

# 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

## 2013 年第 1 季度报告

2013 年 3 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：2013 年 4 月 18 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 2013 年 4 月 15 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 2013 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                            |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华宝兴业新兴产业股票                                                                                                                                                 |
| 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 7 日                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 2,709,209,912.47 份                                                                                                                                         |
| 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，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，通过对新兴产业相关行业的辨识、精选以及对新兴产业相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享新兴产业发展所带来的较高回报。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 |
| 业绩比较基准     | 75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。                                                                                                                                     |
| 风险收益特征     | 本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。                                                                                                                                 |
| 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（2013 年 1 月 1 日 — 2013 年 3 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 160,440,677.46                        |
| 2. 本期利润         | 453,224,939.32                        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1654                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,920,519,983.78                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0780                                |

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

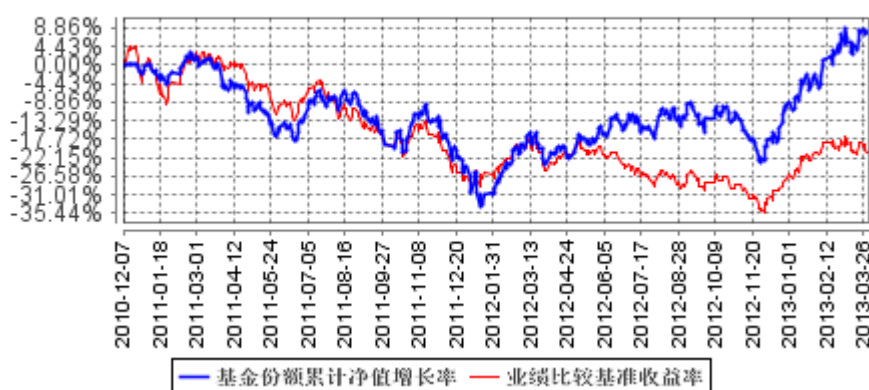
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 18.16%     | 1.54%         | 7.75%          | 1.17%                 | 10.41% | 0.37% |

##### 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

（2010 年 12 月 7 日至 2013 年 3 月 31 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 2011 年 6 月 6

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 |        |                                                                                                                                                                                                 |
| 郭鹏飞 | 国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康配置混合基金经理 | 2010年12月7日  | —    | 9 年    | 博士，拥有 CFA 资格。2004 年 2 月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师，2007 年 9 月任公司研究部副总经理，2009 年 3 月至 2010 年 6 月任公司研究部总经理，2010 年 6 月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010 年 12 月起兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2012 年 4 月起任国内投资部总经理。 |

### 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、《华宝兴业新兴产业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

回顾 2013 年一季度，中国经济延续了此前弱复苏的格局，国内经济在房地产恢复和国家基建投资的拉动下，继续小幅环比改善；而美国经济持续走强，欧债危机也基本度过了恐慌阶段，海外市场趋于稳定；但两会前后，中央陆续出台了针对楼市的“新国五条”以及规范银行理财业务的新意见，两个新规打压了市场持续做多的信心，A 股随之下挫。2013 年一季度，上证指数下跌 1.43%，深成指下跌 2.49%，沪深 300 下跌 1.1%，中小板指数上涨 8.92%，创业板上涨 21.38%，中小板和创业板表现远好于主板市场。行业板块方面，周期类板块表现明显差于非周期板块：信息设备、信息服务、环保、医药生物表现靠前，并均有明显收益，而有色、煤炭、地产等行业跌幅较大。

我们在一季度整体保持了较高的仓位，并增持了一些业绩超预期的高成长性新兴产业个股。在一季度中小板和创业板指数上涨的过程中，基金净值也稳步上涨。一季度后期，考虑到市场系统性风险及创业板估值较高风险，我们减持了业绩不达预期的以及涨幅过大的个股，将仓位逐步降低到了中等水平。

#### 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 18.16%，基金比较基准收益率为 7.75%，基金表现超越比较基准 10.41 个百分点。

### 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 2013 年，中国经济弱复苏的趋势仍在，部分行业企业盈利将缓慢触底反弹，但是新一轮房地产调控的开始将使得周期股的盈利复苏更加曲折和反复，指数缺乏大的上升空间。同时，由于目前 A 股估值较低，长期投资安全边际较高，指数更有可能在一定区间震荡为主，等待更加明确的政策方向及经济复苏的信号。市场的投资机会可能更多表现为结构性的和阶段性的，而新兴

产业可能会是结构性投资机会的重点领域之一。

我们将继续精选优秀的新兴产业公司，坚定长期持有，分享战略性新兴产业中长期快速增长带来的丰厚回报。我们将继续坚持进行专业化投资，不参与传统行业投资以及短期交易性机会，专注于寻找新兴产业领域的中长期投资机会，希望中长期能够为持有人带来好的回报。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，我们将继续勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

## § 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              | 2,402,632,536.12 | 81.02        |
|    | 其中：股票             | 2,402,632,536.12 | 81.02        |
| 2  | 固定收益投资            | 99,960,000.00    | 3.37         |
|    | 其中：债券             | 99,960,000.00    | 3.37         |
|    | 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      | 434,230,790.74   | 14.64        |
| 6  | 其他资产              | 28,611,697.26    | 0.96         |
| 7  | 合计                | 2,965,435,024.12 | 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         | 16,409,161.54    | 0.56         |
| B  | 采掘业              | 72,630,899.85    | 2.49         |
| C  | 制造业              | 1,412,651,004.49 | 48.37        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | 243,559,809.23   | 8.34         |
| F  | 批发和零售业           | 24,563,356.81    | 0.84         |
| 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  | 209,183,520.32   | 7.16         |
| J  | 金融业              | -                | -            |
| K  | 房地产业             | -                | -            |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 111,119,468.00   | 3.80  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 3,018,000.00     | 0.10  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 309,497,315.88   | 10.60 |
| 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            | 2,402,632,536.12 | 82.27 |

### 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  | 300070 | 碧水源  | 4,601,409 | 242,402,226.12 | 8.30         |
| 2  | 002038 | 双鹭药业 | 2,533,098 | 158,318,625.00 | 5.42         |
| 3  | 002310 | 东方园林 | 1,849,572 | 144,987,949.08 | 4.96         |
| 4  | 300090 | 盛运股份 | 6,139,961 | 141,157,703.39 | 4.83         |
| 5  | 002503 | 搜于特  | 4,938,932 | 106,137,648.68 | 3.63         |
| 6  | 002358 | 森源电气 | 6,629,543 | 89,697,716.79  | 3.07         |
| 7  | 300026 | 红日药业 | 1,833,697 | 83,983,322.60  | 2.88         |
| 8  | 300058 | 蓝色光标 | 2,707,352 | 83,386,441.60  | 2.86         |
| 9  | 002236 | 大华股份 | 1,159,171 | 80,562,384.50  | 2.76         |
| 10 | 002450 | 康得新  | 2,504,530 | 80,144,960.00  | 2.74         |

### 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      | 99,960,000.00 | 3.42         |
|    | 其中：政策性金融债 | 99,960,000.00 | 3.42         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | -             | -            |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 99,960,000.00 | 3.42         |

**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**

| 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  | 130201 | 13 国开 01 | 1,000,000 | 99,960,000.00 | 3.42         |

**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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.8.1 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。

**5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未投资股指期货。

**5.9 投资组合报告附注****5.9.1**

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。

**5.9.2**

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。

**5.9.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 645,626.00    |
| 2  | 应收证券清算款 | 8,867,709.70  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 815,855.13    |
| 5  | 应收申购款   | 18,282,506.43 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 28,611,697.26 |

#### 5.9.4 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。

#### 5.9.5 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<br>公允价值(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|----------|
| 1  | 300058 | 蓝色光标 | 83,386,441.60      | 2.86             | 重大资产重组   |

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 2,719,838,246.22 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 953,522,251.22   |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 964,150,584.97   |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                |
| 报告期期末基金份额总额    | 2,709,209,912.47 |

注：总申购份额含转换入份额；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；  
 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金合同；  
 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金招募说明书；  
 华宝兴业新兴产业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办公场所备投资者查阅。

### 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  
2013 年 4 月 18 日