华宝兴业事件驱动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	华宝事件驱动混合
基金主代码	001118
交易代码	001118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月8日
报告期末基金份额总额	4,748,928,717.20份
投资目标	本基金积极发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响的各类事件,把握各类事件创造出的投资机会,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、企业盈利、市场估值以及市场流动性等方面因素分析判断决定大类资产配置比例。 2、股票投资策略 本基金将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线,以事件驱动作为核心的投资策略,通过对上市公司各类事件的深入分析来精选个股。 3、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,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。 4、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,运用股指期货对中系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,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。 5、资产支持证券投资策略 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 6、其他金融工具投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人将根据监管机构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、比例限制、信息披露方式等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-160,150,185.54
2.本期利润	1,273,887,660.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.2561
4.期末基金资产净值	4,523,660,911.60
5.期末基金份额净值	0.953

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。

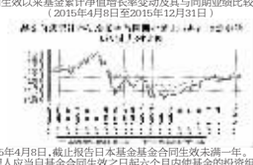
3.2 基金净值表现

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	35.95%	2.14%	13.57%	1.34%	22.38%	0.80%

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4月8日至2015年12月31日)



注:1.本基金基金合同生效于2015年4月8日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2.按照基金合同的规定,基金管理人应当自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约定。截至2015年10月8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		
陈建华	本基金基金经理、中证100基金经理	2015年4月8日	-	14年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作,2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理助理,兼任华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理,2012年12月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2015年4月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理。
徐林明	助理投资总监、量化投资部总经理、本基金基金经理,华宝兴业中证100指数基金经理、华宝兴业上证180价值ETF基金经理、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理、华宝兴业量化对冲混合基金经理	2015年4月8日	-	13年	复旦大学经济学硕士,FRM,曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8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、金融工程部副总经理。2009年9月至2015年11月任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2010年2月起任量化投资部总经理,2010年4月至2015年11月任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2014年6月任助理投资总监,2014年9月兼任华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年4月任华宝兴业事件驱动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、《华宝兴业事件驱动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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化、事件驱动混合型证券投资基金在短期内出现过持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%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运作分析

回顾2015年四季度,国内宏观经济继续处于筑底和结构调整的过程中,货币政策维持宽松。在无风险利率持续下降的背景下,股票资产的相对吸引力提高;证金的持股、大股东减持的限制改变了股票市场的供求关系;保险等产业资本的举牌潮,活跃了市场情绪;A股市场在四季度处于震荡反弹期,指数呈现普涨态势。本报告期,沪深300和中证100指数分别上涨16.49%和14.27%,而中证500和创业板分别上涨24.40%和30.32%。

本报告期本基金净值随着市场的反弹也快速回升。本基金坚持以并购重组事件股票为投资方向,主要采取国企改革主题的并购重组事前量化理伏策略和方案公布后的并购重组精选策略,综合考虑估值、并购重组效应和流动性等因素精选个股。本季度增加了员工持股、并购重组精选策略等事件的比重,本基金的行业配置继续以消费、科技、服务等经济转型受益行业为主,配置的主要行业为医药生物、计算机、电子、传媒和休闲服务等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.953元,本报告期内基金份额净值增长率为35.95%,同期业绩比较基准收益率为13.57%。

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	4,027,924,658.17	88.28
	其中:股票	4,027,924,658.17	88.28
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	220,000,000.00	4.82
	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	302,306,762.35	6.63
8	其他资产	12,187,978.22	0.27
9	合计	4,562,419,398.74	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	63,980,252.76	1.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,333,705,863.49	51.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,676,677.80	0.17
E	建筑业	85,783,042.86	1.90
F	批发和零售业	112,434,379.07	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	42,358,523.85	0.94
H	住宿和餐饮业	34,390,214.71	0.76
I	信息传输、软件和信息技术服务业	746,950,617.13	16.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	62,093,347.92	1.37
L	租赁和商务服务业	83,828,758.30	1.85
M	科学研究和技术服务业	95,258,984.85	2.11
N	水利、环境和公共设施管理业	147,057,290.77	3.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,830,100.00	0.35
Q	卫生和社会工作	7,282,352.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	189,294,252.66	4.18
S	综合	-	-
	合计	4,027,924,658.17	89.04

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	300009	安科生物	3,010,001	130,272,843.28	2.88
2	002551	尚荣医疗	3,174,657	104,668,441.29	2.31
3	300147	香雪制药	4,097,742	102,484,527.42	2.27
4	002456	欧菲光	3,000,036	93,061,116.72	2.06
5	300016	北陆药业	2,390,191	84,875,682.41	1.88
6	600718	东软集团	2,512,208	78,004,058.40	1.72
7	300133	华策影视	2,582,564	76,934,581.56	1.70
8	300291	华录百纳	2,152,347	76,623,553.20	1.69
9	000063	中兴通讯	3,919,541	73,021,048.83	1.61
10	300282	汇冠股份	2,136,446	70,353,166.78	1.56

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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,运用股指期货对中系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,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。

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。本基金的投资符合既定的投资政策和投资目标。

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

香雪制药(300147)于2015年9月30日收到中国证券监督管委员会广东监管局行政监管措施决定书,因公司违反《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第40号)第二条、《企业会计准则——基本准则》第十七条、第十九条、第三十二条和《企业会计准则第14号——收入》,对公司予以警示。

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	1,810,465.22
2	应收证券清算款	9,007,428.73
3	应收股利	-
4	应收利息	118,286.09
5	应收申购款	1,251,798.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,187,978.22

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	5,145,077,329.12
报告期期间基金总申购份额	157,121,953.88
减:报告期期间基金总赎回份额	553,270,565.80
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	4,748,928,717.20

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	1,289,377.99
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	1,289,377.99
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.03

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;

华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业事件驱动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
2016年1月21日

华宝兴业收益增长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	华宝兴业收益增长混合
基金主代码	240008
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月15日
报告期末基金份额总额	252,874,956.24份
投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,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。股票投资部分采用定量与定性分析相结合,行业配置与定期调整策略;债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。
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.本期已实现收益	87,286,634.50
2.本期利润	351,438,729.66
3.加权平均基金份额本期利润	1.3491
4.期末基金资产净值	1,586,890,875.57
5.期末基金份额净值	6.2754

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。

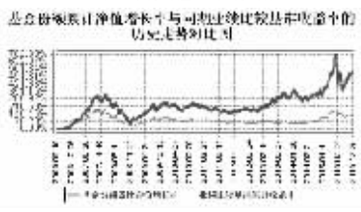
3.2 基金净值表现

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	27.00%	1.63%	10.00%	1.02%	17.00%	0.61%

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

(2006年6月15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2006年12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		
闫旭	助理投资总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝行业精选混合基金经理、华宝稳健回报混合基金经理	2015年2月17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。
毛文博	本基金基金经理	2015年4月9日	-	5年	硕士。曾任智库合力管理咨询有限公司研究部研究员。2010年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理的职务。2015年4月起任华宝兴业收益增长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、《华宝兴业收益增长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运作分析

2015年的季度,在宽松货币环境的作用下,市场开始温染资产荒的逻辑。而国家为稳定市场在A股市场的购买行为、监管对大股东减持的限制,改变了股票市场的供求力量。市场开始进入长达一个季度的修复阶段。

本轮修复的本质,是市场大幅下跌后,股票市场供求状况受到暂时改变所带来的反弹。实体经济、企业盈利和现金流的变化并不显著。因此反弹的路径仍然是沿着下跌之前的路径。整个四季度来看,中小市值股票的涨幅显著大于低估值蓝筹股。

本基金在四季度提高了仓位,并适度参与了中小市值股票反弹。坚持选择业绩持续增长的优质标的,增加了高端制造、工业自动化、新能源、电子等领域标的比重,提高了地产等政策态度转变板块的配置比例。在2016年最后一个月里,我们以更加谨慎的态度对待市场,逐渐在市场热度上升过程中,降低仓位,减持基本面支撑较弱的概念型股票。减持涨幅过大、估值过高的品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为27.00%,同期业绩比较基准收益率为10.00%,基金表现领先于比较基准17.00%。

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	1,216,187,841.21	75.29
	其中:股票	1,216,187,841.21	75.29
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	390,348,846.24	24.16
8	其他资产	8,897,670.04	0.55
9	合计	1,615,434,357.49	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	39,377,971.50	2.48
B	采矿业	36,250,953.86	2.28
C	制造业	625,423,649.81	39.41
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	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	156,887,616.68	9.89
J	金融业	54,722,948.05	3.45
K	房地产业	237,773,474.69	14.98
L	租赁和商务服务业	31,084,805.07	1.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,925,214.80	1.44
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	11,741,206.75	0.74
S	综合	-	-
	合计	1,216,187,841.21	76.64

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	603308	应流股份	2,667,663	83,551,205.16	5.27
2	600048	保利地产	6,711,847	71,414,052.08	4.50
3	002531	天顺风能	3,772,645	51,873,868.75	3.27
4	002368	太极股份	713,136	47,851,425.60	3.02
5	002037	久联发展	1,665,024	46,221,066.24	2.91
6	603008	喜临门	1,778,546	44,285,795.40	2.79
7	002200	云投生态	1,520,385	39,377,971.50	2.48
8	002588	史丹利	1,186,078	38,583,117.34	2.43
9	600594	益佰制药	1,553,144	32,926,652.80	2.07
10	300275	梅安森	900,913	32,793,233.20	2.07

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

云投生态(002200)于2014年5月15日至2014年10月16日陆续收到昆明市中级人民法院民事虚假责任纠纷86个案件的《应诉通知书》、《民事起诉状》及《云南省昆明市中级人民法院民事传票》。公司由于在《招股说明书》、2007年-2009年年报和半年报中虚增资产和虚增收入,被法院判决赔偿其中部分原告经济损失,判决公司法定代表人、董事长,以及时任财务总监承担连带赔偿责任。

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	722,213.13
2	应收证券清算款	7,983,422.18
3	应收股利	-
4	应收利息	89,387.96
5	应收申购款	102,646.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,897,670.04

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	265,911,587.52
报告期期间基金总申购份额	4,951,459.24
减:报告期期间基金总赎回份额	17,988,090.52
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	252,874,956.24

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	361,693.52
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	26,150.94
报告期期末管理人持有的本基金份额	335,542.58
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.13

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	赎回	2015年12月14日	26,150.94	157,279.60	0.00%
合计			26,150.94	157,279.60	

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;

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业收益增长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
2016年1月21日

华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

2015年第4季度报告
2015年12月31日

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	华宝万物互联混合
基金主代码	001534
交易代码	001534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月30日
报告期末基金份额总额	975,922,306.52份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过捕捉互联网行业和体现互联思维相关行业的投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素,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。 2、股票投资策略 本基金采取积极的股票选择策略,将"自上而下"的行业配置策略和"自下而上"的股票精选策略相结合,根据对宏观经济、中观行业和市场风险特征变化的判断,进行投资组合的动态优化,实现基金资产长期稳定增值。