华宝兴业新兴产业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	1,643,119,556.60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7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	311,812,714.66
2.本期利润	549,895,807.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.2829
4.期末基金资产净值	2,422,345,671.42
5.期末基金份额净值	1.4742

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	21.27%	1.74%	13.69%	1.14%	7.58%	0.60%

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。
朱兆	本基金基金经理、华宝兴业先进成长股票基金经理	2013年7月25日	-	7年	硕士,曾在信多科技(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月至今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,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年三季度,美国QE3退出并没有如市场预期的实现,国内经济也开始出现企稳回升迹象,同时资金面的紧张状况也有所缓解。在这些积极因素促进下,市场在经历了6月底的快速下跌之后出现了回升。2013年三季度,上证指数上涨9.88%,深成指上涨10.66%,沪深300上涨9.47%,中小板指数上涨17.46%,创业板大涨35.21%,中小板和创业板市场再次明显好于上证和主板市场表现,创业板指数也在三季度最后一个交易日再次创出了历史新高。板块和热点表现方面,自贸区、国企改革、农村土地改革等热点炒作此起彼伏,信息服务、商业贸易、餐饮旅游、信息设备、交通运输等行业表现靠前,涨幅均在20%以上,而建筑建材、公用事业、采掘、食品饮料等板块涨幅靠后,但所有行业都录得正收益。

报告期间,我们总体仓位波动不大,依然维持在较高的水平,并增持了一些业绩超预期的高成长性新兴产业个股。同时,我们也减持了一些业绩不达预期的个股,缩减了组合中的持股数量。

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21.27%,同期业绩比较基准收益率为13.69%,基金表现领先于基准7.58%。

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年四季度,由于受到经济结构转型及流动性有所收紧的影响,中国经济持续回升动力不强,周期性行业的盈利恢复过程将更加漫长,市场趋势性机会不大,而传统行业与新兴行业的发展前景及盈利增速的差距将进一步拉大。11月份,我国将召开有关重要改革方向的十八届三中全会,届时市场对中国经济前景及改革方向的预期将更加明朗。我们认为,尽管经济前景不乐观,流动性也并不乐观,但目前市场整体估值上具有一定安全边际,长期来看投资的风险并不大。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	2,164,573,881.07	88.48
	其中:股票	2,164,573,881.07	88.48
2	固定收益投资	99,750,000.00	4.08
	其中:债券	99,750,000.00	4.08
	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	151,840,390.41	6.21
6	其他资产	30,315,563.58	1.24
7	合计	2,446,479,835.06	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	75,865,639.71	3.13
C	制造业	1,154,362,633.27	47.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	193,583.52	0.01
E	建筑业	86,826,686.25	3.58
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	292,251,504.92	12.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	186,295,453.20	7.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	237,851,654.30	9.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,318,725.90	0.26
R	文化、体育和娱乐业	124,608,000.00	5.14
S	综合	-	-
	合计	2,164,573,881.07	89.36

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	5,006,749	203,774,684.30	8.41
2	300090	盛运股份	5,024,438	166,057,675.90	6.86
3	002236	大华股份	3,008,089	137,108,696.62	5.66
4	300027	华谊兄弟	1,600,000	124,608,000.00	5.14
5	300058	蓝色光标	1,786,315	119,683,105.00	4.94
6	300263	隆华节能	3,988,422	97,118,075.70	4.01
7	300315	掌趣科技	2,897,102	80,945,029.88	3.34
8	002358	森源电气	5,711,322	79,002,131.04	3.26
9	002303	美盈森	2,003,316	77,688,594.48	3.21
10	300157	恒泰艾普	3,999,243	75,865,639.71	3.13

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	99,750,000.00	4.12
	其中:政策性金融债	99,750,000.00	4.12
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	99,750,000.00	4.12

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	99,750,000.00	4.12

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6月14日安徽盛运机械股份有限公司发布公告:2013年6月9日,公司高管收到中国证券监督管理委员会上海稽查局下达的《调查通知书》(编号:沪调查通字2013-2-012号),通知内容如下:"刘玉斌:因调查需要,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,我会决定对你涉嫌泄露内幕信息立案调查,请予以配合"。

本基金管理人通过对该上市公司进行进一步了解和分析,认为本基金已经持有盛运股份较长时间,主要是基于国家大力发展新兴产业的政策,且盛运股份又是环保行业中垃圾处理领域的龙头公司,基金管理人长期看好环保行业的发展前景及该公司的长期投资价值。根据该公司公告,高管被立案调查是由于个人原因、对公司生产经营没有影响,因此,该事项不影响我们对该公司长期投资价值的判断。

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	863,794.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,442,534.39
5	应收申购款	27,009,234.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,315,563.58

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	002358	森源电气	38,744,000.00	1.60	非公开发行
2	300315	掌趣科技	80,945,029.88	3.34	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	2,595,078,293.28
报告期间基金总申购份额	698,739,782.36
减:报告期间基金总赎回份额	1,650,698,519.04
报告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	1,643,119,556.60

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	-1,780,524.87	0.00%
合计			-1,780,524.87	

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,由黄小蕤女士代任。

2.2013年9月27日,基金管理人发布高级管理人员任职公告,黄小蕤女士自2013年9月24日起正式担任公司总经理。

3.基金管理人于2013年6月28日收到证监会上海稽查局编号为沪调查通字[2013]-2-023号的调查通知书,该通知书内容为:"因调查需要,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,我会决定对你司所管理的基金在交易'盛运股份'中涉嫌违反《证券法》的有关行为进行立案调查,请予以配合。"

据公司了解,该调查通知书所涉及的基金和行为为新兴产业基金于2011年2月期间的交易行为,该交易行为对该基金投资人利益未造成损失。为配合案件调查,公司已暂停郭鹏飞的基金经理职务,由公司具有基金经理任职资格的其他基金经理代理。

§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。

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

华宝兴业可转债债券型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	华宝兴业可转债债券
基金主代码	240018
交易代码	240018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
报告期末基金份额总额	398,639,603.23份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,主要通过对可转债的投资,力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金采用自上而下的宏观投资策略,通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,在固定收益类资产和权益类资产之间进行动态灵活配置。本基金将采用定性与定量相结合的方法来构建可转债投资组合,重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品种。
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金,本基金重点配置可转债,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	招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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	13,468,967.17
2.本期利润	18,359,332.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0483
4.期末基金资产净值	410,349,047.71
5.期末基金份额净值	1.0294

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。

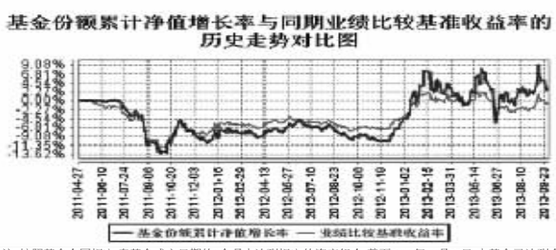
3.2 基金净值表现

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	4.94%	0.88%	1.47%	0.38%	3.47%	0.50%

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4月27日 至 2013年9月30日)



注:按照基金合同规定,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10月27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		
华志贵	本基金基金经理	2011年4月27日	-	9年	硕士,1999年7月至2000年8月在上海广电股份有限公司从事技术、市场工作,2004年5月至2008年7月在上海东方证券股份有限公司从事证券投资工作,2008年8月至2009年9月在中欧基金管理有限公司从事证券投资工作。2009年9月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任高级分析师,华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理,华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理,2010年6月至2011年11月任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2010年6月至2013年4月任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2011年4月起任华宝兴业可转债债券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、《华宝兴业可转债债券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

三季度,宏观经济处于向好阶段,尤其是经历6月底的流动性紧张后,政府适当调节了资金市场。社会融资总量及信贷量等都保持在较好水平,推动经济指标稳步向好,尤其是8月份数据略超预期。

可转债市场,经历6月底的超跌后,三季度稳步上涨,市场预期经济向好是短期不可持续的,9月底出现了迅速回落,尤其是周期相关品种。机会只存在于个别券种,尤其是非周期的弹性较大的品种。

基金在6月底提高了仓位,但在中途的涨涨跌跌中过度强调节奏而失去了对方向、战略头寸等交易策略的关注,在8月底开始的上涨中没有最大化进攻头寸,9月底减仓不够果断,但整个大的方面还是较好地把握了上涨节奏。

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4.94%,同期业绩比较基准收益率为1.47%,基金表现领先业绩基准3.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看,四季度宏观经济存在不确定性,比如美国债务上限谈判及中国地方政府对GDP的追求程度。但宏观经济整体还是维持稳的格局,只要流动性不出现收紧,宏观经济平稳可期。

下一阶段,本基金将继续跟踪个券的正股情况,并积极调整个券结构,控制仓位,以对个券的把握和大级别方向感的节奏把握作为策略重点,力争为投资者创造更好的回报。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	520,286,272.13	96.24
	其中:债券	520,286,272.13	96.24
	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	17,219,092.03	3.19
6	其他资产	3,107,247.56	0.57
7	合计	540,612,611.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	24,937,500.00	6.08
	其中:政策性金融债	24,937,500.00	6.08
4	企业债券	157,461.00	0.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	495,191,311.13	120.68
8	其他	-	-
9	合计	520,286,272.13	126.79

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	110022	同仁转债	792,150	105,870,847.50	25.80
2	110016	川投转债	809,850	102,543,207.00	24.99
3	110023	民生转债	913,140	96,619,343.40	23.55
4	113003	重工转债	624,400	79,386,216.00	19.35
5	110015	石化转债	351,750	34,432,807.50	8.39

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国债期货交易情况说明

5.8.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.8.2 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 本期股指期货投资政策

本基金未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期股指期货投资评价

本基金未投资股指期货。

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	1,214,322.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,837,971.25
5	应收申购款	54,953.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,107,247.56

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	105,870,847.50	25.80
2	110016	川投转债	102,543,207.00	24.99
3	110023	民生转债	96,619,343.40	23.55
4	113003	重工转债	79,386,216.00	19.35
5	110015	石化转债	34,432,807.50	8.39
6	113002	工行转债	17,393,660.20	4.24
7	113001	中行转债	10,803,240.00	2.63
8	127001	海直转债	10,654,348.95	2.60
9	125089	深机转债	6,911,595.49	1.68
10	128001	泰尔转债	5,938,173.10	1.45
11	110011	歌华转债	5,649,831.00	1.38
12	110018	国电转债	4,603,689.40	1.12
13	110007	博汇转债	1,541,121.60	0.38
14	110020	南山转债	65,585.00	0.02
15	110012	海运转债	31,500.00	0.01

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	377,642,795.89
报告期间基金总申购份额	73,433,560.87
减:报告期期间基金总赎回份额	52,436,753.53
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	398,639,603.23

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,由黄小蕤女士代任。

2.2013年9月27日,基金管理人发布高级管理人员任职公告,黄小蕤女士自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;

华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业可转债债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业可转债债券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

华宝兴业资源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	华宝兴业资源优选
基金主代码	240022
交易代码	240022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月21日
报告期末基金份额总额	110,058,540.00份
投资目标	把握资源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。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对资源相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享资源稀缺性所带来的行业高回报。本基金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。本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况,将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,包括但不限于可转换债券、央行票据,以捕捉市场机会,提高基金资产的使用效率。
业绩比较基准	80%×中证内地资源主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。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	-2,765,183.64
2.本期利润	4,370,894.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0487
4.期末基金资产净值	91,000,716.22
5.期末基金份额净值	0.827

注:1.本期已实现收益指