华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31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	107,785,755.31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(2014年10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	5,381,528.20
2.本期利润	13,570,993.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.1441
4.期末基金资产净值	108,626,073.34
5.期末基金份额净值	1.008

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。

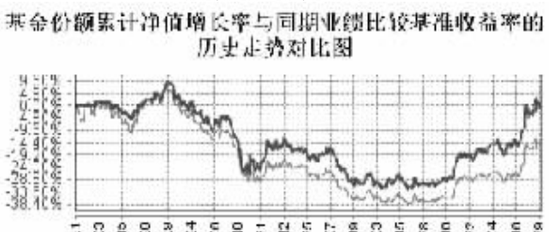
3.2 基金净值表现

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	18.59%	1.56%	16.50%	1.49%	2.09%	0.07%

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8月21日至2014年12月31日)



注:按照基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截至2013年2月21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		
蔡目荣	本基金基金经理	2012年8月21日	-	11年	硕士,曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作,2008年6月进入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理和交易员的职务,2012年8月起任华宝兴业资源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、《华宝兴业资源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

2014年四季度国内经济继续低迷,虽然上半年国内政策已经开始定向宽松,但由于实体经济(尤其是小企业及传统行业企业)融资难、融资贵的问题依然没有有效解决;同时房地产行业不景气也导致相关产业链上的企业压力重重,从10月份以来的主要经济数据看,国内固定资产投资、进出口和工业企业利润同比数据都在不断恶化,经济低迷状况继续持续。经济低迷一方面是国内经济结构调整的结果,同时也受环保、反腐等多重因素影响。从外围经济体看,美国公布的3季度GDP终值再次超市场预期,增长依然强劲,在油价下跌情况下,预计4季度经济增速还会维持强势,欧洲和日本经济增长从二季度开始增长有乏力迹象,四季度经济数据预计依然一般。

A股市场四季度持续上涨,上证指数涨幅最大,中小板和创业板指数下跌。四季度市场上涨的主要推动力是非银行金融以及"一带一路"主题的建筑行业,另外银行、交运和地产表现也比较突出,市场上涨的内在驱动力还是传统行业长期下跌后的价值重估。四季度上证指数涨幅36.84%,深成指涨幅36.31%,创业板指数涨幅-4.49%,内地资源指数涨幅20.34%,中信煤炭指数跌幅20.89%,中信有色指数跌幅10.86%。

四季度资源板块表现不如主板指数,煤炭行业在政府采取了整治超产等限产措施后煤价出现了持续上涨,报告期内煤炭板块表现好于有色板块。由于四季度本基金大部分时间维持了较高仓位,报告期内本基金跑赢了行业基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本报告期内基金份额净值涨幅为18.59%,基金基准涨幅为16.50%,基金表现领先基准2.09%。

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2015年,中央及地方政府为了稳定经济,采取降息、放松地产限购等较为宽松政策,在经济持续低迷状况下,预期未来货币政策方面还会继续宽松。另外由于原油价格下跌,国内传统行业成本将会有效降低;同时预计2015年国企改革也会明显加速,相关企业活力有望得到释放;地产放松政策可以在一定程度上刺激房地产销售好转,预计2015年国内经济有望逐步企稳。从国外看,预计美国继续维持复苏,欧洲和日本经济恢复虽然减弱,但目前看2015年还会保持稳定。目前看最大的风险是在原油价格暴跌情况下,俄罗斯及其他主要产油国经济能否承受住原油出口收入下滑带来的影响。

对于A股市场来说,4季度主板股票经过两年多压制后出现了报复性估值修复,市场短期上涨过快后会有压力。但由于中国居民资产配置股市依然很低,同时国内经济处于底部,未来股市依然具有良好的投资机遇。对资源板块来说,4季度已经出现了部分估值修复,未来板块可能还会有阶段性机会,但行业基本面不景气可能会制约未来表现。未来本基金配置上主要偏向于投资资源行业里面景气但处于底部,未来有望复苏的子行业;同时重点关注未来有望受益于新经济发展方向的自然资源,受益于环保监管加强带来供给约束的资源类子行业。另外我们也会密切关注国企改革为企业行业及上市公司带来的投资机会。2015年我们将努力寻找自然资源领域新的投资机会,为投资人创造好的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警。

§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	85,296,214.54	75.82
	其中:股票	85,296,214.54	75.82
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	26,086,272.91	23.19
7	其他资产	1,113,329.08	0.99
8	合计	112,495,816.53	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	57,721,612.00	53.14
C	制造业	25,092,122.54	23.10
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	1,134,000.00	1.04
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	1,348,480.00	1.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	85,296,214.54	78.52

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	601088	中国神华	435,000	8,826,150.00	8.13
2	000937	冀中能源	665,000	5,546,100.00	5.11
3	601699	潞安环能	473,600	5,465,344.00	5.03
4	600123	兰花科创	522,000	5,376,600.00	4.95
5	600348	阳泉煤业	600,000	5,322,000.00	4.90
6	601898	中煤能源	540,000	3,736,800.00	3.44
7	600549	厦门钨业	101,323	3,341,632.54	3.08
8	000983	西山煤电	360,000	2,959,200.00	2.72
9	600352	浙江龙盛	120,000	2,361,600.00	2.17
10	601666	平煤股份	370,000	2,231,100.00	2.05

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	23,278.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,433.70
5	应收申购款	1,086,617.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,113,329.08

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

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	101,153,665.09
报告期间基金总申购份额	68,142,575.51
减:报告期期间基金总赎回份额	61,510,485.29
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	107,785,755.31

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	422,523.24
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	422,523.24
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.39

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;

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业资源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。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所及基金托管人住所备投资者查阅。

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1月22日

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31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	869,107,286.84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10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	262,406,676.70
2.本期利润	-44,173,774.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0414
4.期末基金资产净值	1,755,965,767.41
5.期末基金份额净值	2.0204

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。

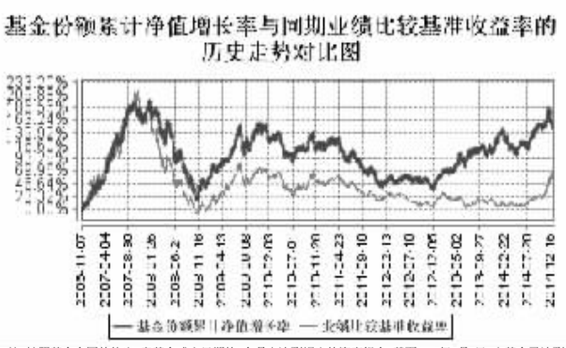
3.2 基金净值表现

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	-2.45%	1.68%	37.00%	1.55%	-39.45%	0.13%

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12月31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		
朱兆	本基金基金经理,华宝兴业新兴产业基金基金经理,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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2014年四季度,A股走出了一波波澜壮阔的行情,报告期内,上证指数上涨40.50%,深成指上涨6.48%,沪深300上涨45.09%,中小板指数下跌3.38%,创业板下跌5.90%。上证综指的表现大幅好于创业板指数,并创出了2013年下半年以来的新高,行情主要在降息后开始明显表现。板块和热点表现方面,非银涨幅112%,建筑82%,银行54.8%,地产40%,其他包括交运、钢铁、电力、石油石化、煤炭等热点炒作此起彼伏,电子元器件、传媒、轻工、计算机等行业跌幅居前。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。我们增持了一些业绩超预期的高成长性个股,同时减持了一些业绩不达预期的个股,但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-2.45%,基金基准涨幅为37.00%,基金表现落后基准39.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度,综合估值、流动性、政策调整预期等方面,A股这波翻转走势从2014年年中启动,可能仍将持续到2015年一季度,同时随着市场走高,叠加杠杆资金入市,波动可能会加大。A股市场风格短期可能还是不会转向中小盘。除了估值依然高、部分中小市值板块基本面面临问题之外,注册制等制度推进,新股发行节奏可能加快等均将对高估值中小盘不利,市场环境依然更有利于低估值蓝筹股。A股市场当前风格可能还是有利于利率敏感的板块,包括金融、地产及地产产业链,我们也关注滞涨的板块,比如医药等,同时关注中小盘、创业板跌出来的机会。2015年一季度值得注意的事件和数据:一月中下旬披露2014年数据,关注政策继续调整的可能;一月中旬开始上市公司陆续披露年报;地方和中央"两会"将陆续在2月份、3月份召开;国企改革总体方案及"一带一路"规划等可能在年初发布;注册制征求意见稿、指数期权正式文件等在一季度可能发布;新股发行的节奏可能加快。总体上,这些进展可能会继续显示中国政策在积极应对增速下滑,同时改革也在持续发力,对大盘蓝筹股有利,而相对不利高估值中小盘个股。

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,寻找利率敏感行业中的较好公司,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

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警。

§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	1,393,447,356.33	78.44
	其中:股票	1,393,447,356.33	78.44
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	331,598,514.35	18.67
7	其他资产	51,423,047.41	2.89
8	合计	1,776,468,918.09	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	32,740,661.25	1.86
C	制造业	613,103,051.02	34.92
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	36,430,711.20	2.07
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	441,337,629.79	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,450,000.00	0.94
L	租赁和商务服务业	174,095,718.03	9.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,235,538.22	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,914,046.82	1.42
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	22,140,000.00	1.26
	合计	1,393,447,356.33	79.36

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	300226	上海钢联	1,989,420	120,101,285.40	6.84
2	002707	众信旅游	878,491	105,594,618.20	6.01
3	300212	易华录	2,399,928	66,094,017.12	3.76
4	300054	鼎龙股份	5,001,108	65,714,559.12	3.74
5	300253	卫宁软件	933,817	65,339,175.49	3.72
6	600651	飞乐音响	7,500,000	61,350,000.00	3.49
7	002712	思美传媒	1,268,183	58,349,099.83	3.32
8	300380	安硕信息	685,803	44,097,132.90	2.51
9	300170	汉得信息	3,225,238	42,637,646.36	2.43
10	600305	恒顺醋业	2,300,000	41,768,000.00	2.38

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。

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	666,801.76
2	应收证券清算款	50,239,375.78
3	应收股利	-
4	应收利息	87,000.90
5	应收申购款	429,868.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,423,047.41

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	300170	汉得信息	42,637,646.36	2.43	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	1,133,964,452.04
报告期间基金总申购份额	66,974,553.68
减:报告期期间基金总赎回份额	331,831,718.88
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	869,107,286.84

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(%)	0.07

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办公场所及基金托管人住所备投资者查阅。

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1月22日

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

2014 第四季度 报告

2014年12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:2015年1月22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1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝油气
场内简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年9月29日
报告期末基金份额总额	189,681,112.73份
投资目标	通过严格的指数化投资策略,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过5%(以美元资产计价)。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足、导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数(人民币计价)
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York,NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York,NY10286
邮政编码		-	NY10286

§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10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-6,054,538.14
2.本期利润	-20,700,010.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2534
4.期末基金资产净值	144,036,310.57
5.期末基金份额净值	0.759

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