泓德远见回报混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:泓德基金管理有限公司
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20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	泓德远见回报混合
基金主代码	001500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月24日
报告期末基金份额总额	598,418,435.22份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过股票、债券等大类资产的配置和重点投资长期成长行业优势证券的组合策略,追求基金资产良好的长期回报。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行精心配置,以分散市场风险。本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的方法进行股票投资,其中,本基金将选择长期成长行业进行重点投资。同时,本基金将采取适当的久期策略、信用策略、时机策略和可转换债券投资策略相结合的方法进行债券投资。本基金力争在有效控制风险的前提下,通过股票、债券等大类资产的配置和重点投资长期成长行业优势证券的组合策略,追求基金资产的稳健回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数×25%
风险收益特征	基金为混合型基金,属于较高风险、较高收益的品种,其长期风险与收益特征低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

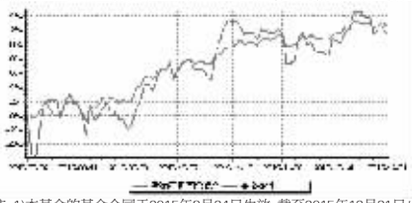
单位:人民币元

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	49,840,526.77
2.本期利润	62,126,701.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.1037
4.期末基金资产净值	673,594,327.85
5.期末基金份额净值	1.126

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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。
2、所列数据截止到2015年12月31日。
3、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。
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	10.18%	0.54%	12.98%	1.25%	-2.80%	-0.71%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数×25%
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



注:1)本基金的基金合同于2015年8月24日生效,截至2015年12月31日止,本基金成立未满1年。
2)本基金的建仓期为6个月,截至2015年12月31日止,本基金建仓期尚未结束。
3)建仓期结束后,本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的8%-95%;现金、债券及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-92%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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		
邹传雁	本基金基金经理、公司副总经理	2015年8月24日	-	15年	曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理、阳光保险集团股份有限公司资产投资管理中心投资负责人、阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理负责人、光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管、光大证券股份有限公司研究所分析师、华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。2015年6月至今担任泓德泓富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年8月至今担任泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月至今担任泓德裕泰债券型证券投资基金的基金经理。2015年12月至今担任泓德泓利货币市场基金的基金经理。

注:①对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
②证券从业的含义遵从行业协会《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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《泓德远见回报混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。
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,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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没有超过该证券当日成交量的5%的情况。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金2015年8月24日正式开始运作,紧接着2015年四季度A股逐月强劲反弹。从追求绝对收益目标出发,本基金在2015年四季度采取了相对谨慎的股票配置策略,初期股票配置比例比较低,随着本基金抗风险能力的逐步提高,股票配置比例缓慢提高。
本基金在2015年四季度主要选择未来三到五年业绩确定性增长的优质上市公司股票,在估值比较具有吸引力情况下构建本基金股票组合。这一点在2015年四季度取得了良好的效果,使得本基金在股市大幅度反弹背景下,用比较低的股票配置比例跟上了业绩基准。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截止报告期末,泓德远见的基金份额净值为1.126元,本报告期份额净值增长率为10.18%,同期业绩比较基准增长率为12.98%。
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数量不满二百人或者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	276,363,778.37	40.91
	其中:股票	276,363,778.37	40.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	305,397,276.20	45.21
	其中:债券	305,397,276.20	45.21
	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	20,000,000.00	2.96
	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	64,297,597.25	9.52
8	其他资产	9,413,985.51	1.39
9	合计	675,472,637.33	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	-	-
B	采矿业	7,440,000.00	1.10
C	制造业	157,750,980.24	23.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	269,000.00	0.04
E	建筑业	1,479,800.00	0.22
F	批发和零售业	13,148,044.44	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	6,405,000.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,872,170.97	1.32
J	金融业	28,107,223.00	4.17
K	房地产业	6,344,050.72	0.94
L	租赁和商务服务业	7,255,755.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	35,050.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	12,751,350.00	1.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,816,854.00	3.54
R	文化、体育和娱乐业	2,688,500.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	276,363,778.37	41.03

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	300015	爱尔眼科	406,000	12,821,480.00	1.90
2	600276	恒瑞医药	250,000	12,280,000.00	1.82
3	002262	恩华药业	408,400	11,953,868.00	1.77
4	600885	宏发股份	399,908	11,953,250.12	1.77
5	002475	立讯精密	352,976	11,277,583.20	1.67
6	601169	北京银行	1,009,100	10,625,823.00	1.58
7	600028	中国石化	1,500,000	7,440,000.00	1.10
8	600138	中青旅	310,000	7,226,100.00	1.07
9	601318	中国平安	199,000	7,164,000.00	1.06
10	000001	平安银行	590,000	7,074,100.00	1.05

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,045,500.00	5.20
	其中:政策性金融债	35,045,500.00	5.20
4	企业债券	1,290,776.20	0.19
5	企业短期融资券	110,475,000.00	16.40
6	中期票据	61,337,000.00	9.11
7	可转债	349,000.00	0.05
8	同业存单	96,900,000.00	14.39
9	其他	-	-
10	合计	305,397,276.20	45.34

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	111511270	15平安CD270	1,000,000	96,900,000.00	14.39
2	101560064	15浦东土地MTN001	500,000	50,580,000.00	7.51
3	011551002	15中船SCP002	500,000	50,155,000.00	7.45
4	011599629	15建发SCP002	400,000	40,164,000.00	5.96
5	150215	15国开15	350,000	35,045,500.00	5.20

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
本基金本报告期末未投资股指期货。
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
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	182,467.52
2	应收证券清算款	6,396,712.47
3	应收股利	-
4	应收利息	2,832,635.38
5	应收申购款	2,170.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,413,985.51

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不存在流通受限情况。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	601,464,332.42
报告期期间基金总申购份额	799,900.32
减:报告期期间基金总赎回份额	3,845,797.52
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	598,418,435.22

§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
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内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
(1)中国证券监督管理委员会批准泓德远见回报混合型证券投资基金设立的文件
(2)《泓德远见回报混合型证券投资基金基金合同》
(3)《泓德远见回报混合型证券投资基金托管协议》
(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
(5)泓德远见回报混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
8.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处
8.3 查阅方式
1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件
(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司,客户服务电话:4009-100-888
(3)投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇一六年一月二十一日

华宝兴业创新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	华宝创新优选混合
基金主代码	000601
交易代码	000601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月14日
报告期末基金份额总额	191,730,406.71份
投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的企业,在控制风险的前提下为基金持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1)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)本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对拥有持续创新能力的企业相关股票的深入分析,积极挖掘企业的创新溢价,分享其投资机会; (3)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)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800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

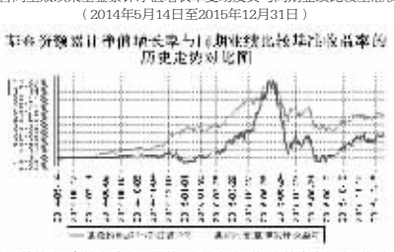
单位:人民币元

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	11,613,458.29
2.本期利润	54,216,050.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.2676
4.期末基金资产净值	212,874,314.54
5.期末基金份额净值	1.110

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	30.90%	2.06%	15.35%	1.38%	15.55%	0.68%

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5月14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2014年11月14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		
陈乐华	本基金基金经理	2014年10月22日	-	9年	硕士。曾在中信建投证券有限责任公司从事行业研究工作。2010年5月加入华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理助理的职务,2014年10月起任华宝兴业创新优选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、《华宝兴业创新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
回顾2015年四季度,我国国内经济仍在低位运行,各项经济指标依然处在下降通道。另外,美国加息以及人民币本身的贬值压力也使得汇率开始贬值,导致国内资金外流压力加大,从而对国内经济产生负面影响。
A股市场在经历了上半年的大牛市后,三季度出现暴跌,其短时间内的下跌幅度在全球股市历史上也是罕见的。报告期内,各大指数有所反弹,其中,上证指数上涨15.93%,深成指上涨26.8%,沪深300上涨16.49%,中小板指数上涨23.81%,创业板上涨30.32%。板块表现方面,电子、房地产、计算机、通信及服装行业指数涨幅较大,涨幅均在35%以上;钢铁、交运行业指数涨幅靠后,涨幅不足10%。
报告期间,本基金依然坚持自下而上的选股思路,主要投资于代表中国经济未来发展方向,未来发展前景较好的成长股。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截止至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为30.90%,业绩比较基准收益率为15.35%,基金表现超越基准15.55%。
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	180,167,365.74	82.86
	其中:股票	180,167,365.74	82.86
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	32,940,096.33	15.15
8	其他资产	4,321,818.20	1.99
9	合计	217,429,280.27	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	2,248,500.00	1.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	145,766,221.78	68.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,111,121.50	3.34
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	7,959,023.00	3.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,701,471.54	4.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,147,654.16	1.48
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	4,233,373.76	1.99
S	综合	-	-
	合计	180,167,365.74	84.64

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	002551	尚荣医疗	521,362	17,189,305.14	8.07
2	300252	金信诺	172,207	6,957,162.80	3.27
3	300145	南方泵业	144,946	6,902,328.52	3.24
4	300263	隆华节能	230,000	6,647,000.00	3.12
5	300274	阳光电源	215,089	5,897,740.38	2.77
6	002022	科华生物	200,000	5,820,000.00	2.73
7	002483	润邦股份	358,236	5,606,393.40	2.63
8	300389	艾比森	110,000	5,391,100.00	2.53
9	002381	双箭股份	300,000	5,124,000.00	2.41
10	300026	红日药业	223,212	4,709,773.20	2.21

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	213,546.01
2	应收证券清算款	3,924,051.64
3	应收股利	-
4	应收利息	7,805.04
5	应收申购款	176,415.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,321,818.20

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	002483	润邦股份	5,606,393.40	2.63	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	210,265,311.73
报告期期间基金总申购份额	8,638,463.68
减:报告期期间基金总赎回份额	27,173,368.70
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	191,730,406.71

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	49,558.43
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	49,558.43
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;
华宝兴业创新优选混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业创新优选混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业创新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住所备投资者查阅。
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

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

【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

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝油气
场内简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年9月29日
报告期末基金份额总额	6,626,822,168.13份
投资目标	通过严格的指数化投资策略,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,力争控制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0.5%,年化跟踪误差不超过5%(以美元资产计价)。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
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001481,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0.495元,人民币总份额6,624,437,240.94份;本基金美元份额净值0.0762美元,美元总份额2,384,927.19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	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York,NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York,NY10286
邮政编码		-	NY10286

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

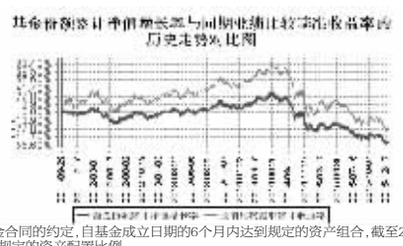
单位:人民币元

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	-164,331,076.96
2.本期利润	-98,107,760.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0241
4.期末基金资产净值	3,282,722,731.67
5.期末基金份额净值	0.495

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	-6.78%	3.76%	-5.81%	4.01%	-0.97%	-0.25%

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
(2011年9月29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2012年3月29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		
周晶	国际业务部总经理,本基金基金经理,华宝中国互联股票基金经理、华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理	2014年9月18日	-	9年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、迈太平洋证券(美国)和汇丰证券(美国)从事数量分析、另