华宝兴业资源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	华宝资源优选混合
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	96,171,345.44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	-3,212,804.66
2.本期利润	-1,734,575.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0171
4.期末基金资产净值	102,953,065.59
5.期末基金份额净值	1.071

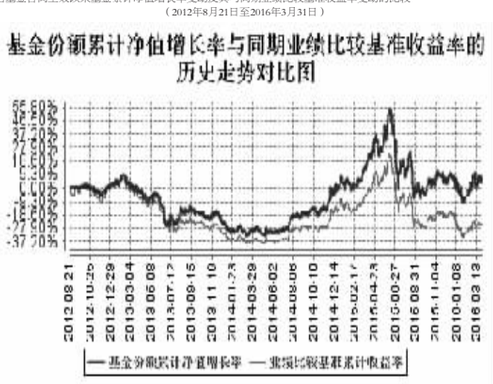
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.00%	2.83%	-6.79%	2.51%	6.79%	0.32%

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2016年3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	国内投资部副总经理、本基金基金经理、华宝兴业多策略混合、华宝新机遇混合基金经理	2012年8月21日	-	13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混合型证券投资基金基金经理。2015年6月起任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。2015年3月起任国内投资部副总经理。

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、《华宝兴业资源优选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,在国内信贷宽松、房地产去库存以及积极基建政策推动下,国内经济迎来了底部复苏信号,3月份PMI指数自2015年8月份以来首次站上荣枯线。从微观数据看:一季度发电耗煤同比降幅呈现逐月大幅收窄;水泥企业出货量同比增长明显且价格回升。前两个月规模企业工业利润增长由负转正,进出口依然不好,固定资产投资呈现稳中回升。从1季度经济数据看,国内经济大概率进入一个温和复苏期,但由于处于复苏初期,其持续性有待观察。从外围经济体看,美国一季度公布的就业等数据都表明其经济继续复苏,美联储在去年12月份启动加息以后一季度采取观望政策,对全球经济起到了一定的稳定作用。欧洲一季度继续加码QE,虽然力度超市场预期,但市场对其经济复苏力度依然持谨慎态度;同样,日本也是继续采取宽松政策,但从实际情况看对经济刺激作用明显不大。

A股市场一季度明显调整,从风格上看大盘股跌幅略小,而中小板指数跌幅稍大。一季度由于全球大宗商品反弹以及国内开始实施供给侧改革,市场跌幅较小的板块主要集中在上游,如石油石化、煤炭和有色行业;而计算机、通讯和传媒行业由于股指偏高跌幅较大。一季度上证指数跌幅15.12%,深成指跌幅17.45%,创业板指数跌幅17.53%。内地资源指数跌幅9.26%,煤炭指数跌幅8.22%,有色指数跌幅9.90%。

一季度资源板块表现较好,主要原因是在美联储2015年底加息以后全球大宗商品表现较好;同时,2015年底我国政府开始启动供给侧改革有利于化解上游行业产能严重供应过剩的局面;另外,国内经济呈现底部企稳复苏态势也增加了上游行业投资吸引力。由于一季度本基金大部分时间维持了中等偏高仓位,报告期内本基金跑赢了行业基准。

4.5 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0.00%,基金基准涨幅为-6.79%,基金表现领先基准6.79%。

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	94,131,634.58	89.91
	其中:股票	94,131,634.58	89.91
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	10,436,968.13	9.97
8	其他资产	124,093.83	0.12
9	合计	104,692,696.54	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	65,056,720.46	63.19
C	制造业	29,074,914.12	28.24
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	-	-
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	94,131,634.58	91.43

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	601699	潞安环能	896,541	6,535,783.89	6.35
2	600348	阳泉煤业	944,922	6,378,223.50	6.20
3	000983	西山煤电	788,690	5,938,835.70	5.77
4	601088	中国神华	350,000	4,921,000.00	4.78
5	000937	冀中能源	916,000	4,827,320.00	4.69
6	600123	兰花科创	537,140	4,028,550.00	3.91
7	600338	西藏珠峰	170,000	4,017,100.00	3.90
8	601898	中煤能源	730,000	3,737,600.00	3.63
9	600028	中国石化	755,000	3,593,800.00	3.49
10	600497	驰宏锌锗	289,861	3,237,747.37	3.14

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
本基金本报告期末股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末股指期货。

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
本基金本报告期末国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
兰花科创(600123)于2015年9月14日收到中国证券监督管理委员会山西监管局出具的《关于兰花科技创业股份有限公司现场检查情况的监管关注函》(晋证监函[2015]280号),因公司对外担保信息披露不充分,在股权收购等方面存在问题,山西证监局给予关注函并要求尽快整改。

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股票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。

5.11.2
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	57,876.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,503.84
5	应收申购款	61,713.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	124,093.83

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	601699	潞安环能	6,535,783.89	6.35	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	70,374,041.17
报告期期间基金总申购份额	114,757,097.54
减:报告期期间基金总赎回份额	88,959,793.27
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	96,171,345.44

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

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;
华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金合同;
华宝兴业资源优选混合型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业资源优选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

华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金

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	华宝兴业中证医疗指数分级
场内简称	医疗分级
基金主代码	162412
交易代码	162412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月21日
报告期末基金份额总额	712,259,851.51份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下,本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
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地调整。在正常情况下,本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金简称	医疗A / 医疗B / 华宝兴业中证医疗指数分级
下属分级基金交易代码	150261 / 150262 / 162412
下属分级基金报告期末基金份额总额	155,112,139.00份 / 155,112,139.00份 / 402,035,573.51份
下属分级基金的风险收益特征	华宝医疗A份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。 / 华宝医疗B份额具有较高风险、较高预期收益的特征。 / 本基金为股票型指数基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§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	-196,241,647.70
2.本期利润	-368,443,514.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3357
4.期末基金资产净值	767,425,606.15
5.期末基金份额净值	1.0775

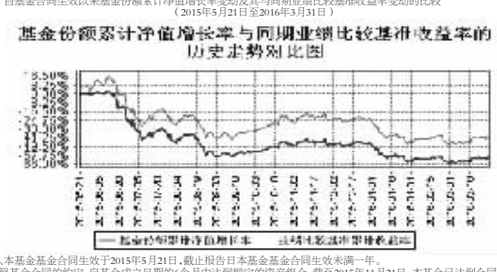
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-23.40%	3.42%	-20.82%	3.22%	-2.58%	0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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
(2015年5月21日至2016年3月31日)



注:1.本基金基金合同生效于2015年5月21日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。
2.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2015年11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		
胡喆	本基金基金经理、华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接、华宝兴业中证1000指数分级基金经理	2015年5月21日	-	10年	硕士。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作。2012年10月起任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2015年6月起任华宝兴业中证1000指数分级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、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证医疗指数分级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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,中证医疗指数分级证券投资基金在短期内出现过股票资产占基金资产净值比低于90%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

由于股、债市的系统性风险和指数成分股的调整,中证医疗指数分级证券投资基金出现了持有单只股票占基金净值超过10%的情况;由于该股票仍处于停牌状态,此情况将在该股票复牌后立即调整。

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年一季度国内经济数据显示需求有筑底企稳的迹象,在基础设施建设与房地产投资的带动下总投资增速出现改善,PMI指数的提升也预示着制造业企业景气度在不断改善,同时工业增加值同比增速也在不断回升。同期,A股市场整体呈现先抑后扬的走势,年初由于市场对熔断机制的应对尚不成熟,出现一轮恐慌性下跌行情,2月大盘成功震荡筑底,3月出现较为明显的反弹。指数方面,市场上大部分基准指数呈现震荡态势。市场风格继续分化,以中证500和中小板指为首的中小盘股指数跌幅居前,一季度分别下跌了19.19%和18.22%,而以中证100和沪深300指数为代表的大盘蓝筹股指数跌幅相对较小,分别下跌了11.23%和13.75%。本报告期内,中证医疗指数累计下跌了21.93%。

本报告期本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

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-23.40%,同期业绩比较基准增长率为-20.82%。

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	714,408,831.78	91.85
	其中:股票	714,408,831.78	91.85
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	41,541,249.45	5.34
8	其他资产	21,872,101.47	2.81
9	合计	777,822,182.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	511,662,005.41	66.67
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	34,293,757.56	4.47
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	47,413,978.20	6.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,542,868.02	1.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,980,160.00	0.52
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	103,516,062.59	13.49
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	714,408,831.78	93.09

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合
本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	002219	恒康医疗	7,590,797	90,330,484.30	11.77
2	300003	乐普医疗	1,254,743	46,538,417.87	6.06
3	002030	达安基因	1,327,959	39,320,865.99	5.12
4	300253	卫宁健康	1,169,348	38,237,679.60	4.98
5	300015	爱尔眼科	1,131,204	33,755,127.36	4.40
6	300244	迪安诊断	524,475	29,501,718.75	3.84
7	000516	国际医学	1,588,626	27,101,959.56	3.53
8	002223	鱼跃医疗	841,673	26,159,196.84	3.41
9	300238	冠昊生物	568,838	24,460,034.00	3.19
10	002022	科华生物	1,180,391	23,477,976.99	3.06

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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
本基金本报告期末股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末股指期货。

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
本基金本报告期末国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
恒康医疗(002219)于2016年2月1收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》,因公司信息披露涉嫌违反证券法律法规,目前正在被中国证监会立案稽查。

本基金为开放式指数分级基金,采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在中证医疗指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本报告期内,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。

5.11.2
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	641,449.54
2	应收证券清算款	21,026,346.49
3	应收股利	-
4	应收利息	10,928.42
5	应收申购款	193,377.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,872,101.47

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	002219	恒康医疗	90,330,484.30	11.77	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	医疗A	医疗B	华宝兴业中证医疗指数分级
报告期期初基金份额总额	548,786,274.00	548,786,274.00	588,871,226.42
报告期期间基金总申购份额	-	-	151,923,222.14
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	551,031,010.36
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-393,674,135.00	-393,674,135.00	212,272,135.31
报告期期末基金份额总额	155,112,139.00	155,112,139.00	402,035,573.51

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§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	79,868.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	27,801.23
报告期期末管理人持有的本基金份额	52,066.77
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.01

注:本基金以2016年1月29日为不定期折算基准日办理了份额折算业务。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	不定期折算	2016年2月1日	-27,801.23	0.00	0.00%
合计			-27,801.23	0.00	

注:本基金以2016年1月29日为不定期折算基准日办理了份额折算业务。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年1月29日发布《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金办理不定期份额折算公告》,根据本基金合同的约定以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,以2016年1月29日为不定期折算基准日办理份额折算业务。

2016年2月2日起,本基金恢复了申购(含定期定额投资)、赎回、转托管(包括场外转托管和跨系统转托管)和配对转换业务。

§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;
华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金合同;
华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金招募说明书;
华宝兴业中证医疗指数分级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住所备投资者查阅。

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
2016年4月20日

诺安保本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:诺安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人招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	诺安保本混合
交易代码	320015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月13日
报告期末基金份额总额	671,349,293.66份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术运作,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,通过安全资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳健增长。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)策略和时间不变性投资组合保险(