# 华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014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:中国银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7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2014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 | 1,100,328,786.22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(2014年4月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 79,753,525.42 |
| 2.本期利润 | 109,714,844.92 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1026 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,997,959,445.56 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.8158 |

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。

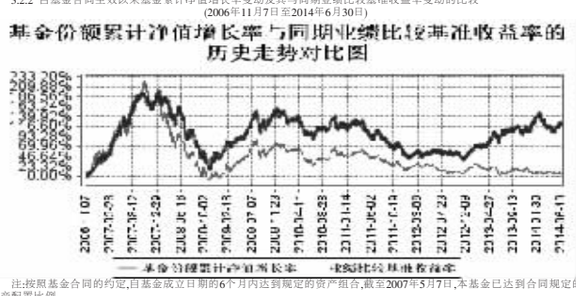
3.2 基金净值表现

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 | 6.13% | 1.19% | 0.74% | 0.77% | 5.39% | 0.42% |

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2014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 | | |
| 朱亮 | 本基金基金经理、华宝兴业基金基金经理、华宝兴业创新股票基金经理 | 2012年6月1日 | - | 8年 | 硕士。曾在信多利技(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月起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月起兼任华宝兴业创新优选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

2014年二季度,市场整体表现为上涨,但以创业板和中小板为代表的成长股表现要明显好于以上证指数和沪深300为代表的大盘蓝筹股。在此期间,上证综指和沪深300指数分别上涨0.32%和0.61%;深成指、中小板指数和创业板指数分别上涨2.48%、4%和5.58%。分行业来看,国防军工、通信、计算机的行业指数涨幅超过10%;交通运输、纺织服装和商业贸易等行业指数表现较差,跌幅超过3%。成长股内部也出现很大分化,前几年的大牛股如歌尔、大华、富瑞等继续下跌,而以智慧城市、医疗服务、电动车等代表的新成长股相对强势,股价屡创新高。我们认为,这其中细分行业景气度的变化是股价表现的内因,而整个市场存量资金的博弈,放大了细分板块间的股价表现。

报告期间,我们总体仓位波动不大,维持在较高的水平,并增持了一些业绩超预期的高成长性个股。同时,我们也减持了一些业绩不达预期的个股。

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6.13%,同期业绩比较基准收益率为0.74%,基金表现领先于基准5.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来,伴随着房地产投资增速的不断下滑,政府又开始从信贷和投资方面开始一些微刺激动作,以期对冲房地产投资增速下滑对经济的负面影响。展望三季度,我们预计经济有可能在政策的再次干预下出现企稳,这将有利于市场短期企稳。但是,从目前来看,中国经济仍然处在增速下滑的通道,A股,尤其是与宏观经济息息相关的大盘蓝筹股仍难以有较好的表现,而成长股也需要时间来消化其较高的估值。但从更长远一点来看,我们仍然对未来几年的股市表现有很大信心,主要是我们处在以电动车、页岩气、智能手机等代表的席卷全球的技术创新、以移动互联网代表的商业模式创新,以及中国深化改革带来的制度创新的三曲共奏中,这必将对股市有着长期积极的影响。

我们仍坚持以成长股为核心配置的策略,紧密跟踪各行业景气度变化,精选优秀的公司,坚定长期持有,分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。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 | 1,576,282,755.07 | 78.05 |
| | 其中:股票 | 1,576,282,755.07 | 78.05 |
| 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 | 92,550,366.28 | 4.58 |
| | 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 | 259,385,865.05 | 12.84 |
| 7 | 其他资产 | 91,482,684.33 | 4.53 |
| 8 | 合计 | 2,019,701,670.73 | 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 | 50,410,207.22 | 2.52 |
| C | 制造业 | 571,407,307.20 | 28.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,316,300.64 | 0.57 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 45,892,202.95 | 2.30 |
| 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 | 380,343,877.01 | 19.04 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 22,049,464.50 | 1.10 |
| L | 租赁和商务服务业 | 225,025,203.80 | 11.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,238,990.72 | 0.91 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 196,461,819.24 | 9.83 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 13,035,662.90 | 0.65 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 42,101,718.89 | 2.11 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,576,282,755.07 | 78.89 |

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 | 5,433,719 | 158,936,280.75 | 7.95 |
| 2 | 002400 | 省广股份 | 3,700,000 | 90,946,000.00 | 4.55 |
| 3 | 300090 | 盛运股份 | 5,719,023 | 90,074,612.25 | 4.51 |
| 4 | 002707 | 众信旅游 | 900,000 | 81,000,000.00 | 4.05 |
| 5 | 300212 | 易华录 | 2,450,000 | 76,734,000.00 | 3.84 |
| 6 | 002065 | 东华软件 | 3,664,748 | 73,734,729.76 | 3.69 |
| 7 | 300054 | 鼎龙股份 | 5,551,723 | 67,175,848.30 | 3.36 |
| 8 | 300026 | 红日药业 | 1,929,789 | 56,542,817.70 | 2.83 |
| 9 | 300058 | 蓝色光标 | 1,999,970 | 53,079,203.80 | 2.66 |
| 10 | 300157 | 恒泰艾普 | 3,609,783 | 46,710,592.02 | 2.34 |

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序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 | 548,111.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | 90,578,198.78 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 83,584.24 |
| 5 | 应收申购款 | 272,789.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 91,482,684.33 |

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 | 002707 | 众信旅游 | 81,000,000.00 | 4.05 | 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 | 1,090,717,726.06 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 75,378,384.60 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 65,767,324.44 |
| 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 | 1,100,328,786.22 |

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 | 565,568.07 |
| 报告期期间买入申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 565,568.07 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.05 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §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。

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**
2014年7月18日

# 华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014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:2014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2014年7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2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华宝兴业收益增长混合 |
| 基金主代码 | 240008 |
| 交易代码 | 240008 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年6月15日 |
| 报告期末基金份额总额 | 872,484,638.20份 |
| 投资目标 | 投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,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。股票投资部分采用定量与定性分析相结合,行业配置与定期调整策略;债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。 |
| 业绩比较基准 | 65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。 |
| 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(2014年4月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,375,441.74 |
| 2.本期利润 | 32,529,889.90 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0365 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,467,911,880.84 |
| 5.期末基金份额净值 | 3.9748 |

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。

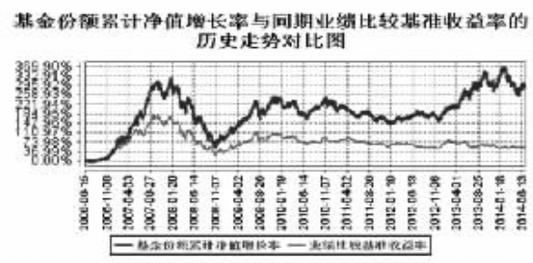
3.2 基金净值表现

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 | 1.04% | 1.49% | 0.58% | 0.51% | 0.46% | 0.98% |

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6月15日至2014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2006年12月15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 | | |
| 邵喆阳 | 助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业服务优选基金基金经理、华宝兴业生态股票基金经理 | 2010年6月26日 | - | 8年 | 硕士,拥有CFA资格。2005年7月至2006年12月任安永会计师事务所审计员。2006年12月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任行业分析师、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理、国内投资部副总经理的职务。2010年6月至今任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理,2013年6月起兼任华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金经理,2014年6月起任助理投资总监,兼任华宝兴业生态中国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、《华宝兴业收益增长混合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

2014年二季度,市场整体先经历了一轮较大幅度的调整,成长股跌幅居前,之后随着证监会宣布今年计划发行的新股数量少于普遍预期以及国内宏观政策有微调迹象,市场开始止跌回升,小市值股票、次新股表现活跃,二季度我们仍将投资的重心放在挑选转型受益的行业中能为投资者创造长期价值的优秀公司,持仓结构偏向于传媒、计算机、医药、环保等板块,仓位总体保持在较高水平,坚定持有我们长期看好的公司。

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1.04%,同期业绩比较基准收益率为0.58%,基金表现超越业绩比较基准0.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年二季度,收益增长业绩前低后高,总体不尽如人意,还没有从一季度的低谷中走出来。我们在2013年年报中预计的各种不利因素还在持续兑现,遗憾的是我们还是显得反应略慢,对此我们感到很愧疚。

A股市场本质上是一个博弈的市场,但我们并不愿意去这么做,我们反复梳理我们的组合,坚持我们觉得应该坚持的部分。同时不断放宽我们的视野去寻找新的投资标的来纳入组合,为组合注入新鲜血液。

展望未来,我们将坚持我们一贯的投资理念,继续将投资的重心放在转型受益的行业中挑选能为投资者创造长期价值的优秀公司上,并通过坚定持有我们长期看好的公司来为基金持有人获得长期的回报。

收益增长基金的组合较年初和一季度末有较大的变化,亦是反映我们应对市场变化所做的努力。虽然我们承认这样的调整稍显迟钝,并且我们也不确定调整是否已经到位,也不确定目前的组合是否能帮助收益增长基金在下半年重新回到市场排名的前列。无论如何,我们始终以为收益增长基金的持有人创造收益作为己任,不会放弃努力。感谢持有人对我们的宽容和信任。

### §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 | 2,914,222,616.57 | 83.22 |
| | 其中:股票 | 2,914,222,616.57 | 83.22 |
| 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 | 259,200,604.80 | 7.40 |
| | 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 | 305,783,024.73 | 8.73 |
| 7 | 其他资产 | 22,439,947.42 | 0.64 |
| 8 | 合计 | 3,501,646,193.52 | 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 | 44,397,284.20 | 1.28 |
| C | 制造业 | 555,884,806.16 | 16.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 12,134,250.36 | 0.35 |
| F | 批发和零售业 | 109,409.60 | 0.00 |
| 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 | 1,348,650,180.19 | 38.89 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 532,889,715.28 | 15.37 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 192,115,126.71 | 5.54 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 150,857,283.54 | 4.35 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 77,184,560.53 | 2.23 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,914,222,616.57 | 84.03 |

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 | 300058 | 蓝色光标 | 10,400,930 | 276,040,682.20 | 7.96 |
| 2 | 002400 | 省广股份 | 9,347,826 | 229,769,563.08 | 6.63 |
| 3 | 300315 | 掌趣科技 | 12,701,091 | 226,841,485.26 | 6.54 |
| 4 | 002065 | 东华软件 | 10,023,052 | 201,663,806.24 | 5.82 |
| 5 | 300070 | 碧水源 | 6,499,467 | 190,109,409.75 | 5.48 |
| 6 | 300170 | 汉得信息 | 11,513,656 | 148,526,162.40 | 4.28 |
| 7 | 300244 | 迪安诊断 | 3,335,778 | 146,007,003.06 | 4.21 |
| 8 | 300253 | 卫宁软件 | 3,254,094 | 142,919,808.48 | 4.12 |
| 9 | 600446 | 金证股份 | 4,608,350 | 141,660,679.00 | 4.08 |
| 10 | 300287 | 飞利信 | 4,500,028 | 125,010,777.84 | 3.60 |

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。

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 | 921,760.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 19,776,863.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 161,062.31 |
| 5 | 应收申购款 | 1,580,261.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,439,947.42 |

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 | 300253 | 卫宁软件 | 142,919,808.48 | 4.12 | 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 | 945,625,699.69 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 37,423,780.43 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 110,564,841.92 |
| 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 | 872,484,638.20 |

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 | 353,437.80 |
| 报告期期间买入申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 353,437.80 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.04 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §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;

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业收益增长混合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**
2014年7月18日

# 华宝兴业现金宝货币市场基金

## 2014 第二季度 报告

2014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:2014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2014年7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2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华宝兴业现金宝货币 |
| 基金主代码 | 240006 |
| 交易代码 | 240006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年3月31日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,844,936,539.60份 |
| 投资目标 | 保持本金的安全性与流动性,追求高于比较基准的收益率。 |
| 投资策略 | 以对宏观经济及利率走势的判断为基础,在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具,优化组合配置效果,实现组合增值。 |
| 业绩比较基准 | 同期7天通知存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。 |
| 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 |
| 下属两级基金的基金简称 | 华宝兴业现金宝货币A / 华宝兴业现金宝货币B |
| 下属两级基金的交易代码 | 240006 / 240007 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 489,118,227.07份 / 5,355,818,312.53份 |

### §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(2014年4月1日 - 2014年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 华宝兴业现金宝货币A | 华宝兴业现金宝货币B |
| 1. 本期已实现收益 | 5,847,680.08 | 92,888,962.45 |
| 2.本期利润 | 5,847,680.08 | 92,888,962.45 |
| 3.期末基金资产净值 | 489,118,227.07 | 5,355,818,312.53 |

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业现金宝货币A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 1.0190% | 0.0038% | 0.3366% | 0.0000% | 0.6824% | 0.0038% |

注:基金收益分配是按日结转份额。

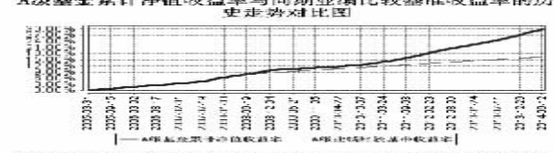
华宝兴业现金宝货币B

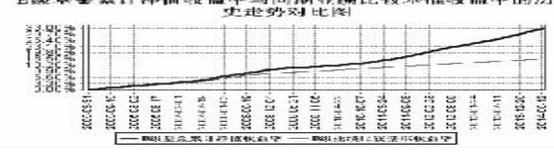
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.0797% | 0.0038% | 0.3366% | 0.0000% | 0.7431% | 0.0038% |

注:基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2005年3月31日至2014年6月30日)




注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日,本基金已根据基金合同规定完成建仓,资产配置比例符合基金合同约定。

### §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 | | |
| 陈