华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金
2015 年第 2 季度报告

2015 年 6 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2015 年 7 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 2015 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	836,402,333.40 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（ 2015 年 4 月 1 日 － 2015 年 6 月 30 日 ）
1. 本期已实现收益	2,130,812,711.05
2. 本期利润	769,527,669.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.6062
4. 期末基金资产净值	2,347,839,508.64
5. 期末基金份额净值	2.8071

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。

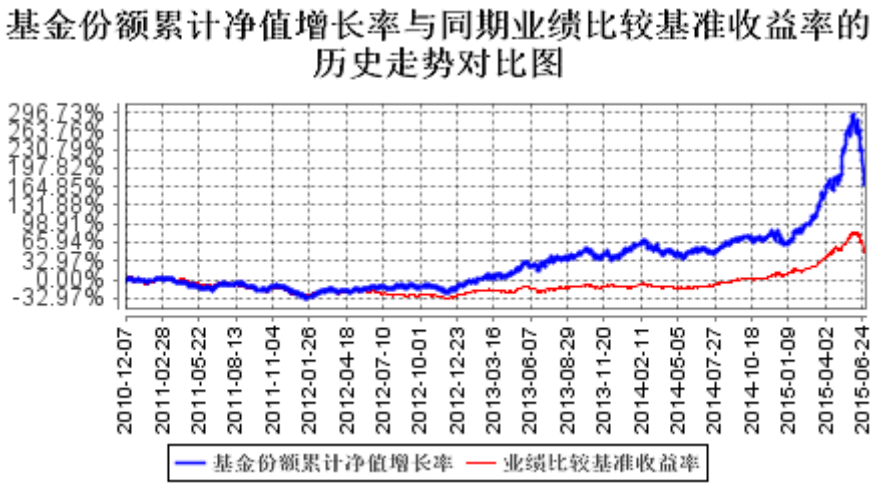
3.2 基金净值表现

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	12.59%	3.14%	13.49%	2.17%	-0.90%	0.97%

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 2015 年 6 月 30 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 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	投资副总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康灵活配置基金经理	2010年12月7日	2015年4月9日	11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先后担任研究部行业分析师研究部副总经理，研究部总经理，国内投资部总经理，投资副总监。2010年6月至2015年4月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010年12月至2015年4月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
朱亮	本基金基金经理、华宝兴业先进成长股票基金经理、华宝兴业创新股票基金经理	2013年7月25日	2015年5月7日	9年	硕士。曾在倍多科技（中国）有限公司任产品总监，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，国内投资部基金经理助理，2012年6月至2015年5月任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。2013年7月至2015年5月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2014年5月至2015年5月兼任华宝

					兴业创新优选股票型证券投资基金基金经理。
易镜明	本基金基金经理	2015 年 4 月 9 日	-	9 年	博士研究生。曾在国泰君安证券、中海基金从事行业研究工作。2012 年 11 月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任高级分析师、基金经理助理的职务。2015 年 4 月起任华宝兴业新兴产业股票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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。 发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收

益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。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 2015 年 2 季度，A 股走出了一波大幅上涨随后波动的行情，报告期内，上证指数上涨 14.3%，深成指上涨 25.1%，中小板指数上涨 26.9%，创业板上涨 30.2%，创业板和中小板的表现好于上证指数，但指数的波动幅度都比较大。板块和热点表现方面，军工涨幅 39%，纺织服装 36.8%，轻工 36.2%，交运 34.8%，其他包括电力设备、基础化工、传媒等热点炒作此起彼伏，有色、银行、非银、石油石化等行业涨幅较小。报告期间，我们总体仓位波动不大，只是对组合个股进行了一些结构性的调整，组合中的持股数量变化不大。

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 12.59%，同期业绩比较基准收益率为 13.49%，基金表现落后于比较基准 0.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在货币政策宽松的背景下，由改革和发展新经济主导的牛市是上半场的主基调，期间叠加杠杆，因此股票型基金的平均收益率超过过去两年之和，但是市场对于杠杆的认识在 6 月中旬之后开始深刻，我们认为下半年市场操作难度将高于上半年，系统性机会变小，需要用更加严格的标准精选个股。

未来，我们将严格恪守投资边界，采取自下而上为主，自上而下为辅的选股策略，寻找新兴产业中的较好公司，以及从技术创新、商业模式创新和制度创新中受益的成长股，买入并长期持有，以分享这些公司在未来的业绩快速增长过程中带来的丰厚回报。同时，我们将以勤勉尽责的态度，不断优化我们的投资组合，努力给持有人带来较好的中长期投资回报。

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	1,916,139,294.11	74.01
	其中：股票	1,916,139,294.11	74.01
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	668,744,132.35	25.83
7	其他资产	4,203,984.18	0.16
8	合计	2,589,087,410.64	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	44,842,259.40	1.91
C	制造业	1,155,401,864.56	49.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	749,816.58	0.03
E	建筑业	16,821,956.16	0.72
F	批发和零售业	18,279,912.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	63,434,052.00	2.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	462,979,854.86	19.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	93,239,255.11	3.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	26,689,008.24	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,063,094.16	0.68
R	文化、体育和娱乐业	17,638,221.04	0.75

S	综合	-	-
	合计	1,916,139,294.11	81.61

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	002303	美盈森	4,552,090	171,977,960.20	7.32
2	300182	捷成股份	2,489,687	128,218,880.50	5.46
3	300299	富春通信	3,978,329	105,743,984.82	4.50
4	002665	首航节能	2,630,137	72,854,794.90	3.10
5	300178	腾邦国际	1,785,116	64,460,538.76	2.75
6	300038	梅泰诺	1,402,334	63,076,983.32	2.69
7	300136	信维通信	2,328,072	57,968,992.80	2.47
8	002488	金固股份	1,774,625	57,639,820.00	2.46
9	600869	智慧能源	1,790,856	57,414,843.36	2.45
10	000887	中鼎股份	2,175,529	53,844,342.75	2.29

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	1,740,364.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	114,879.94
5	应收申购款	2,348,740.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,203,984.18

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	002665	首航节能	72,854,794.90	3.10	重大事项停牌
2	000887	中鼎股份	53,844,342.75	2.29	重大事项停牌
3	600869	智慧能源	57,414,843.36	2.45	重大事项停牌
4	002303	美盈森	171,977,960.20	7.32	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	1,853,168,678.00
报告期期间基金总申购份额	283,931,608.25
减:报告期期间基金总赎回份额	1,300,697,952.85
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	836,402,333.40

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	1,471,057.01
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	1,200,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	271,057.01
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

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 4 月 7 日	-1,200,000.00	-3,194,040.00	0.00%
合计			-1,200,000.00	-3,194,040.00	

注：交易金额为确认金额（不含交易费用），交易份额为确认份额。

§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。

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
2015 年 7 月 18 日