华宝兴业新兴产业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	华宝新兴产业混合
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	365,459,847.89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跟踪,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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-171,697,382.52
2.本期利润	-226,901,509.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5672
4.期末基金资产净值	791,823,302.59
5.期末基金份额净值	2.1666

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。

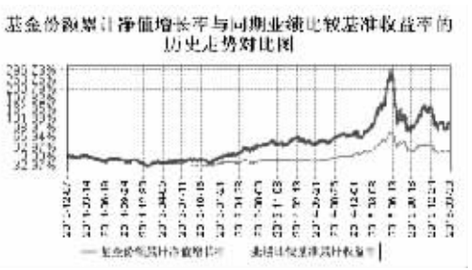
3.2 基金净值表现

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	-17.60%	3.01%	-12.77%	2.23%	-4.83%	0.78%

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		
易晓明	本基金基金经理	2015年4月9日	-	10年	博士研究生,曾在国泰君安证券、中海基金从事行业研究工作。2012年11月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理的职务。2015年4月起任华宝兴业新兴产业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、《华宝兴业新兴产业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1-2月份,固定资产投资完成额同比增长10.2%,前2个月固定资产投资增速微幅反弹。分行业来看,制造业投资完成额同比增速下降至7.5%,房地产开发投资完成额同比增速反弹至3%;制造业投资增速继续下滑但是降幅收窄,房地产投资增速表现颇丰,基建投资增速下滑至15%。房地产销售好转带动投资增速的回升,拉动固定资产投资增速的反弹。1-2月份出口金额同比下降17.8%,出口增速在1-2月份下降且降幅较大;1-2月份进口金额同比下降16.7%,进口增速较低表明内需很不乐观。1-2月份社会消费品零售总额同比增长10.2%,实际消费增速为9.6%,名义和实际消费增速均下滑。物价水平高于市场预期,2月份CPI为2.3%,1-2月份 CPI为2%,蔬菜和猪肉价格上涨是物价水平高于预期的主要原因。2月中央行降低存款准备金率,但是没有降低存贷款基准利率和央行7天公开市场操作利率。1月份信贷和社会融资总量放量,2月份央行开始控制信贷投放和社会融资总量增速,社会融资总量中信贷和债券融资占比较高,预计央行仍将会控制信贷投资节奏。债券收益率曲线出现陡峭化走势,利率债中长期收益率上升较多,短期较为稳定;高等级信用债收益率较为稳定,收益率微幅下降;中低等级信用债收益率下降幅度相对较大。市场投资主体在高收益率的资产减少之后将目光集中在收益率相对较高的中低等级信用债上面,导致中低等级信用债尤其是城投类债券收益率下降的最主要原因。1-2月份股市快速下跌,3月份股市企稳反弹,年前的四只存量转债价格全部下跌,新发可转债和可交换债券较多,转债市场扩容以及股市下跌导致转债估值的压缩,转债作为一个整体纯债溢价率和转股溢价率都偏高,配置价值有限,交易价值取决于股市走势。1季度股市整体下跌,3月份股市反弹,其中部分强周期品(煤炭、部分有色、钢铁)、VR相关品种、人工智能、自动驾驶以及和通胀相关的养殖等板块表现相对较好,其余板块表现较差。从风格指数来看,创业板要弱于主板。

2016年1季度增强收益债券基金降低了长期利率债的投资比例,提高了信用债的投资比例,降低了可转债的投资比例,提高了股票的配置比例。年初低配权益类资产取得较好的效果,后期增配权益类资产提供了他对正收益,但是后期权益类资产配置比例偏低,行业配置和个股选择能力有待提高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内增强收益A 基金份额净值增长率为1.56%,同期业绩比较基准收益率为0.27%;增强收益B 基金份额净值增长率为1.45%,同期业绩比较基准收益率为0.27%。

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	628,573,262.38	78.11
	其中:股票	628,573,262.38	78.11
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	171,068,749.07	21.26
8	其他资产	5,035,121.76	0.63
9	合计	804,677,133.21	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	-	-
B	采矿业	18,408,164.81	2.32
C	制造业	417,775,975.34	52.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,307,328.00	0.17
F	批发和零售业	18,544,078.06	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,116,870.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	111,261,439.47	14.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,090,966.20	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,111,988.88	0.14
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	47,454,446.62	5.99
S	综合	7,502,005.00	0.95
	合计	628,573,262.38	79.38

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资。

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	300017	网宿科技	941,627	55,000,433.07	6.95
2	300144	宋城演艺	1,490,437	43,610,186.62	5.51
3	300232	洲明科技	1,216,203	41,411,712.15	5.23
4	300296	利亚德	1,128,919	26,789,247.87	3.38
5	002665	首航节能	969,449	26,708,319.95	3.37
6	300299	富春通信	837,721	26,438,474.76	3.34
7	002612	朗姿股份	402,189	24,859,302.09	3.14
8	600584	长电科技	1,306,515	24,431,830.50	3.09
9	002452	长高集团	1,791,312	21,674,875.20	2.74
10	002635	安洁科技	741,300	19,184,844.00	2.42

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

14长证债(112232)于2015年5月22日收到湖北证监局关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定,因公司未与部分研究报告特约机构签订协议,公司部分研究报告的报送审核人员和对外发送渠道不符合公司内部规定,决定对公司采取出具警示函的监管措施;于2016年3月17日收到中国证监会湖北监管局《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》([2016]5号),因公司在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责,未按照相关约定,如实披露募集资金使用情况,上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》的规定,湖北证监局决定对公司采取出具警示函的监管措;于2016年3月23日收到全国中小企业股份转让系统《关于对长江证券采取出具警示函的监管措施》,因公司主办券商未严格履行投资者适当性管理义务,未健全投资者适当性管理工作制度和业务流程,未正确配置投资者交易权限及明确告知投资者可正常交易时点,构成违规。

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债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	105,089.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,865,438.49
5	应收申购款	453,553.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,424,081.46

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	468,445,279.83
报告期期间基金总申购份额	74,716,132.89
减:报告期期间基金总赎回份额	177,701,564.83
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	365,459,847.89

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;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	258,887.79
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	258,887.79
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;

华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金基金合同;

华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业新兴产业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
2016年4月20日

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
报告期末基金份额总额	327,046,623.71份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。	
业绩比较基准	中信债券总指数收益率	
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。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
下属分级基金的交易代码	240012	240013
报告期末下属分级基金的份额总额	94,526,511.09份	232,520,112.62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)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1.本期已实现收益	1,844,063.22	4,232,545.27
2.本期利润	1,885,352.60	4,317,024.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0225	0.0206
4.期末基金资产净值	137,732,291.97	329,189,065.99
5.期末基金份额净值	1.4571	1.4157

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

华宝兴业增强收益债券A

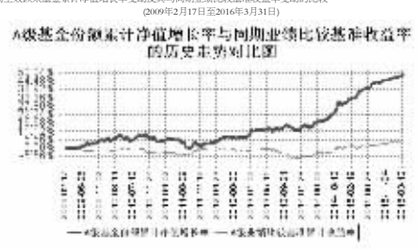
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.56%	0.06%	0.27%	0.10%	1.29%	-0.04%

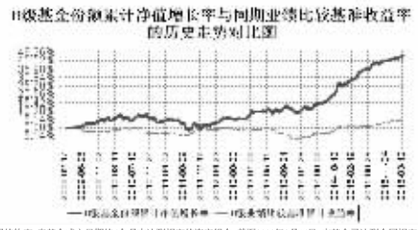
华宝兴业增强收益债券B

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	1.45%	0.06%	0.27%	0.10%	1.18%	-0.04%

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

(2009年2月17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2009年8月16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		
李栋梁	本基金基金经理,华宝兴业宝康债券、华宝新机遇混合、华宝新价值混合基金经理	2014年10月11日	-	13年	硕士,曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资,2010年9月加入华宝兴业基金管理有限公司固定收益部分析师,2010年12月至2011年6月任华宝兴业宝康债券基金经理助理,2011年6月起担任华宝兴业宝康债券基金经理;2014年10月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2015年10月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金、LOF和华宝兴业新价值灵活配置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、《华宝兴业增强收益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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年1-2月份,固定资产投资完成额同比增长10.2%,前2个月固定资产投资增速微幅反弹。分行业来看,制造业投资完成额同比增速下降至7.5%,房地产开发投资完成额同比增速反弹至3%;制造业投资增速继续下滑但是降幅收窄,房地产投资增速表现颇丰,基建投资增速下滑至15%。房地产销售好转带动投资增速的回升,拉动固定资产投资增速的反弹。1-2月份出口金额同比下降17.8%,出口增速在1-2月份下降且降幅较大;1-2月份进口金额同比下降16.7%,进口增速较低表明内需很不乐观。1-2月份社会消费品零售总额同比增长10.2%,实际消费增速为9.6%,名义和实际消费增速均下滑。物价水平高于市场预期,2月份CPI为2.3%,1-2月份 CPI为2%,蔬菜和猪肉价格上涨是物价水平高于预期的主要原因。2月中央行降低存款准备金率,但是没有降低存贷款基准利率和央行7天公开市场操作利率。1月份信贷和社会融资总量放量,2月份央行开始控制信贷投放和社会融资总量增速,社会融资总量中信贷和债券融资占比较高,预计央行仍将会控制信贷投资节奏。债券收益率曲线出现陡峭化走势,利率债中长期收益率上升较多,短期较为稳定;高等级信用债收益率较为稳定,收益率微幅下降;中低等级信用债收益率下降幅度相对较大。市场投资主体在高收益率的资产减少之后将目光集中在收益率相对较高的中低等级信用债上面,导致中低等级信用债尤其是城投类债券收益率下降的最主要原因。1-2月份股市快速下跌,3月份股市企稳反弹,年前的四只存量转债价格全部下跌,新发可转债和可交换债券较多,转债市场扩容以及股市下跌导致转债估值的压缩,转债作为一个整体纯债溢价率和转股溢价率都偏高,配置价值有限,交易价值取决于股市走势。1季度股市整体下跌,3月份股市反弹,其中部分强周期品(煤炭、部分有色、钢铁)、VR相关品种、人工智能、自动驾驶以及和通胀相关的养殖等板块表现相对较好,其余板块表现较差。从风格指数来看,创业板要弱于主板。

2016年1季度增强收益债券基金降低了长期利率债的投资比例,提高了信用债的投资比例,降低了可转债的投资比例,提高了股票的配置比例。年初低配权益类资产取得较好的效果,后期增配权益类资产提供了他对正收益,但是后期权益类资产配置比例偏低,行业配置和个股选择能力有待提高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内增强收益A 基金份额净值增长率为1.56%,同期业绩比较基准收益率为0.27%;增强收益B 基金份额净值增长率为1.45%,同期业绩比较基准收益率为0.27%。

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	9,359,348.10	1.82
	其中:股票	9,359,348.10	1.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	481,498,767.62	93.68
	其中:债券	481,498,767.62	93.68
	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	14,724,719.46	2.86
8	其他资产	8,424,081.46	1.64
9	合计	514,006,916.64	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,511,348.10	1.18
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	-	-
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	-	-
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	3,848,000.00	0.82
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	9,359,348.10	2.00

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本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	300284	苏交科	200,000	3,848,000.00	0.82
2	603008	喜临门	181,734	3,298,472.10	0.71
3	002415	海康威视	71,800	2,212,876.00	0.47

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	8,765,550.00	1.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,411,713.00	12.72
	其中:政策性金融债	59,411,713.00	12.72
4	企业债券	322,972,504.62	69.17
5	企业短期融资券	90,349,000.00	19.35
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	481,498,767.62	103.12

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

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	112232	14长证债	239,037	25,328,360.52	5.42
2	111051	09怀化债	213,077	23,395,854.60	5.01
3	122112	11沪大众	213,700	22,278,225.00	4.77
4	126018	08江铜债	216,950	21,534,457.00	4.61
5	122097	11浦路桥	202,010	20,689,864.20	4.43

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

14长证债(112232)于2015年5月22日收到湖北证监局关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定,因公司未与部分研究报告特约机构签订协议,公司部分研究报告的报送审核人员和对外发送渠道不符合公司内部规定,决定对公司采取出具警示函的监管措施;于2016年3月17日收到中国证监会湖北监管局《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》([2016]5号),因公司在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责,未按照相关约定,如实披露募集资金使用情况,上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》的规定,湖北证监局决定对公司采取出具警示函的监管措;于2016年3月23日收到全国中小企业股份转让系统《关于对长江证券采取出具警示函的监管措施》,因公司主办券商未严格履行投资者适当性管理义务,未健全投资者适当性管理工作制度和业务流程,未正确配置投资者交易权限及明确告知投资者可正常交易时点,构成违规。

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债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	105,089.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,865,438.49
5	应收申购款	453,553.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,424,081.46

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

项目	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
报告期期初基金份额总额	86,147,485.27	195,590,007.63
报告期期间基金总申购份额	32,042,869.56	79,140,352.55
减:报告期期间基金总赎回份额	23,663,843.74	42,210,247.56
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	94,526,511.09	232,520,112.62

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	1,691,538.33
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	1,691,538.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.52

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;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业增强收益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。

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

华宝兴业医药生物优选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