

# 华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：2016 年 10 月 25 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 10 月 21 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业宝康配置混合
基金主代码	240002
交易代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 15 日
报告期末基金份额总额	207,029,566.54 份
投资目标	规避系统风险，降低投资组合波动性，提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略，以债券投资为基础，并把握股市重大投资机会，获取超额回报，同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×65%+沪深 300 指数收益率×35%
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7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	3,757,864.65
2. 本期利润	-1,061,489.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0042
4. 期末基金资产净值	387,793,767.74
5. 期末基金份额净值	1.8731

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

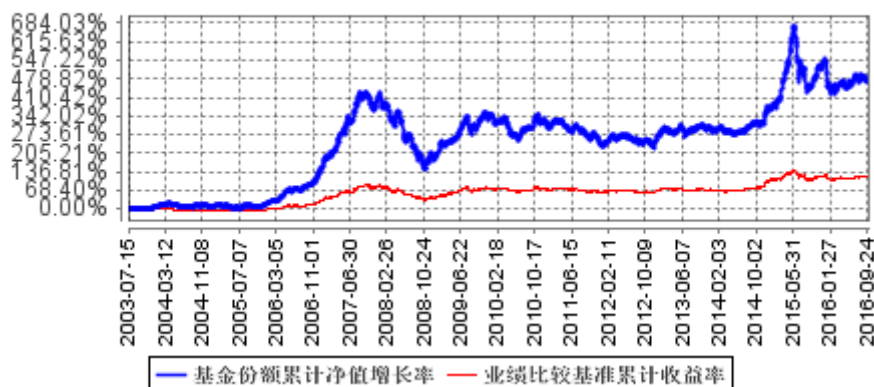
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.37%	0.67%	2.42%	0.29%	-2.79%	0.38%

##### 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

（2003年7月15日至2016年9月30日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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2004年

1 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		
季鹏	本基金基金经理、华宝国策导向混合、华宝兴业先进成长混合基金经理	2013 年 8 月 27 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 月起兼任华宝兴业先进成长混合型证券投资基金的基金经理。

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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》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，宝康灵活配置证券投资基金在短期内出现过持有债券市值低于基金资产总值 80% 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。

## 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，分析了本基金与公司旗下所有其他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 年三季度，A 股市场窄幅波动，但结构性分化严重，市场活跃度明显下降。沪深 300 指数上涨 3.15%，上证综指上涨 2.56%，中小板指数下跌 1.58%，创业板指数下跌 3.50%，深圳综指上涨 1.08%。上证指数明显好于中小板和创业板，大盘股表现较好，新兴科技类行业表现较差；涨幅上，房地产、家电、交通运输、汽车等行业表现较好，而传媒、科技、新能源等板块跌幅较大，市场炒作新概念的氛围明显较弱，有阶段回归价值的趋势，热点上集中于国家保增长等相关投资领域。三季度期间，本基金总体维持了较高的主板持仓和总体高仓位，但是持有的部分创业板股票表现落后，虽然把握了一定市场的热点机会和交易机会，但三季度业绩处于市场中游。

## 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-0.37%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%，基金表现落后于比较基准 2.79%。

## 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	257,030,992.24	65.90
	其中：股票	257,030,992.24	65.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,149,000.00	23.37
	其中：债券	91,149,000.00	23.37
	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	40,048,965.12	10.27
8	其他资产	1,773,647.25	0.45
9	合计	390,002,604.61	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	91,922.00	0.02
B	采矿业	4,030,151.67	1.04
C	制造业	105,776,666.47	27.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,514,165.50	0.91
E	建筑业	4,056,373.04	1.05
F	批发和零售业	10,065,538.67	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	5,643,534.63	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,715,360.36	10.76
J	金融业	50,872,542.33	13.12
K	房地产业	10,289,850.82	2.65
L	租赁和商务服务业	14,790,062.90	3.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,295,400.42	1.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	190,182.40	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,291,010.66	0.33
S	综合	408,230.37	0.11
	合计	257,030,992.24	66.28

### 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	300409	道氏技术	256,475	11,056,637.25	2.85
2	300207	欣旺达	599,808	9,267,033.60	2.39
3	002712	思美传媒	249,926	8,387,516.56	2.16
4	603368	柳州医药	100,000	7,798,000.00	2.01
5	601318	中国平安	222,086	7,586,457.76	1.96
6	002777	久远银海	80,000	7,415,200.00	1.91
7	300271	华宇软件	350,000	7,126,000.00	1.84
8	300129	泰胜风能	805,919	6,423,174.43	1.66
9	600036	招商银行	352,119	6,338,142.00	1.63
10	300089	文化长城	350,000	6,139,000.00	1.58

### 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	10,849,000.00	2.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,300,000.00	20.71
	其中：政策性金融债	80,300,000.00	20.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	91,149,000.00	23.50

**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	150222	15 国开 22	300,000	30,006,000.00	7.74
2	150408	15 农发 08	200,000	20,148,000.00	5.20
3	160209	16 国开 09	200,000	20,000,000.00	5.16
4	010107	21 国债(7)	100,000	10,849,000.00	2.80
5	140208	14 国开 08	100,000	10,146,000.00	2.62

**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	90,619.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,679,745.38
5	应收申购款	3,282.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,773,647.25

### 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的情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	277,007,684.94
报告期期间基金总申购份额	1,841,645.94
减：报告期期间基金总赎回份额	71,819,764.34
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	207,029,566.54

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	286,023.61
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	286,023.61
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.14

### 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；  
 华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同；  
 华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书；  
 华宝兴业宝康系列开放式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 10 月 25 日