.04

注:1.本期利润已扣除按比例计提的基金风险准备金。

2.所列数据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。

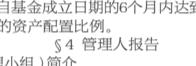
3.2.2 本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 纯净值增长(%) 业绩比较基准 收益率差(%)

过去三个月 29.46% 13.00% 16.20% 15.00% 14.26% 0.40%

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

(2010年12月7日至2015年12月31日)



注:按照基金合同的约定，自基金成立之日起的6个月内达到规定的资产组合，截至2011年6月6日，本基金已达合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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
易斌	本基金基金经理	2015年4月9日 -	9年	博士研究生。曾任国泰君安证券有限公司研究所研究员。2010年11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，2012年1月任华宝兴业新兴产业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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内，基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新兴产业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，基金管理部门的相关规定，依赖诚信勤勉，勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

由于债市的系统性风险和申购赎回引起的基金规模变化，新兴产业混合型证券投资基金在报告期内出现持有两个股票占基金净资产值比超过10%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 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室管理制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序，每日交易日结束报告、定期基金投资绩效评价等评价机制，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环节和环境得到公平对待，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，通过投资决策委员会会议规则、公平交易制度、定期基金投资绩效评价等机制对所有投资组合之间的公平交易行为进行监控，从而保证不同组合之间公平对待，实现公平交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，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%。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析

回顾2015年4季度，股市走出了一波向上行情，报告期内，上证指数上涨15%，深成指上涨34%，中小板指数上涨35.6%，创业板上涨41%，板块和热点表现方面，计算机、通信、地产、电子表现强势，钢铁、石化、交运、建筑、公用事业等行业表现较弱。报告期内，我们对组合个股进行了些结构性的调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

4.5.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，整体表现好于沪深300指数，同期业绩比较基准收益率为14.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人少于二百人或基金资产净值低于五千元的情形。

§ 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	权属贵金属	999,151,529.91	80.17
2	基金投资	999,151,529.91	80.17
3	固定收益	-	-
4	衍生工具	-	-
5	金融衍生品	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	227,158,442.06	18.23
8	其他资产	20,029,009.41	1.61
9	合计	1,246,339,990.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:按照基金合同的约定，自基金成立之日起的6个月内达到规定的资产组合，截至2011年6月6日，本基金已达合同规定的资产配置比例。

§ 6 管理人报告

6.1 报告期内本基金的利润分配情况

6.2 报告期内本基金的费用情况

6.3 报告期内本基金的净值表现

6.4 报告期内本基金的偏离度情况

6.5 报告期内本基金的估值政策和估值差额说明

6.6 报告期内本基金的所持证券的流动性风险分析

6.7 报告期内本基金的流动性风险管理政策和措施

6.8 报告期内本基金的摊余成本与公允价值的偏离

6.9 报告期内本基金的资产支持证券情况

6.10 报告期内本基金的中小企业私募债情况

6.11 报告期内本基金的资产支持专项计划情况

6.12 报告期内本基金的国债期货及衍生品投资情况

6.13 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.14 报告期内本基金的资产支持专项计划投资情况

6.15 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.16 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.17 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.18 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.19 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.20 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.21 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.22 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.23 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.24 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.25 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.26 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.27 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.28 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.29 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.30 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.31 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.32 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.33 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.34 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.35 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.36 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.37 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.38 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.39 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.40 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.41 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.42 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.43 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.44 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.45 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.46 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.47 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.48 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.49 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.50 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.51 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.52 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.53 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.54 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.55 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.56 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

6.57 报告期内本基金的资产支持证券投资