华宝兴业服务优选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	华宝服务优选混合
基金主代码	000124
交易代码	000124
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月27日
报告期末基金份额总额	1,869,347,722.30份
投资目标	把握服务相关行业的稳步成长,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,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。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享服务业快速发展所带来的行业高回报。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。在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证服务业指数收益率×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	739,818,432.42
2.本期利润	966,225,508.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.6012
4.期末基金资产净值	4,459,468,807.81
5.期末基金份额净值	2.386

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。

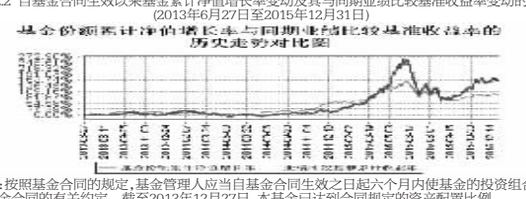
3.2 基金净值表现

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	39.13%	2.63%	14.48%	1.39%	24.65%	1.24%

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

(2013年6月27日至2015年12月31日)



注: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2013年12月27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		
楼鸿强	本基金基金经理、华宝万物互联混合基金经理	2014年10月22日	-	6年	硕士。曾在兴业证券研究所从事行业分析工作。2011年加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理的职务。2014年10月起担任华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金经理,2015年6月兼任华宝兴业万物互联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、《华宝兴业服务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 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,市场在国庆节后受海外市场大涨的影响报复性上涨,市场热点开始逐步活跃,VR、IP、军工等概念轮番上涨,市场依然偏好小盘股。到10月末,上涨动力似乎开始衰竭,但在流动性泛滥的背景下,众多资金依然在焦虑地等待买入机会,短暂横盘后,市场再度暴涨。11月市场在月初暴涨后动力有所减弱,横盘到月末后,利空因素开始集中释放。证金开始对多个股票减持,IPO重启,注册制推进加快,美国也在年底首次加息,海外市场疲弱。市场开始出现多次回调,热点的持续性也明显缩短,但总体韧性依然较强,下跌并不连贯,总体保持振荡,跌幅较为有限,并一直持续到了年末。

在操作方面,本基金在季度初相对谨慎,结构略偏防御。10月末开始改变思路,通过积极的结构调整和换手来回避风险,业绩进一步改善。到12月末,由于市场在多次利空的打压下长时间横盘,本基金主动降低了仓位,成功减少了新年年初大跌的损失。

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41.83%,同期业绩比较基准收益率为24.60%,基金表现领先业绩比较基准17.23%。

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	3,879,828,277.93	85.12
	其中:股票	3,879,828,277.93	85.12
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	546,266,162.28	11.99
8	其他资产	131,796,028.21	2.89
9	合计	4,557,890,468.42	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	46,382,591.19	1.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,302,967,300.30	51.64
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	97,634,604.00	2.19
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	932,919,587.50	20.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	143,888,744.71	3.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	112,634,591.70	2.53
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,431.28	0.03
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	242,084,427.25	5.43
S	综合	-	-
	合计	3,879,828,277.93	87.00

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	002188	新嘉联	6,250,326	277,826,990.70	6.23
2	300248	新开普	5,781,221	214,772,360.15	4.82
3	002612	朗姿股份	2,571,342	194,033,467.32	4.35
4	300230	永利带业	5,136,963	191,968,307.31	4.30
5	300038	梅泰诺	3,051,728	172,971,943.04	3.88
6	000802	北京文化	3,568,116	120,887,770.08	2.71
7	002260	德奥通航	2,401,126	108,530,895.20	2.43
8	000078	海王生物	4,074,900	97,634,604.00	2.19
9	300352	北信源	1,491,645	93,078,648.00	2.09
10	300384	三联虹普	1,075,061	90,520,136.20	2.03

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

新开普(300248)于2015年7月31日收到中国证券监督管理委员会河南监管局《关于对新开普电子股份有限公司实施出具警示函措施的决定》,因公司违反《上市公司信息披露管理办法》以及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》,河南证监局对公司采取出具了警示函的监管措施,并记入证券期货诚信档案。同时要求公司董事、监事、高级管理人员应着重加强对信息披露和内幕信息管理相关法律法规的学习,对以上问题提出切实可行的整改措施与计划,并在收到本决定书之日起30日内向河南证监局提交书面报告。

德奥通航(002260)于2015年6月15日收到深圳证券交易所《关于对广东伊立浦电器股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》,因公司未及时履行信息披露义务,决定对公司给予通报批评的处分,同时对公司董事长朱家钢、副董事长兼总经理王正年、董事兼副总经理王鑫文、副总经理兼董事会秘书陈国辉、财务总监张之珩给予通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案。

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	7,081,616.89
2	应收证券清算款	91,174,476.26
3	应收股利	-
4	应收利息	144,888.31
5	应收申购款	33,395,046.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,796,028.21

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	002612	朗姿股份	194,033,467.32	4.35	重大事项停牌
2	300038	梅泰诺	172,971,943.04	3.88	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	1,235,489,735.83
报告期期间基金总申购份额	1,115,718,518.46
减:报告期期间基金总赎回份额	481,860,531.99
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	1,869,347,722.30

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人持有本基金份额变动情况

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	250,156.90
报告期期间买入/申购总份额	195,261.51
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	445,418.41
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.02

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	195,261.51	460,000.00	1.50%
合计			195,261.51	460,000.00	

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;

华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业服务优选混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业服务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
2016年1月21日

华宝兴业高端制造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	华宝兴业制造股票
基金主代码	000866
交易代码	000866
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
报告期末基金份额总额	719,556,466.61份
投资目标	把握制造业升级过程中的投资机会,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	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及风险进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对高端制造业主题相关行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享制造业升级过程中所带来的投资机会。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。在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	申银万国制造业指数收益率×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

§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	106,001,115.44
2.本期利润	419,168,082.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.4330
4.期末基金资产净值	1,037,100,097.62
5.期末基金份额净值	1.441

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。

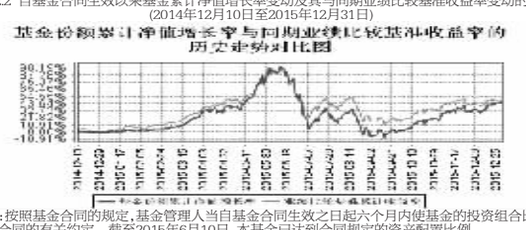
3.2 基金净值表现

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	41.83%	2.13%	24.60%	1.74%	17.23%	0.39%

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

(2014年12月10日至2015年12月31日)



注:按照基金合同的规定,基金管理人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6月10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		
刘自强	投资副总监、本基金基金经理、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝国策导向混合基金经理	2014年12月10日	-	14年	硕士。2001年7月至2003年7月,在天同证券任研究员,2003年7月至2003年11月,在中原证券任行业研究部副经理,2003年11月至2006年3月,在上海融昌资产管理公司先后任研究员、研究总监。2006年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理职务,2008年3月至今任华宝兴业动力组合混合型证券投资基金的基金经理,2010年6月至2012年1月兼任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理,2012年4月起任投资副总监,2014年12月起兼任华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业国策导向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、《华宝兴业高端制造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 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,市场在国庆节后受海外市场大涨的影响报复性上涨,市场热点开始逐步活跃,VR、IP、军工等概念轮番上涨,市场依然偏好小盘股。到10月末,上涨动力似乎开始衰竭,但在流动性泛滥的背景下,众多资金依然在焦虑地等待买入机会,短暂横盘后,市场再度暴涨。11月市场在月初暴涨后动力有所减弱,横盘到月末后,利空因素开始集中释放。证金开始对多个股票减持,IPO重启,注册制推进加快,美国也在年底首次加息,海外市场疲弱。市场开始出现多次回调,热点的持续性也明显缩短,但总体韧性依然较强,下跌并不连贯,总体保持振荡,跌幅较为有限,并一直持续到了年末。

在操作方面,本基金在季度初相对谨慎,结构略偏防御。10月末开始改变思路,通过积极的结构调整和换手来回避风险,业绩进一步改善。到12月末,由于市场在多次利空的打压下长时间横盘,本基金主动降低了仓位,成功减少了新年年初大跌的损失。

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41.83%,同期业绩比较基准收益率为24.60%,基金表现领先业绩比较基准17.23%。

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	925,846,624.76	88.53
	其中:股票	925,846,624.76	88.53
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	115,429,847.73	11.04
8	其他资产	4,483,754.03	0.43
9	合计	1,045,760,226.52	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	867,948,541.26	83.69
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	42,778,083.50	4.12
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	15,120,000.00	1.46
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	925,846,624.76	89.27

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	002662	京威股份	1,900,000	41,800,000.00	4.03
2	603308	应流股份	1,150,000	36,018,000.00	3.47
3	300304	云意电气	1,200,000	35,520,000.00	3.42
4	601799	星宇股份	900,000	33,939,000.00	3.27
5	300389	艾比森	675,126	33,087,925.26	3.19
6	600366	宁波韵升	1,500,000	32,760,000.00	3.16
7	300165	天瑞仪器	1,250,000	32,650,000.00	3.15
8	002206	海利得	2,005,400	31,885,860.00	3.07
9	002126	银轮股份	1,700,000	31,365,000.00	3.02
10	002056	横店东磁	1,099,923	30,918,835.53	2.98

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	680,095.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,695.58
5	应收申购款	3,785,963.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,483,754.03

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	1,064,927,521.55
报告期期间基金总申购份额	54,403,576.65
减:报告期期间基金总赎回份额	399,774,631.59
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	719,556,466.61

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	247,035.57
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	247,035.57
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

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	247,035.57	321,575.47	0.25%
合计			247,035.57	321,575.47	

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;

华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业高端制造股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业高端制造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。

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

华宝兴业国策导向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	华宝国策导向混合
基金主代码	001088
交易代码	001088
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月8日
报告期末基金份额总额	2,339,799,367.84份
投资目标	本基金通过投资受益于国家产业政策及经济发展方向且增长前景确定的优质企业,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
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 本基金通过深入分析和挖掘可能对行业和个股的当前或未来价值产生重大影响的政策事件,例如城镇化建设、国企改革、科教兴国等,在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上,以这类国家和产业政策作为中长期投资的主线,自上而下和自下而上相结合,采取多层次的定量和定性方法,完成行业配置和个股选择。 3.固定收益类投资工具投资策略 本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益率投资工具,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。 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,并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及特殊情况下的流动性风险,以达到降低投资组合整体风险的目的。 6.资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款、预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时,基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等多极策略,在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。 7.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,基金管理人可根据法律法规及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