

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金 2012 年第 3 季度报告

2012 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2012 年 10 月 26 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 2012 年 10 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 2012 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业先进成长股票
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 7 日
报告期末基金份额总额	1,003,891,136.08 份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法，选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资，重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业，同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金，属于证券投资基金中的较高风险品种。
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（2012年7月1日—2012年9月30日）
1. 本期已实现收益	-64,484,757.20
2. 本期利润	-43,569,438.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0434
4. 期末基金资产净值	1,534,917,981.42
5. 期末基金份额净值	1.5290

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

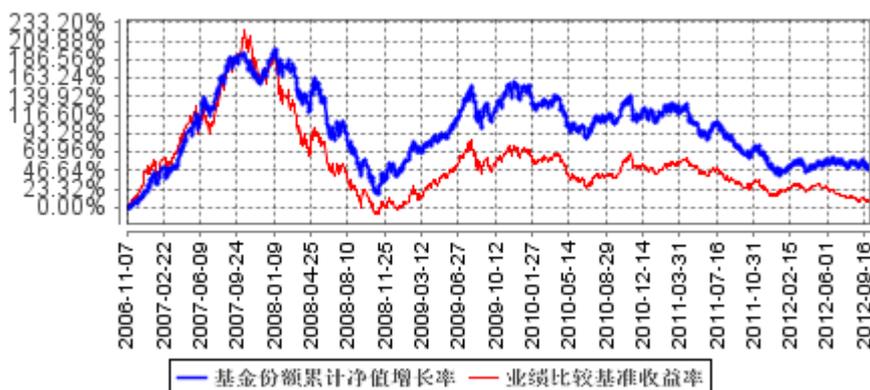
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.69%	1.14%	-6.25%	1.01%	3.56%	0.13%

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11月7日至2012年9月30日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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2007年5月7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		
李靖	本基金基金经理	2011年2月11日	-	12年	博士。1999年至2000年任和君创业投资有限公司研究员，2000年至2010年在光大证券有限公司先后任行业研究员、策略研究员、投资经理和定向理财部副总经理的职务。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理，2010年9月至2012年1月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2011年2月起兼任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。
朱亮	本基金基金经理	2012年6月1日	-	6年	硕士。曾于倍多科技（中国）有限公司任产品总监，于国金证券股份有限公司任研究员。2008年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任研究部高级分析师，国内投资部华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理，华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理助理，华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理助理，2012年6月至今任华宝兴业先进成

					长股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《华宝兴业先进成长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，分析了本基金与公司旗下所有其他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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，经济继续下跌，市场所期待的政策救市也迟迟没有兑现，市场只好用脚投票，继续 5 月后的单边下跌态势，地产、券商、煤炭、机械等周期板块快速下跌，但以创业板和中小板代表的结构性行情一直存在，特别是 TMT、医药、环保等符合国家未来政策的新兴产业板块表现良好。

报告期内，本基金以电子、医药、环保等新兴产业板块为主要配置，并减持了部分周期板块，对中长期看好的个股买入并持有。

4.4.2 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-2.69%，业绩比较基准收益率为-6.25%，基金表现领先业绩基准 3.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，与前面相比我们对市场有所乐观，主要因：经济环比回升、政策维稳以及技术反弹综合作用。在国家前期各种刺激政策的叠加以及季节因素的综合影响下，四季度经济有望环比回升，企业盈利特别是周期行业将会明显受益。同时 11 月初的十八大召开亦对投资者有维稳的预期，提升市场信心。不过虽然对维稳行情乐观，但现在我们仍认为市场是反弹的机会，在宏观经济没有反转前、经济结构未能理顺前，市场反转还为时尚早。

下一阶段，主要配置还需围绕增长确定、前景良好的新兴产业板块和大消费板块，并对周期板块波段操作。

感谢持有人一直以来对我们的支持，在后续投资中，我们将继续总结经验，勤勉尽责，努力实现本基金的良好表现。

§ 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	1,300,047,040.96	81.92
	其中：股票	1,300,047,040.96	81.92
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	285,502,521.07	17.99
6	其他资产	1,412,383.68	0.09
7	合计	1,586,961,945.71	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	10,499,076.00	0.68

B	采掘业	197,937.12	0.01
C	制造业	767,768,884.20	50.02
C0	食品、饮料	124,775,162.90	8.13
C1	纺织、服装、皮毛	33,479,225.98	2.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	89,896,381.26	5.86
C5	电子	175,029,692.79	11.40
C6	金属、非金属	40,637,884.26	2.65
C7	机械、设备、仪表	111,880,642.32	7.29
C8	医药、生物制品	192,069,894.69	12.51
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	113,807,743.86	7.41
F	交通运输、仓储业	2,373,758.17	0.15
G	信息技术业	131,596,330.99	8.57
H	批发和零售贸易	64,175,582.40	4.18
I	金融、保险业	20,793,600.00	1.35
J	房地产业	60,127,637.89	3.92
K	社会服务业	95,212,464.16	6.20
L	传播与文化产业	33,430,846.17	2.18
M	综合类	63,180.00	0.00
	合计	1,300,047,040.96	84.70

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	002049	同方国芯	2,847,469	68,168,407.86	4.44
2	000858	五粮液	1,413,400	47,914,260.00	3.12
3	002497	雅化集团	3,054,376	47,373,371.76	3.09
4	002375	亚厦股份	1,852,718	46,781,129.50	3.05
5	600809	山西汾酒	926,778	35,263,902.90	2.30
6	300005	探路者	1,925,784	33,893,798.40	2.21
7	300088	长信科技	2,180,789	32,275,677.20	2.10
8	002450	康得新	1,449,665	31,283,770.70	2.04
9	002384	东山精密	3,030,608	31,215,262.40	2.03
10	601888	中国国旅	1,099,938	31,139,244.78	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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 本基金股票投资的主要对象是先进企业股票,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,208,745.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	119,687.40
4	应收利息	64,688.23
5	应收申购款	19,262.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,412,383.68

5.8.4 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。

5.8.5 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的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	914,145,356.56
本报告期基金总申购份额	106,722,360.69
减：本报告期基金总赎回份额	16,976,581.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,003,891,136.08

注：总申购份额含红利再投资和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同；
 华宝兴业先进成长股票型证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业先进成长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。

7.2 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。

7.3 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
2012 年 10 月 26 日