华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24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10月22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	华宝兴业医药生物
基金主代码	240020
交易代码	240020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年2月28日
报告期末基金份额总额	271,419,915.20份
投资目标	把握医药生物相关行业的投资机会,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,决定大类资产配置比例,通过对医药生物相关行业的辨识,精选以及对医药生物行业相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合目下而上的个券选择方法构建债券投资组合。
业绩比较基准	80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数
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较高预期风险和预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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(2013年7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	19,781,729.59
2.本期利润	56,380,140.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.2257
4.期末基金资产净值	432,175,275.37
5.期末基金份额净值	1.592

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	16.12%	1.52%	11.30%	1.20%	4.82%	0.32%

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

(2012年2月28日至2013年9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2012年8月28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		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金经理、华宝兴业行业精选基金经理	2012年2月28日	-	13年	硕士,曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作。于2007年7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,2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。
王智慧	研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2012年2月28日	-	12年	管理学博士,曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务,现任研究部总经理,2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年2月起兼任华宝兴业多策略增长开放式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、《华宝兴业医药生物优选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

本报告期内,新一届政府继续延续着上任以来的清新和开明政策,大政方针着眼于未来长远考虑。宏观经济上,虽然在三季度中曾经月度GDP同比增速降到近几年最低,但国家宏观政策并未因经济增速下滑而出台临时性短期刺激政策,经济在三季度出现了相对超预期的止跌回稳迹象,国内消费继续保持稳定增长,货币流动性保持适中,对医药行业来说,三季度有两件大事影响行业运行和医药指数二级市场的表现,即国家对医药行业的反商业贿赂的实击长期的检查以及广东基药招标新方法推出等。3季度市场整体表现尚可,但以创业板为代表的中小市值成长股延续较强的结构性行情,尤其是国家大力发展的大文化产业、信息服务等表现抢眼,相对收益和绝度收益均明显优于整个市场指数表现。另外部分低估值板块有所表现,而以上海自贸区为代表的题材炒作也较为突出。

本基金三季度重点关注了国家工商总局对医药行业的反腐核查,商业贿赂扭曲了整个产业链发展的核心价值,纠偏改正将有利于行业的长期良性发展,避开可能通过不正当手段销售的企业,加强风险控制十分必要;另外,担忧广东基药新招标办法对国内同质化程度高的仿制药可能产生的不利冲击。本期基金操作上采取了相应的应对策略:首先合位适度控制,另外医药股票配置上尽量避开受上述两方面影响的公司。

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16.12%,同期业绩比较基准收益率为11.30%,基金表现领先业绩基准4.82%。

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,宏观经济将可能依然底位徘徊,但值得期待的18届三中全会的召开将在政治改革和经济改革两大方面给市场带来希望。经济结构的调整和发展方式的转变将不可避免,资本市场上,我们认为未来投资机会主流将仍然集中在具有真正成长股的优秀公司;另外对经济的信心和政府的信心逐步恢复将带来低估值的大盘蓝筹的一定机会;与此同时,嫁接新技术和互联网技术等改造的传统行业中优秀公司实现跨行业的投资机会也不可忽略。展望二级市场未来的表现,我们保持相对乐观态度,对于医药行业来说,影响行业和二级市场的相关政策出现了比市场预期好的转变。加上医药行业的稳定快速增长有强烈的人口结构基础,随着年末业绩切换而带来的估值切换行情有可能出现,相对乐观。

本基金未来投资策略将集中在优化持仓结构,继续重点持有发展格局清晰、业绩增长明确、估值合理的细分领域龙头公司,与此同时业绩改善型预期明确的医药公司也将是重点考虑对象。

§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	378,347,583.75	83.96
	其中:股票	378,347,583.75	83.96
2	固定收益投资	206,286.54	0.05
	其中:债券	206,286.54	0.05
	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	58,885,047.46	13.07
6	其他资产	13,174,587.11	2.92
7	合计	450,613,504.86	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	-	-
C	制造业	296,440,634.74	68.59
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	42,909,517.25	9.93
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	32,957,965.86	7.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	48,433.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	5,991,032.90	1.39
R	文化,体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	378,347,583.75	87.54

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	300147	香雪制药	1,696,774	37,481,737.66	8.67
2	300298	三诺生物	409,328	24,739,784.32	5.72
3	000538	云南白药	169,183	19,804,561.98	4.58
4	300026	红日药业	420,280	17,096,990.40	3.96
5	002262	恩华药业	473,809	13,915,770.33	3.22
6	600521	华海药业	840,287	13,856,332.63	3.21
7	600079	人福医药	410,350	13,311,754.00	3.08
8	000028	国药一致	292,164	12,294,261.12	2.84
9	600594	益佰制药	331,536	11,139,609.60	2.58
10	000963	华东医药	250,802	11,010,207.80	2.55

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	206,286.54	0.05
8	其他	-	-
9	合计	206,286.54	0.05

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	128002	东华转债	1,660	206,286.54	0.05

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	246,022.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,575.92
5	应收申购款	12,917,988.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,174,587.11

5.10.4 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。

5.10.5 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	236,864,598.90
报告期期间基金总申购份额	286,367,454.48
减:报告期期间基金总赎回份额	251,812,138.18
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	271,419,915.20

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公司管理基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2013年8月8日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,公司总经理裴长江先生因个人原因,自2013年7月31日起不再担任总经理职务,由黄小蔓女士代任。

2、2013年9月27日,基金管理人发布高级管理人员任职公告,黄小蔓女士自2013年9月24日起正式担任公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业医药生物优选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。

9.2 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。

9.3 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10月24日

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24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2013年10月22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	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月7日
报告期末基金份额总额	339,737,855.56份
投资目标	在控制风险的前提下,争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景,注重价值挖掘,通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股,通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识,调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大至小排名在前1/3的股票。
业绩比较基准	沪深300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7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,975,314.32
2.本期利润	80,299,613.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.2289
4.期末基金资产净值	526,522,405.53
5.期末基金份额净值	1.5498

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。

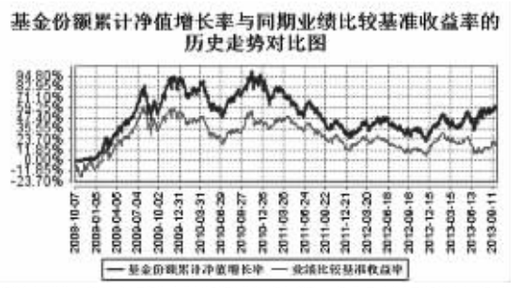
3.2 基金净值表现

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	17.11%	1.48%	7.70%	1.15%	9.41%	0.33%

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

(2008年10月7日至2013年9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2009年4月7日,本基金已达到基金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		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业行业精选基金基金经理	2010年7月28日	-	13年	硕士,曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作。于2007年7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,2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。
王智慧	研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2012年1月19日	-	12年	管理学博士,曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务,现任研究部总经理,2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年2月起兼任华宝兴业多策略增长开放式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、《华宝兴业大盘精选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

2013年3季度,市场悲观预期有所修复,整体走势震荡上行,同时价值与成长的分化持续,政策预期方面,随着总理关于增长、就业"下限"及通胀"上限"的表态,年中经济工作会议关于下半年经济政策"稳增长、调结构、促改革"的定调,同时伴随信息消费、节能环保、高铁招标等政策措施的陆续出台,市场对稳增长的预期有所升温;经济走势方面,三季度整体较为平稳,不过从发用电量、PMI、工业增加值等指标来看,呈现逐月走强的态势,市场信心有所强化;流动性趋势方面,由于6月底反应过于激烈,且央行的态度及措施也更为积极,银行间市场利率在三季度波动不大,因此悲观情绪得到较大程度修复;海外市场方面,三季度也较为平稳,欧美、日本经济本身平稳,美国QE退出预期有所延迟,资金仍有回流美国的趋势但强度减弱。在此背景下,三季度市场呈现震荡上行走势,只是幅度不算太大,同时市场对于政府调结构优于稳增长的决心并未动摇,从而价值与成长的分化持续。

本基金在3季度仓位波动不大,主要进行结构调整,适度降仓交运设备、家电、建筑建材等板块,适度增仓金融、信息设备及服务等,持续重视大盘价值与大盘成长之间的轮换。

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17.11%,同期业绩比较基准收益率为7.70%,基金表现领先于基准9.41%。

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4季度,经济走强的动能可能趋弱,政策及增长预期方面重点关注十八届三中全会的胜利召开,市场走势方面重点关注优质消费股、成长股的估值切换以及资金博弈导致的价值与成长的调仓效应。经济走势方面,由于经济中长期增长的制约因素并未实质性改变,而"稳增长"更多是种底线思维,因此4季度将持续走强动能可能减弱;不过究的十八届三中全会将在11月召开,关于中国经济的中长期走势、中国经济升级版的具体路线图等可能会有更为明确的预期,甚至激发市场对于经济改革的憧憬;而市场走势方面,由于临近年末,一方面需要关注优质消费股、成长股的估值切换,另一方面需要关注年底资金博弈背景下的调仓效应。

本基金计划在4季度维持中性仓位,持续重视结构调整,并在契约规定的范围内进一步优化大盘价值与大盘成长之间的配置,持续挖掘估值较低、盈利确定改善的板块和个股。

§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	464,520,313.15	87.86
	其中:股票	464,520,313.15	87.86
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	63,764,254.77	12.06
6	其他资产	442,240.13	0.08
7	合计	528,726,808.05	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	-	-
C	制造业	316,888,063.86	60.19
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,848,100.64	1.68
F	批发和零售业	7,240,637.92	1.38
G	交通运输,仓储和邮政业	15,271,583.42	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	46,178,783.38	8.77
J	金融业	28,823,929.00	5.47
K	房地产业	17,947,814.93	3.41
L	租赁和商务服务业	9,126,400.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利,环境和公共设施管理业	14,195,000.00	2.70
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	464,520,313.15	88.22

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	002415	海康威视	1,261,387	33,300,616.80	6.32
2	000538	云南白药	239,697	28,058,930.82	5.33
3	002065	东华软件	620,715	20,409,109.20	3.88
4	600804	鹏博士	944,387	17,508,934.98	3.33
5	000063	中兴通讯	1,018,649	16,909,573.40	3.21
6	000848	承德露露	561,628	16,292,828.28	3.09
7	601318	中国平安	439,970	15,706,929.00	2.98
8	002241	歌尔声学	369,800	15,635,144.00	2.97
9	300263	隆华节能	600,000	14,610,000.00	2.77
10	002303	美盈森	376,032	14,582,520.96	2.77

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 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

2013年5月22日中国平安公告其控股子公司平安证券有限责任公司于近日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚和市场禁入事先告知书》。

本基金管理人通过对该上市公司进行进一步了解和分析,认为该处罚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中国平安的投资判断未发生改变。

本报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	386,222.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,694.37
5	应收申购款	41,322.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,240.13

5.10.4 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。

5.10.5 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	002065	东华软件	20,409,109.20	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	362,201,530.54
报告期期间基金总申购份额	5,837,523.98
减:报告期期间基金总赎回份额	28,301,198.96
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	339,737,855.56

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公司管理基金情况

单位:元

序号	交易方式	交易日期	交易金额	适用费率
1	赎回	2013年9月30日	-10,044.70	0.00%
合计			-10,044.70	

注:交易日期为确认日期,交易金额为确认金额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2013年8月8日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,公司总经理裴长江先生因个人原因,自2013年7月31日起不再担任总经理职务,由黄小蔓女士代任。

2、2013年9月27日,基金管理人发布高级管理人员任职公告,黄小蔓女士自2013年9月24日起正式担任公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业大盘精选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。

9.2 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。

9.3 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10月24日

华宝兴业宝康债券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24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10月22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	华宝兴业宝康债券
基金主代码	240003
交易代码	240003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15日
报告期末基金份额总额	209,302,382.70份
投资目标	在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金财产安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用类属配置、久期偏离、收益率曲线配置和特定券种选择等积极投资策略,并把握市场创新机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数。
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