华宝兴业现金宝货币市场基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:2016年4月20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2016年4月18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2016年1月1日起至3月31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	8,104,015,695.89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		
下属分级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B	华宝兴业现金宝货币E
下属分级基金的交易代码	240006	240007	000678
报告期末下属分级基金的份额总额	184,892,499.67份	1,009,094,734.11份	6,910,028,462.11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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)		
	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B	华宝兴业现金宝货币E
1. 本期已实现收益	1,215,183.34	6,992,954.88	39,159,000.81
2. 本期利润	1,215,183.34	6,992,954.88	39,159,000.81
3. 期末基金资产净值	184,892,499.67	1,009,094,734.11	6,910,028,462.11

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	0.6145%	0.0014%	0.3357%	0.0000%	0.2788%	0.0014%

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	0.6747%	0.0014%	0.3357%	0.0000%	0.3390%	0.0014%

注:基金收益分配是按日结转份额。

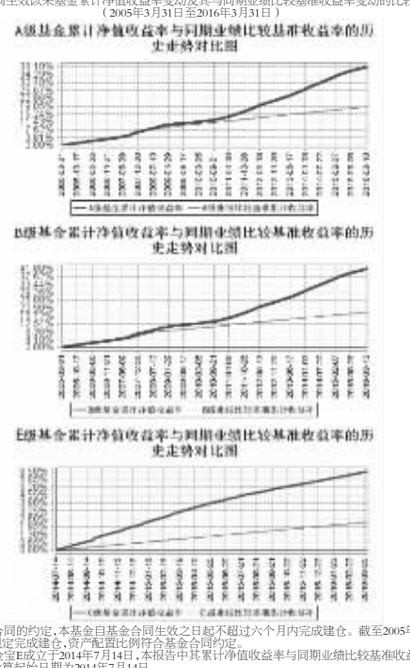
华宝兴业现金宝货币E

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	0.6748%	0.0014%	0.3357%	0.0000%	0.3391%	0.0014%

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2016年3月31日)



注:1.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。

2. 华宝兴业现金宝E成立于2014年7月14日,本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图的数据的计算起始日期为2014年7月14日。

§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		
陈昕	固定收益部副总经理、本基金基金经理、华宝添益基金经理	2011年11月15日	-	12年	经济学学士。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在清算登记部,交易部,固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易、投资工作。2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理,2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2012年6月至2014年2月兼任华宝兴业中证短融36债券基金基金经理,2012年12月起兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。2015年3月任固定收益部副总经理。

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、《货币市场基金管理暂行规定》、《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》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 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来,央行通过下调3M到1Y的MLF基准利率、2月未重启降准、春节前开始启动每日的公开市场操作等多项政策和措施,不断向市场释放结构性宽松的信号。在此引导下,市场流动性整体宽裕,银行间隔夜和7天回购利率中枢稳定在1.9%和2.3%附近,不过和去年四季度相比,资金面在可转债打新、春节和季末效应、央行MPA考核等因素扰动下,整体波动加大,短期资金成本小幅抬升。通胀和短期经济动能的预期分歧导致利率债呈现震荡走势,信用债则在机构旺盛的配置需求下,无论是高评级品种,还是低评级品种收益率均全面下行,信用利差继续缩窄。

随着年初以来权益市场波动加剧,市场风险偏好下降,本基金在报告期内管理规模有所增长。报告期间,本基金保持了中性的久期配置,资产配置上仍以同业存款为主,同时流动性分布上注意应对季末等时点性的冲击,整体运行平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

现金宝A:本基金报告期内净值收益率为0.6145%,同期业绩比较基准收益率为0.3357%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

现金宝B:本基金报告期内净值收益率为0.6747%,同期业绩比较基准收益率为0.3357%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

现金宝E:本基金报告期内净值收益率为0.6748%,同期业绩比较基准收益率为0.3357%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

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	固定收益投资	2,456,539,493.10	29.10
	其中:债券	2,456,539,493.10	29.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	423,361,475.05	5.01
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,502,047,200.33	65.17
4	其他资产	60,959,282.25	0.72
5	合计	8,442,907,450.73	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.05	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	334,759,392.62	4.13
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	27.75	4.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	23.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	21.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	15.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.43	4.13

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	100,293,325.31	1.24
3	金融债券	610,312,197.13	7.53
	其中:政策性金融债	610,312,197.13	7.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	819,981,221.35	10.12
6	中期票据	-	-
7	同业存单	925,952,749.31	11.43
8	其他	-	-
9	合计	2,456,539,493.10	30.31
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111691212	16南京银行CD015	4,000,000	389,314,098.44	4.80
2	111607044	16招行CD044	2,000,000	194,787,353.67	2.40
3	111610038	16上海银行CD038	2,000,000	194,662,879.49	2.40
4	140431	14农发31	1,500,000	150,229,444.27	1.85
5	150413	15农发13	1,500,000	149,964,033.37	1.85
6	150416	15农发16	1,300,000	129,994,983.08	1.60
7	1001060N	10央票60续	1,000,000	100,293,325.31	1.24
8	011520003	15中证SCP003	1,000,000	99,998,042.58	1.23
9	011574005	15民煤于SCP005	1,000,000	99,996,786.61	1.23
10	011621011	16德商银行CD011	1,000,000	97,311,369.59	1.20

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1078%
报告期内偏离度的最低值	0.0570%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0859%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2

本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3

现金宝货币基金截至2016年3月31日持仓前十名证券中的16南京银行CD015(111691212)发行主体南京银行股份有限公司于2016年3月21日收到江苏证监局《关于对南京银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》。因公司个别支行基金宣传推介材料存在违规情形,未出具年度监察稽核报告,有2项关于基金销售的管理制度未向江苏证监局报备,基金销售业务规范执行不到位等问题,采取出具责令改正的行政监管措施,同时责令进行改正。

现金宝货币基金截至2016年3月31日持仓前十名证券中的16招行CD044(111607044)发行主体招商银行股份有限公司于2016年1月9日收到吉林证监局《关于对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定》。由于吉林省分行在从业人员的资格,销售材料,业务流程等多项内容上存在问题,现要求对上述行为进行改正,并于2016年1月31日前,向吉林证监局提交整改情况的书面报告,并等待检查验收。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分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上述证券的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	52,696,764.55
4	应收申购款	8,262,517.70
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	60,959,282.25

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B	华宝兴业现金宝货币E
报告期期初基金份额总额	231,583,823.50	1,094,200,191.59	6,235,971,759.88
报告期期间基金总申购份额	81,688,536.68	54,046,412.36	5,019,169,951.55
报告期期间基金总赎回份额	128,379,860.51	139,151,869.84	4,345,113,249.32
报告期期末基金份额总额	184,892,499.67	1,009,094,734.11	6,910,028,462.11

注:总申购份额含份额级别调整、转换入份额和红利再投;总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§7 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交易明细

§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;

华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同;

华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书;

华宝兴业现金宝货币市场基金托管协议;

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
2016年4月20日

华宝兴业先进成长混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:2016年4月20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2016年4月18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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝先进成长混合
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	559,193,346.91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	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-325,778,639.42
2.本期利润	-525,806,311.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8735
4.期末基金资产净值	1,703,475,410.23
5.期末基金份额净值	3.0463

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。

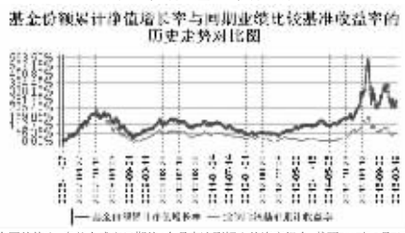
3.2 基金净值表现

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	-21.24%	3.09%	-15.13%	2.53%	-6.11%	0.56%

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2016年3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		
季鹏	本基金基金经理、华宝国策导向混合基金经理、华宝兴业新配置混合基金经理	2015年5月7日	-	10年	硕士,拥有CFA资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理工作。2011年4月加入华宝兴业基金管理有限公司任高级策略分析师兼基金经理助理的职务。2013年8月起任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业先进成长混合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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度市场各指数整体处于下跌趋势:上证指数下跌15.12%,沪深300下跌13.75%,创业板下跌17.53%。整体行情在年初的3个月呈现出巨幅的震荡:人民币贬值、2015年年末降准预期落空、A股熔断机制等因素共同导致了新年以来的各指数系统性下跌,以上证指数和创业板指为例,整个1月份分别下跌了22.65%和26.53%。风险一定程度释放后,指数在2、3月份开始逐步企稳并走出一段小幅反弹行情。从结构上看,部分周期品特别是一些具有涨价逻辑的子行业以及优质成长股表现相对较好;同时,市场也表现出来一定的板块轮动现象。

本基金根据市场环境的变化,在不同阶段采取了相应的投资策略。1月份及时下调仓位,同时对一些个股兑现了前期的浮盈,保留了中长线看好的个股。2、3月份则适当提高了仓位,整体配置更加趋于均衡。一方面,增加了部分受涨价逻辑驱动的偏周期品种持仓,包括有色、化工中的一些小品种,取得了一定的正收益;同时,本基金适当减持了一些估值偏高的成长股,对于新兴产业主要还是精选优质个股,主要集中配置受益于经济改革、结构调整的相关板块,如影视传媒、体育、教育、云计算、智能制造等子行业。

4.5 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-13.73%,同期业绩比较基准收益率为-6.84%,基金表现落后基准6.89%。

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	1,301,196,629.35	75.38
	其中:股票	1,301,196,629.35	75.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	416,039,790.26	24.10
8	其他资产	8,843,721.39	0.51
9	合计	1,726,080,141.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	28,773,362.20	1.69
B	采矿业	24,929,500.00	1.46
C	制造业	598,600,139.57	35.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	39,061,000.00	2.29
F	批发和零售业	40,732,457.00	2.39
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	370,808,741.86	21.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,730,500.00	0.51
L	租赁和商务服务业	128,355,500.00	7.53
M	科学研究和技术服务业	421,800.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	20,474,400.00	1.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,464,000.00	1.49
Q	卫生和社会工作	3,937,500.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	10,907,728.72	0.64
S	综合	-	-
	合计	1,301,196,629.35	76.38

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

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	002712	思美传媒	750,000	75,030,000.00	4.40
2	002707	众信旅游	1,150,000	53,325,500.00	3.13
3	002612	朗姿股份	852,722	52,706,746.82	3.09
4	300253	卫宁健康	1,520,241	49,711,880.70	2.92
5	300379	东方通	681,600	49,347,840.00	2.90
6	300377	赢时胜	600,000	48,390,000.00	2.84
7	300409	道氏技术	720,000	47,700,000.00	2.80
8	300188	美亚柏科	1,350,000	40,122,000.00	2.36
9	300036	超图软件	920,000	38,318,000.00	2.25
10	002172	澳洋科技	2,700,000	34,047,000.00	2.00

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	1,882,679.50
2	应收证券清算款	6,478,063.27
3	应收股利	-
4	应收利息	100,271.34
5	应收申购款	382,707.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,843,721.39

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	002612	朗姿股份	52,706,746.82	3.09	重大事项筹划

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	639,536,850.10
报告期期间基金总申购份额	106,261,319.58
减:报告期期间基金总赎回份额	186,604,822.77
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	559,193,346.91

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	273,962.26
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	273,962.26
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;

华宝兴业先进成长混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业先进成长混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业先进成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
2016年4月20日

华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:2016年4月20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2016年4月18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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝稳健回报混合
基金主代码	000993
交易代码	000993
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月27日
报告期末基金份额总额	812,002,335.79份
投资目标	本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素,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。 2.股票投资策略 本基金采取积极的股票选择策略,将"自上而下"的行业配置策略和"自下而上"的股票精选策略相结合,根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断,进行投资组合的动态优化,实现基金资产长期稳定增值。 3.固定收益类投资工具投资策略 本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益类投资工具,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,在风险可控的前提下为争实现稳健的超额收益。 5.股指期货投资策略 本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险及特殊