

华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金 2015 年半年度报告

2015年6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

送出日期：2015年8月28日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 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.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 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贵金属投资明细.....	49
7.9 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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49

§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	303,288,901.98 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数。 $\text{复合指数} = (\text{上证 180 流通市值} / \text{成分指数总流通市值}) \times \text{上证 180 指数} + (\text{深证 100 流通市值} / \text{成分指数总流通市值}) \times \text{深证 100 指数}$ $\text{成分指数总流通市值} = \text{上证 180 流通市值} + \text{深证 100 流通市值}$

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		上海浦东新区世纪大道 100	北京市西城区金融大街 25 号

	号上海环球金融中心 58 楼	
办公地址	上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑安国	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	215,945,722.88
本期利润	240,537,253.79
加权平均基金份额本期利润	0.6847
本期加权平均净值利润率	34.66%
本期基金份额净值增长率	41.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	370,417,033.05
期末可供分配基金份额利润	1.2213
期末基金资产净值	673,705,935.03
期末基金份额净值	2.2213
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	562.10%

注：1、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。

2、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。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-8.40%	2.31%	-2.38%	1.23%	-6.02%	1.08%
过去三个月	16.18%	1.90%	4.47%	0.92%	11.71%	0.98%
过去六个月	41.50%	1.57%	9.85%	0.82%	31.65%	0.75%
过去一年	72.24%	1.24%	35.83%	0.69%	36.41%	0.55%
过去三年	84.02%	0.99%	37.49%	0.55%	46.53%	0.44%
自基金合同生效日起至 今	562.10%	1.16%	128.17%	0.63%	433.93%	0.53%

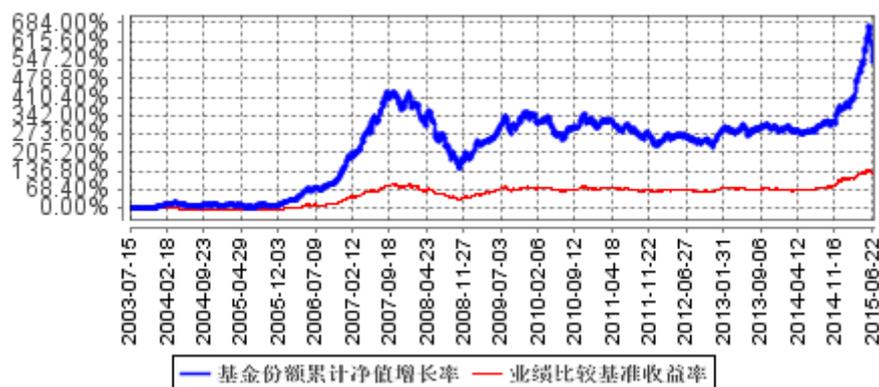
注：1、本基金业绩比较基准为：65%中信标普全债指数+35%上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

(2003 年 7 月 15 日至 2015 年 6 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2015 年 6 月 30 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业活期货币市场基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证 1000 分级基金和华宝兴业万物互联基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 110,943,781,389.61 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭鹏飞	投资副总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康灵活配置基金经理	2010年6月26日	2015年4月9日	11年	博士，拥有 CFA 资格。2004 年 2 月加入华宝兴业基金管理有限公司先后担任研究部行业分析师研究部副总经理，研究部总经理，国内投资部总经理，投资副总监。2010 年 6 月至 2015 年 4 月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010 年 12 月至 2015 年 4 月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。
季鹏	本基金基金经理、华宝国策导向混合基金经理、华宝兴业先进成长股票基金经理	2013年8月27日	-	9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股票型证券投资基金的基金经理。
胡戈游	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业宝康消费品基金经理、华宝品质生活股票基金经理	2013年7月25日	-	10年	硕士，拥有 CFA 资格。2005 年 2 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、国内投资部基金经理助理的职务，2009 年 5 月至 2010 年 6 月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010 年 1 月至 2012 年 1 月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

					基金经理。2011 年 2 月起任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理，2013 年 7 月起兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2015 年 1 月兼任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月任助理投资总监。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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，宝康灵活配置证券投资基金在短期内出现过投资债券占基金资产净值比低于 20%、投资国债占基金资产净值比低于 20%以及投资于股票、债券占基金资产净值比低于 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，A 股市场总体保持了上涨趋势，特别是在四五月份，主板和创业板都取得了短期大幅上涨。六月上旬主板一度超过 5000 点大关，创业板超过 4000 点，随后市场出现了一轮快速下跌。上半年创业板涨幅远超主板，其中计算机、轻工制造、纺织服装、传媒等行业涨幅靠前，券商、银行、石油石化等板块涨幅靠后，小盘股在上半年的行情中表现好于大盘股，互联网+、精准医疗、国企改革等主题表现优异。

本基金在上半年总体维持了积极操作和高仓位的思路，并维持了本基金契约范围内允许的最高比例的创业板持仓，且在市场高位处逢高减持，降低仓位，总体判断和市场走势基本一致，基金业绩同期业绩处于市场中游，但明显好于基准。预计未来我们将坚持大小盘兼顾的投资策略，保持本基金操作灵活、追求长期稳健收益的目标。

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 41.5%，同期业绩比较基准增长率为 9.85%，基金表现领先比较基准 31.65%。

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 年下半年，我们仍然对以创业板为代表的新兴产业板块保持乐观态度。尽管中国经济整体增速在逐渐放缓，但经济结构调整的方向日益明显，互联网经济、环保、消费升级、医疗养老等产业方向正在蓬勃发展。预计在此背景下，相关领域的投资机会仍将较多；但由于 2015 年各板块在上半年涨幅已经很大，预计下半年选股难度加大，收益预期要降低；但是长期，中国改革牛市的基础仍在，总体流动性宽松的经济环境仍在，市场预计将在短期震荡后孕育新的机会；短期市场出现大幅回调之后，很多成长股的价格已经逐步回到长期可投资范围，未来我们将积极关注。

就长期而言，我们对此轮 A 股市场保持中长期的牛市仍有信心，只是我们不希望市场的上涨

过快过急。我们也坚信中国转型成功所带来的巨大投资机会，而这种机会将广泛存在于 A 股的大盘和小盘股当中。预计在下阶段投资中，紧密跟踪各行业景气度变化，精选优秀的公司，坚定长期持有，分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报；本基金将继续保持本基金一贯的灵活操作风格，以追求基金长期稳定业绩。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，我们将继续勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性 & 适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于 2015 年 1 月 13 日发布了分红公告，本次分红为 2014 年度的第 1 次分红。本基金向 2015 年 1 月 16 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.2 元，利润分配合计为人民币 7,426,274.13 元，其中现金形式发放总额为人民币 2,977,530.37 元，再投资形式发放总额为人民币 4,448,743.76 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 7,426,274.13 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	98,936,441.57	21,458,060.66
结算备付金		1,000,550.14	2,158,929.78
存出保证金		424,758.75	381,287.35
交易性金融资产	6.4.7.2	579,309,637.78	577,945,380.82
其中：股票投资		371,980,232.38	427,786,380.82
基金投资		-	-
债券投资		207,329,405.40	150,159,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,326,221.95	753,282.07
应收利息	6.4.7.5	3,667,117.51	5,137,860.57
应收股利		-	-
应收申购款		269,235.22	296,096.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	120.00	-
资产总计		690,934,082.92	608,130,898.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		11,880,295.93	1,881,461.55
应付管理人报酬		833,081.73	676,863.14
应付托管费		160,208.03	130,165.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,667,054.76	3,086,240.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	687,507.44	783,573.71
负债合计		17,228,147.89	6,558,304.51
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	303,288,901.98	378,453,922.09
未分配利润	6.4.7.10	370,417,033.05	223,118,671.60
所有者权益合计		673,705,935.03	601,572,593.69
负债和所有者权益总计		690,934,082.92	608,130,898.20

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2213 元，基金份额总额 303,288,901.98 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		249,415,516.16	-4,205,077.38

1.利息收入		3,482,282.85	5,204,611.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	267,406.81	303,916.54
债券利息收入		3,214,876.04	4,845,528.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	55,166.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		220,852,553.95	10,718,985.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	218,958,890.25	8,150,199.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-116,547.80	203,596.98
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,010,211.50	2,365,188.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,591,530.91	-20,214,125.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	489,148.45	85,451.57
减：二、费用		8,878,262.37	8,454,243.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,440,629.22	4,478,481.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	853,967.17	861,246.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,469,817.14	2,997,954.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	113,848.84	116,562.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		240,537,253.79	-12,659,320.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		240,537,253.79	-12,659,320.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基	378,453,922.09	223,118,671.60	601,572,593.69

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	240,537,253.79	240,537,253.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-75,165,020.11	-85,812,618.21	-160,977,638.32
其中: 1.基金申购款	79,502,736.07	81,239,540.33	160,742,276.40
2.基金赎回款	-154,667,756.18	-167,052,158.54	-321,719,914.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-7,426,274.13	-7,426,274.13
五、期末所有者权益(基金净值)	303,288,901.98	370,417,033.05	673,705,935.03
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	548,409,093.51	186,403,852.46	734,812,945.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,659,320.92	-12,659,320.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-37,039,902.57	-11,841,493.71	-48,881,396.28
其中: 1.基金申购款	6,372,996.65	2,011,127.41	8,384,124.06
2.基金赎回款	-43,412,899.22	-13,852,621.12	-57,265,520.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-5,449,752.13	-5,449,752.13
五、期末所有者权益(基金净值)	511,369,190.94	156,453,285.70	667,822,476.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

黄小慧
基金管理人负责人

向辉
主管会计工作负责人

张幸骏
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 62 号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 7 月 15 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康灵活配置证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康消费品证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,893,701,931.41 元,其中包括本基金人民币 1,066,581,834.53 元、宝康消费品证券投资基金人民币 1,540,046,055.09 元和宝康债券投资基金人民币 1,287,074,041.79 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 96 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等;股票投资方面,主要投资对象为上证 180 指数、深圳 100 指数的成分股。在正常的市场情况下,本基金组合投资的基本范围为:债券 20%-90%;股票 5%-75%;现金 5%以上。本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数(原名为“中信全债指数”)×65%+上证 180 指数和深圳 100 指数的复合指数×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解

禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。（4）基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	98,936,441.57
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	98,936,441.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	303,844,382.17	371,980,232.38	68,135,850.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	76,333,405.40	-67,248.90
	银行间市场	130,996,000.00	548,660.00
	合计	207,329,405.40	481,411.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	510,692,376.47	579,309,637.78	68,617,261.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	19,526.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	450.20
应收债券利息	3,646,947.04
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.48
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	191.20
合计	3,667,117.51

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	120.00
待摊费用	-
合计	120.00

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,666,054.76
银行间市场应付交易费用	1,000.00
合计	3,667,054.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00

应付赎回费	20,153.99
预提费用	167,353.45
合计	687,507.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	378,453,922.09	378,453,922.09
本期申购	79,502,736.07	79,502,736.07
本期赎回(以“-”号填列)	-154,667,756.18	-154,667,756.18
本期末	303,288,901.98	303,288,901.98

注：申购含红利再投和转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	267,003,982.44	-43,885,310.84	223,118,671.60
本期利润	215,945,722.88	24,591,530.91	240,537,253.79
本期基金份额交易产生的变动数	-78,032,952.79	-7,779,665.42	-85,812,618.21
其中：基金申购款	74,241,375.59	6,998,164.74	81,239,540.33
基金赎回款	-152,274,328.38	-14,777,830.16	-167,052,158.54
本期已分配利润	-7,426,274.13	-	-7,426,274.13
本期末	397,490,478.40	-27,073,445.35	370,417,033.05

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,881.95
其他	4,037.71
合计	267,406.81

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,243,425,513.16
减：卖出股票成本总额	1,024,466,622.91
买卖股票差价收入	218,958,890.25

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	158,304,527.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	151,789,101.50
减：应收利息总额	6,631,973.70
买卖债券差价收入	-116,547.80

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,010,211.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,010,211.50

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	24,591,530.91
——股票投资	23,992,519.81
——债券投资	599,011.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	24,591,530.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	471,129.15
转换费收入	18,019.30
合计	489,148.45

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 部分基金之间的转换费采用固定转换费率，转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产；部分基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,468,617.14
银行间市场交易费用	1,200.00
合计	3,469,817.14

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	41,159.40
信息披露费	52,861.05

债券帐户维护费	13,700.00
银行费用	6,128.39
合计	113,848.84

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
----	-------------------------	---------------------------------

	30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	4,440,629.22	4,478,481.05
其中：支付销售机构的客户维护费	62,768.06	67,062.82

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.3% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	853,967.17	861,246.37

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
期初持有的基金份额	436,169.25	436,169.25
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	121,994.31	-
期末持有的基金份额	314,174.94	436,169.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.10%	0.09%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。期间申购/买入总份额中包含红利再投资份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	98,936,441.57	244,468.40	20,744,339.32	286,211.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2015年1月16日	2015年1月16日	0.2000	2,977,530.37	4,448,743.76	7,426,274.13	
合计	-	-	0.2000	2,977,530.37	4,448,743.76	7,426,274.13	

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额	备注
300147	香雪制药	2015/6/18	2015/7/2	配股未上市	10.46	30.8	47,984	501,912.64	1,477,907.20	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600869	智慧能源	2015年5月11日	重大事项停牌	32.06	2015年7月31日	26.23	650,029	13,459,657.95	20,839,929.74	-
002712	思美传媒	2015年3月19日	重大资产重组	101.15	2015年7月31日	66.10	133,000	7,345,409.60	13,452,950.00	-
300392	腾信股份	2015年6月30日	重大事项停牌	133.74	2015年7月14日	147.11	70,000	10,910,939.00	9,361,800.00	-
300007	汉威电子	2015年6月29日	重大事项停牌	74.72	2015年8月24日	67.25	80,000	7,261,658.00	5,977,600.00	-
300142	沃森生物	2015年6月15日	重大资产重组	37.64	-	-	100,090	3,535,053.39	3,767,387.60	-
600900	长江电力	2015年6月15日	重大资产重组	14.35	-	-	122,265	1,190,973.30	1,754,502.75	-
000024	招商地产	2015年4月3日	重大资产重组	36.50	-	-	30,338	670,323.69	1,107,337.00	-
600886	国投电力	2015年6月24日	重大事项停牌	14.87	-	-	74,110	694,253.45	1,102,015.70	-
600649	城投控股	2014年11月03日	重大资产重组	14.10	2015年6月26日	7.73	58,435	418,428.93	823,933.50	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	重大事项停牌	12.96	-	-	53,567	297,050.36	694,228.32	-
000709	河北钢铁	2015年6月30日	重大事项停牌	7.00	2015年8月24日	6.30	93,813	320,911.66	656,691.00	-
600153	建发	2015	重大	17.51	-	-	36,999	363,540.75	647,852.49	-

	股份	年 6 月 29 日	事项停牌								
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	37,012	272,830.20	568,504.32	-	
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项停牌	30.81	-	-	16,592	313,579.37	511,199.52	-	
002353	杰瑞股份	2015 年 5 月 27 日	重大事项停牌	44.35	-	-	11,292	408,593.89	500,800.20	-	
000839	中信国安	2015 年 6 月 29 日	重大事项停牌	23.57	-	-	20,483	252,483.24	482,784.31	-	
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	重大事项停牌	16.88	-	-	28,418	377,845.23	479,695.84	-	
000630	铜陵有色	2015 年 3 月 9 日	重大事项停牌	10.32	-	-	40,316	273,864.00	416,061.12	-	
000878	云南铜业	2015 年 6 月 8 日	重大事项停牌	24.50	-	-	16,647	219,484.40	407,851.50	-	
601216	内蒙君正	2015 年 6 月 29 日	重大资产重组	24.07	2015 年 7 月 2 日	24.20	15,179	205,471.18	365,358.53	-	
002310	东方园林	2015 年 5 月 27 日	重大资产重组	38.30	-	-	9,134	185,163.57	349,832.20	-	
601633	长城汽车	2015 年 6 月 19 日	重大事项停牌	42.76	2015 年 7 月 13 日	38.50	7,946	352,498.39	339,770.96	-	
002292	奥飞动漫	2015 年 5 月 18 日	重大事项停牌	37.85	-	-	8,746	165,491.39	331,036.10	-	
600277	亿利能源	2015 年 6 月 1 日	重大事项停牌	14.62	-	-	20,198	189,488.49	295,294.76	-	
002375	亚厦股份	2015 年 6 月 17 日	重大事项停牌	23.96	2015 年 7 月 20 日	26.29	11,331	172,433.28	271,490.76	-	
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项停牌	71.48	2015 年 8 月 5 日	69.20	3,778	213,237.16	270,051.44	-	

002001	新和成	2015年6月30日	重大事项停牌	17.09	2015年7月13日	18.49	11,245	176,106.39	192,177.05	-
600395	盘江股份	2015年6月9日	重大事项停牌	13.06	2015年8月19日	14.00	11,926	128,507.68	155,753.56	-
002416	爱施德	2015年5月5日	重大事项停牌	20.67	2015年7月29日	18.60	3,983	53,690.73	82,328.61	-
002303	美盈森	2015年6月9日	重大事项停牌	37.78	2015年7月13日	21.43	18	496.44	680.04	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。城投控股(600649)于 2015.6.26 复牌,至 2015.6.30 交易仍不活跃、流通仍然受限,故根据中国证券监督管理委员会的相关信息披露要求在此披露。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只平衡型证券投资基金，属于风险适中、收益适中的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业

务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和监察稽核部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	98,936,441.57	-	-	-	98,936,441.57
结算备付金	1,000,550.14	-	-	-	1,000,550.14
存出保证金	424,758.75	-	-	-	424,758.75
交易性金融资产	100,588,405.40	30,457,000.00	76,284,000.00	371,980,232.38	579,309,637.78
应收证券清算款	-	-	-	7,326,221.95	7,326,221.95
应收利息	-	-	-	3,667,117.51	3,667,117.51
应收申购款	994.04	-	-	268,241.18	269,235.22
其他资产	-	-	-	120.00	120.00
资产总计	200,951,149.90	30,457,000.00	76,284,000.00	383,241,933.02	690,934,082.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,880,295.93	11,880,295.93
应付管理人报酬	-	-	-	833,081.73	833,081.73
应付托管费	-	-	-	160,208.03	160,208.03

应付交易费用	-	-	-	3,667,054.76	3,667,054.76
其他负债	-	-	-	687,507.44	687,507.44
负债总计	-	-	-	17,228,147.89	17,228,147.89
利率敏感程度缺口	200,951,149.90	30,457,000.00	76,284,000.00	366,013,785.13	673,705,935.03
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,458,060.66	-	-	-	21,458,060.66
结算备付金	2,158,929.78	-	-	-	2,158,929.78
存出保证金	381,287.35	-	-	-	381,287.35
交易性金融资产	150,159,000.00	-	-	427,786,380.82	577,945,380.82
应收证券清算款	-	-	-	753,282.07	753,282.07
应收利息	-	-	-	5,137,860.57	5,137,860.57
应收申购款	-	-	-	296,096.95	296,096.95
资产总计	174,157,277.79	-	-	433,973,620.41	608,130,898.20
负债					
应付赎回	-	-	-	1,881,461.55	1,881,461.55

款					
应付管理人报酬	-	-	-	676,863.14	676,863.14
应付托管费	-	-	-	130,165.96	130,165.96
应付交易费用	-	-	-	3,086,240.15	3,086,240.15
其他负债	-	-	-	783,573.71	783,573.71
负债总计	-	-	-	6,558,304.51	6,558,304.51
利率敏感度缺口	174,157,277.79	-	-	-427,415,315.90	601,572,593.69

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	400,019.97	109,563.47
	2. 市场利率上升 25 个基点	-382,878.14	-109,323.86

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 5%-75%；债券为 20%-90%；现金比例在 5%以上。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	371,980,232.38	55.21	427,786,380.82	71.11
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	371,980,232.38	55.21	427,786,380.82	71.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指	36,471,070.79	43,625,124.09

	数上升 5%		
	2. 70%×上证 180 和深证 100 复合指数+30%×中信全债指数下降 5%	-36,471,070.79	-43,625,124.09

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 308,351,769.71 元，属于第二层次的余额为 270,957,868.07 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 393,783,691.18 元，第二层次 184,161,689.64 元，无第三层次)。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允

价值从第一层次调整至第二层次。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	371,980,232.38	53.84
	其中：股票	371,980,232.38	53.84
2	固定收益投资	207,329,405.40	30.01
	其中：债券	207,329,405.40	30.01
	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	99,936,991.71	14.46
7	其他各项资产	11,687,453.43	1.69
8	合计	690,934,082.92	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	595,527.08	0.09
B	采矿业	10,641,431.10	1.58
C	制造业	143,012,048.42	21.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,985,558.02	1.48
E	建筑业	10,452,085.33	1.55
F	批发和零售业	11,792,031.44	1.75
G	交通运输、仓储和邮政业	8,578,901.63	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,641,203.99	7.37
J	金融业	72,059,633.10	10.70

K	房地产业	10,336,411.06	1.53
L	租赁和商务服务业	37,839,589.26	5.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,293,888.37	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	244,079.80	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,815,438.77	0.42
S	综合	692,405.01	0.10
	合计	371,980,232.38	55.21

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600869	智慧能源	650,029	20,839,929.74	3.09
2	002712	思美传媒	133,000	13,452,950.00	2.00
3	300165	天瑞仪器	349,881	12,165,362.37	1.81
4	002707	众信旅游	120,117	11,319,826.08	1.68
5	300178	腾邦国际	286,192	10,334,393.12	1.53
6	300392	腾信股份	70,000	9,361,800.00	1.39
7	601318	中国平安	111,043	9,098,863.42	1.35
8	300253	卫宁软件	160,000	8,320,000.00	1.23
9	300356	光一科技	159,983	8,095,139.80	1.20
10	300399	京天利	51,800	7,465,416.00	1.11
11	300378	鼎捷软件	91,676	7,438,590.64	1.10
12	600036	招商银行	396,319	7,419,091.68	1.10
13	603368	柳州医药	80,000	6,569,600.00	0.98
14	300147	香雪制药	207,931	6,404,274.80	0.95
15	300007	汉威电子	80,000	5,977,600.00	0.89
16	600016	民生银行	572,621	5,691,852.74	0.84
17	300075	数字政通	150,040	5,655,007.60	0.84
18	600000	浦发银行	270,720	4,591,411.20	0.68
19	600030	中信证券	161,931	4,357,563.21	0.65
20	601166	兴业银行	246,031	4,244,034.75	0.63
21	300142	沃森生物	100,090	3,767,387.60	0.56

22	601766	中国中车	199,602	3,664,692.72	0.54
23	600837	海通证券	165,763	3,613,633.40	0.54
24	000651	格力电器	52,920	3,381,588.00	0.50
25	002206	海利得	200,000	3,368,000.00	0.50
26	000002	万科A	213,351	3,097,856.52	0.46
27	601668	中国建筑	330,721	2,748,291.51	0.41
28	601328	交通银行	330,047	2,719,587.28	0.40
29	601989	中国重工	181,426	2,685,104.80	0.40
30	600887	伊利股份	136,332	2,576,674.80	0.38
31	300259	新天科技	170,065	2,567,981.50	0.38
32	600519	贵州茅台	9,269	2,388,157.85	0.35
33	601818	光大银行	439,590	2,356,202.40	0.35
34	000001	平安银行	157,397	2,288,552.38	0.34
35	601288	农业银行	573,057	2,126,041.47	0.32
36	601169	北京银行	156,315	2,082,115.80	0.31
37	000166	申万宏源	124,588	2,024,555.00	0.30
38	601398	工商银行	380,286	2,007,910.08	0.30
39	601006	大秦铁路	130,829	1,836,839.16	0.27
40	600900	长江电力	122,265	1,754,502.75	0.26
41	600104	上汽集团	72,659	1,642,093.40	0.24
42	600048	保利地产	142,018	1,621,845.56	0.24
43	601390	中国中铁	114,014	1,560,851.66	0.23
44	000333	美的集团	40,654	1,515,581.12	0.22
45	601088	中国神华	72,681	1,515,398.85	0.22
46	600015	华夏银行	97,730	1,486,473.30	0.22
47	002024	苏宁云商	97,102	1,485,660.60	0.22
48	600795	国电电力	210,800	1,469,276.00	0.22
49	603199	九华旅游	30,000	1,416,300.00	0.21
50	000776	广发证券	61,381	1,390,279.65	0.21
51	002402	和而泰	47,376	1,378,641.60	0.20
52	600050	中国联通	186,881	1,369,837.73	0.20
53	601688	华泰证券	57,751	1,335,780.63	0.20
54	000858	五粮液	41,110	1,303,187.00	0.19
55	600011	华能国际	92,462	1,297,241.86	0.19
56	600999	招商证券	48,062	1,271,720.52	0.19
57	600518	康美药业	71,488	1,267,482.24	0.19
58	600383	金地集团	99,054	1,253,033.10	0.19
59	000768	中航飞机	28,521	1,242,945.18	0.18
60	002415	海康威视	26,426	1,183,884.80	0.18

61	600570	恒生电子	10,556	1,182,799.80	0.18
62	600109	国金证券	47,902	1,168,808.80	0.17
63	000725	京东方A	225,073	1,168,128.87	0.17
64	000625	长安汽车	54,021	1,142,544.15	0.17
65	600637	百视通	27,058	1,138,600.64	0.17
66	600029	南方航空	77,367	1,124,916.18	0.17
67	000024	招商地产	30,338	1,107,337.00	0.16
68	600886	国投电力	74,110	1,102,015.70	0.16
69	000063	中兴通讯	42,950	1,022,639.50	0.15
70	600690	青岛海尔	33,112	1,004,286.96	0.15
71	601628	中国人寿	32,047	1,003,712.04	0.15
72	601186	中国铁建	63,254	988,660.02	0.15
73	600276	恒瑞医药	22,111	984,823.94	0.15
74	601901	方正证券	82,763	984,052.07	0.15
75	000783	长江证券	70,524	983,809.80	0.15
76	601857	中国石油	85,864	972,839.12	0.14
77	601377	兴业证券	69,781	955,301.89	0.14
78	000100	TCL 集团	166,517	940,821.05	0.14
79	000503	海虹控股	19,067	934,283.00	0.14
80	600585	海螺水泥	43,404	931,015.80	0.14
81	000538	云南白药	10,696	922,743.92	0.14
82	600010	宝钢股份	176,402	915,526.38	0.14
83	000069	华侨城A	70,394	913,714.12	0.14
84	601899	紫金矿业	173,756	889,630.72	0.13
85	002230	科大讯飞	25,421	888,209.74	0.13
86	600111	北方稀土	48,702	883,454.28	0.13
87	601009	南京银行	38,433	876,272.40	0.13
88	300024	机器人	11,276	871,183.76	0.13
89	600028	中国石化	122,198	862,717.88	0.13
90	600415	小商品城	56,000	855,680.00	0.13
91	600705	中航资本	36,893	854,072.95	0.13
92	600089	特变电工	56,843	841,844.83	0.12
93	600221	海南航空	130,171	831,792.69	0.12
94	600703	三安光电	26,415	826,789.50	0.12
95	600649	城投控股	58,435	823,933.50	0.12
96	601669	中国电建	71,055	805,763.70	0.12
97	600100	同方股份	38,360	805,176.40	0.12
98	600352	浙江龙盛	56,154	795,702.18	0.12
99	600839	四川长虹	80,724	794,324.16	0.12

100	002450	康得新	25,830	790,398.00	0.12
101	600018	上港集团	99,756	789,069.96	0.12
102	601800	中国交建	44,631	783,720.36	0.12
103	601600	中国铝业	83,898	782,768.34	0.12
104	000157	中联重科	96,412	781,901.32	0.12
105	600115	东方航空	62,969	775,778.08	0.12
106	601618	中国中冶	107,073	774,137.79	0.11
107	600739	辽宁成大	31,167	762,033.15	0.11
108	600804	鹏博士	25,466	760,414.76	0.11
109	600150	中国船舶	14,715	757,822.50	0.11
110	600271	航天信息	11,414	738,599.94	0.11
111	000338	潍柴动力	23,194	734,322.04	0.11
112	601018	宁波港	82,796	731,916.64	0.11
113	000402	金融街	51,696	730,464.48	0.11
114	601988	中国银行	148,554	726,429.06	0.11
115	600196	复星医药	24,568	710,997.92	0.11
116	002465	海格通信	22,071	710,465.49	0.11
117	600256	广汇能源	68,178	709,051.20	0.11
118	300027	华谊兄弟	18,572	708,336.08	0.11
119	000778	新兴铸管	53,567	694,228.32	0.10
120	600177	雅戈尔	37,919	692,400.94	0.10
121	600118	中国卫星	12,067	687,336.32	0.10
122	002241	歌尔声学	18,624	668,601.60	0.10
123	000728	国元证券	17,489	664,232.22	0.10
124	600588	用友网络	14,389	660,167.32	0.10
125	600535	天士力	13,252	659,419.52	0.10
126	601866	中海集运	69,410	659,395.00	0.10
127	600406	国电南瑞	31,769	657,300.61	0.10
128	000709	河北钢铁	93,813	656,691.00	0.10
129	002202	金风科技	33,642	655,009.74	0.10
130	600009	上海机场	20,560	651,752.00	0.10
131	600153	建发股份	36,999	647,852.49	0.10
132	002304	洋河股份	9,330	647,128.80	0.10
133	600031	三一重工	66,661	645,945.09	0.10
134	601727	上海电气	42,898	640,467.14	0.10
135	600583	海油工程	38,408	639,877.28	0.09
136	600893	中航动力	11,954	635,355.10	0.09
137	000423	东阿阿胶	11,316	616,722.00	0.09
138	601333	广深铁路	74,080	608,937.60	0.09

139	000061	农产品	29,772	607,348.80	0.09
140	000039	中集集团	18,569	599,778.70	0.09
141	600066	宇通客车	29,184	599,731.20	0.09
142	600674	川投能源	47,494	594,149.94	0.09
143	002081	金螳螂	20,993	591,792.67	0.09
144	002065	东华软件	20,501	589,403.75	0.09
145	600068	葛洲坝	50,214	587,001.66	0.09
146	601888	中国国旅	8,787	582,578.10	0.09
147	000060	中金岭南	31,154	579,152.86	0.09
148	002673	西部证券	20,068	569,329.16	0.08
149	601111	中国国航	37,012	568,504.32	0.08
150	600309	万华化学	23,236	561,846.48	0.08
151	300070	碧水源	11,312	551,912.48	0.08
152	002594	比亚迪	9,901	546,832.23	0.08
153	000009	中国宝安	33,015	538,474.65	0.08
154	600027	华电国际	48,352	537,674.24	0.08
155	000559	万向钱潮	24,569	537,078.34	0.08
156	300017	网宿科技	11,483	533,040.86	0.08
157	601555	东吴证券	25,739	526,877.33	0.08
158	600340	华夏幸福	17,082	520,146.90	0.08
159	600863	内蒙华电	63,487	519,323.66	0.08
160	002008	大族激光	17,953	515,610.16	0.08
161	000623	吉林敖东	15,294	513,878.40	0.08
162	600741	华域汽车	24,035	513,147.25	0.08
163	000883	湖北能源	58,821	512,919.12	0.08
164	600688	上海石化	47,729	512,132.17	0.08
165	000917	电广传媒	16,592	511,199.52	0.08
166	000629	攀钢钒钛	93,943	503,534.48	0.07
167	600642	申能股份	50,181	502,311.81	0.07
168	002353	杰瑞股份	11,292	500,800.20	0.07
169	601998	中信银行	64,852	500,008.92	0.07
170	601933	永辉超市	42,896	497,164.64	0.07
171	600085	同仁堂	13,844	497,138.04	0.07
172	600315	上海家化	11,368	493,371.20	0.07
173	000686	东北证券	25,193	490,507.71	0.07
174	000839	中信国安	20,483	482,784.31	0.07
175	600369	西南证券	24,557	482,545.05	0.07
176	000793	华闻传媒	28,418	479,695.84	0.07
177	000568	泸州老窖	14,684	478,845.24	0.07

178	300124	汇川技术	9,868	473,664.00	0.07
179	000895	双汇发展	21,795	464,887.35	0.07
180	600157	永泰能源	67,408	463,767.04	0.07
181	601898	中煤能源	40,290	460,111.80	0.07
182	002129	中环股份	23,204	459,207.16	0.07
183	600252	中恒集团	19,914	458,022.00	0.07
184	601607	上海医药	20,549	457,626.23	0.07
185	601179	中国西电	44,347	454,556.75	0.07
186	601168	西部矿业	41,141	449,259.72	0.07
187	002142	宁波银行	21,229	448,993.35	0.07
188	002456	欧菲光	13,257	447,291.18	0.07
189	600660	福耀玻璃	30,401	434,126.28	0.06
190	600060	海信电器	17,158	421,915.22	0.06
191	601117	中国化学	43,011	420,647.58	0.06
192	000630	铜陵有色	40,316	416,061.12	0.06
193	000826	桑德环境	10,593	411,961.77	0.06
194	600489	中金黄金	31,778	408,982.86	0.06
195	000878	云南铜业	16,647	407,851.50	0.06
196	300058	蓝色光标	25,581	404,435.61	0.06
197	600663	陆家嘴	8,126	404,187.24	0.06
198	600718	东软集团	18,572	403,569.56	0.06
199	000425	徐工机械	29,915	396,972.05	0.06
200	600208	新潮中宝	51,008	393,781.76	0.06
201	600372	中航电子	11,273	393,765.89	0.06
202	000792	盐湖股份	13,873	393,715.74	0.06
203	002153	石基信息	2,988	388,410.12	0.06
204	002252	上海莱士	5,934	388,320.96	0.06
205	600362	江西铜业	17,956	386,233.56	0.06
206	002500	山西证券	21,336	385,968.24	0.06
207	002236	大华股份	12,025	383,838.00	0.06
208	002146	荣盛发展	30,706	383,825.00	0.06
209	600827	百联股份	18,164	377,992.84	0.06
210	600547	山东黄金	15,276	377,317.20	0.06
211	000581	威孚高科	12,076	374,235.24	0.06
212	000800	一汽轿车	14,989	372,926.32	0.06
213	600867	通化东宝	17,000	372,810.00	0.06
214	600170	上海建工	39,739	372,751.82	0.06
215	600332	白云山	10,790	371,823.40	0.06
216	000970	中科三环	18,021	371,412.81	0.06

217	000598	兴蓉环境	38,441	367,880.37	0.05
218	601216	内蒙君正	15,179	365,358.53	0.05
219	002385	大北农	27,014	365,229.28	0.05
220	600398	海澜之家	19,798	358,937.74	0.05
221	000825	太钢不锈	50,180	356,779.80	0.05
222	600873	梅花生物	33,736	352,203.84	0.05
223	002310	东方园林	9,134	349,832.20	0.05
224	600108	亚盛集团	33,713	349,266.68	0.05
225	601098	中南传媒	15,211	348,484.01	0.05
226	000413	东旭光电	35,327	345,498.06	0.05
227	000960	锡业股份	17,111	344,786.65	0.05
228	600008	首创股份	23,778	341,214.30	0.05
229	601633	长城汽车	7,946	339,770.96	0.05
230	601808	中海油服	12,072	337,291.68	0.05
231	600600	青岛啤酒	7,237	337,171.83	0.05
232	600597	光明乳业	14,504	333,592.00	0.05
233	000400	许继电气	13,246	333,269.36	0.05
234	000750	国海证券	19,824	333,043.20	0.05
235	002292	奥飞动漫	8,746	331,036.10	0.05
236	600166	福田汽车	36,975	326,489.25	0.05
237	002410	广联达	13,952	326,476.80	0.05
238	000983	西山煤电	34,434	326,434.32	0.05
239	000027	深圳能源	25,751	318,024.85	0.05
240	000729	燕京啤酒	30,330	315,432.00	0.05
241	600497	驰宏锌锗	21,289	310,606.51	0.05
242	000831	五矿稀土	12,054	308,341.32	0.05
243	002470	金正大	14,076	305,589.96	0.05
244	002038	双鹭药业	5,385	305,060.25	0.05
245	300251	光线传媒	12,251	305,049.90	0.05
246	601258	庞大集团	55,762	304,460.52	0.05
247	600316	洪都航空	8,683	300,258.14	0.04
248	600277	亿利能源	20,198	295,294.76	0.04
249	000898	鞍钢股份	40,226	293,649.80	0.04
250	600516	方大炭素	24,647	293,545.77	0.04
251	601992	金隅股份	24,457	292,261.15	0.04
252	002422	科伦药业	7,255	290,490.20	0.04
253	600875	东方电气	13,949	285,536.03	0.04
254	601928	凤凰传媒	16,610	284,031.00	0.04
255	002344	海宁皮城	14,385	282,377.55	0.04

256	603000	人民网	5,386	280,772.18	0.04
257	601929	吉视传媒	18,552	280,506.24	0.04
258	600578	京能电力	31,282	279,348.26	0.04
259	002375	亚厦股份	11,331	271,490.76	0.04
260	600348	阳泉煤业	26,438	270,989.50	0.04
261	000963	华东医药	3,778	270,051.44	0.04
262	000876	新希望	13,298	258,114.18	0.04
263	601699	潞安环能	26,549	256,728.83	0.04
264	000999	华润三九	8,118	246,706.02	0.04
265	600549	厦门钨业	9,752	246,335.52	0.04
266	601118	海南橡胶	25,180	246,260.40	0.04
267	300015	爱尔眼科	7,540	243,240.40	0.04
268	601958	金钼股份	20,566	242,267.48	0.04
269	002475	立讯精密	7,161	242,113.41	0.04
270	002007	华兰生物	5,446	241,203.34	0.04
271	600373	中文传媒	9,914	237,539.44	0.04
272	600633	浙报传媒	12,007	235,337.20	0.03
273	601158	重庆水务	20,430	219,418.20	0.03
274	603288	海天味业	6,580	210,165.20	0.03
275	300146	汤臣倍健	5,326	209,205.28	0.03
276	600038	中直股份	3,265	202,266.75	0.03
277	002051	中工国际	6,620	197,143.60	0.03
278	002294	信立泰	6,738	192,706.80	0.03
279	300133	华策影视	7,128	192,456.00	0.03
280	002001	新和成	11,245	192,177.05	0.03
281	600648	外高桥	5,390	189,081.20	0.03
282	000937	冀中能源	23,029	184,692.58	0.03
283	002570	贝因美	9,285	180,221.85	0.03
284	600023	浙能电力	17,163	170,256.96	0.03
285	600188	兖州煤业	12,057	165,783.75	0.02
286	002399	海普瑞	4,812	163,559.88	0.02
287	600395	盘江股份	11,926	155,753.56	0.02
288	600783	鲁信创投	4,107	153,930.36	0.02
289	600998	九州通	6,627	148,179.72	0.02
290	600809	山西汾酒	4,754	134,252.96	0.02
291	002653	海思科	4,000	108,000.00	0.02
292	600485	信威集团	2,038	89,447.82	0.01
293	002416	爱施德	3,983	82,328.61	0.01
294	601225	陕西煤业	9,891	80,908.38	0.01

295	603993	洛阳钼业	4,651	57,486.36	0.01
296	601231	环旭电子	3,022	51,404.22	0.01
297	000156	华数传媒	685	24,509.30	0.00
298	300379	东方通	98	7,876.26	0.00
299	300380	安硕信息	28	3,053.40	0.00
300	300339	润和软件	35	1,683.15	0.00
301	300006	莱美药业	38	1,630.20	0.00
302	300244	迪安诊断	10	839.40	0.00
303	002303	美盈森	18	680.04	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300352	北信源	28,353,517.24	4.71
2	300290	荣科科技	23,285,618.63	3.87
3	300380	安硕信息	22,763,262.80	3.78
4	300155	安居宝	22,755,385.57	3.78
5	300287	飞利信	20,023,169.34	3.33
6	300291	华录百纳	18,094,208.43	3.01
7	002609	捷顺科技	17,033,816.87	2.83
8	000555	神州信息	16,184,107.16	2.69
9	300253	卫宁软件	15,857,650.54	2.64
10	600869	智慧能源	15,546,847.17	2.58
11	002496	辉丰股份	15,284,398.00	2.54
12	300033	同花顺	15,129,246.00	2.51
13	300150	世纪瑞尔	14,152,522.98	2.35
14	002488	金固股份	13,806,486.40	2.30
15	300168	万达信息	13,581,963.97	2.26
16	002664	信质电机	12,959,866.13	2.15
17	300165	天瑞仪器	12,946,206.94	2.15
18	300399	京天利	12,944,765.00	2.15
19	300244	迪安诊断	12,659,842.90	2.10
20	600571	信雅达	12,446,199.22	2.07

21	002589	瑞康医药	12,423,240.12	2.07
22	300347	泰格医药	12,102,076.19	2.01

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300352	北信源	38,216,750.54	6.35
2	300168	万达信息	31,001,920.52	5.15
3	300380	安硕信息	30,495,051.17	5.07
4	300231	银信科技	29,252,176.39	4.86
5	002184	海得控制	28,422,387.44	4.72
6	300287	飞利信	28,118,512.33	4.67
7	300290	荣科科技	27,303,171.19	4.54
8	300155	安居宝	25,661,357.50	4.27
9	002609	捷顺科技	24,230,585.74	4.03
10	300183	东软载波	22,592,156.42	3.76
11	002488	金固股份	22,061,209.97	3.67
12	002363	隆基机械	21,238,584.40	3.53
13	300291	华录百纳	20,296,815.48	3.37
14	300178	腾邦国际	19,980,216.91	3.32
15	300244	迪安诊断	18,926,383.92	3.15
16	300006	莱美药业	17,836,137.13	2.96
17	300347	泰格医药	17,164,945.34	2.85
18	000555	神州信息	17,027,826.81	2.83
19	300033	同花顺	16,642,666.00	2.77
20	300150	世纪瑞尔	16,350,825.23	2.72
21	002665	首航节能	16,275,318.45	2.71
22	002496	辉丰股份	15,848,830.88	2.63
23	300285	国瓷材料	15,396,774.99	2.56
24	300314	戴维医疗	15,276,900.05	2.54
25	002664	信质电机	14,931,266.97	2.48
26	000939	凯迪电力	14,786,117.15	2.46
27	002589	瑞康医药	14,528,082.43	2.42
28	300379	东方通	14,493,084.52	2.41
29	300339	润和软件	14,346,394.00	2.38
30	600486	扬农化工	12,832,404.60	2.13

31	600571	信雅达	12,581,764.38	2.09
32	601318	中国平安	12,114,831.30	2.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	944,667,954.66
卖出股票收入（成交）总额	1,243,425,513.16

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	76,284,000.00	11.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,996,000.00	19.44
	其中：政策性金融债	130,996,000.00	19.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	49,405.40	0.01
8	其他	-	-
9	合计	207,329,405.40	30.77

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	720,000	76,284,000.00	11.32
2	150206	15 国开 06	300,000	30,276,000.00	4.49
3	140357	14 进出 57	300,000	30,111,000.00	4.47
4	150408	15 农发 08	200,000	20,168,000.00	2.99
5	150403	15 农发 03	200,000	20,122,000.00	2.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	424,758.75

2	应收证券清算款	7,326,221.95
3	应收股利	-
4	应收利息	3,667,117.51
5	应收申购款	269,235.22
6	其他应收款	120.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,687,453.43

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600869	智慧能源	20,839,929.74	3.09	重大事项停牌
2	002712	思美传媒	13,452,950.00	2.00	重大资产重组
3	300392	腾信股份	9,361,800.00	1.39	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
14,899	20,356.33	67,006,339.55	22.09%	236,282,562.43	77.91%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	101,581.46	0.0335%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年7月15日）基金份额总额	1,067,242,501.27
本报告期期初基金份额总额	378,453,922.09
本报告期基金总申购份额	79,502,736.07
减：本报告期基金总赎回份额	154,667,756.18
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	303,288,901.98

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日(2003年7月15日)起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于2014年11月对公司进行了专项检查。公司于2015年1月23日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合	1	987,339,827.53	45.35%	898,873.71	45.35%	-
中信建投	1	661,431,021.45	30.38%	602,166.19	30.38%	-
平安证券	1	359,435,716.59	16.51%	327,229.76	16.51%	-
招商证券	1	169,040,838.45	7.76%	153,895.32	7.76%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：（1）选择标准：资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于5亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通

讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元没有变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰联合	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	81,399,265.99	81.00%	-	-	-	-
招商证券	19,088,871.75	19.00%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015年6月30日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015年5月30日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于	《中国证券报》、《证	2015年4月9日

	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理变更公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
4	关于调降华宝兴业网上交易汇款交易方式申购基金优惠费率至一折的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 4 月 9 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加申万宏源证券申购费率优惠活动及开通定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 3 月 3 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 3 月 2 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加渤海银行申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 2 月 14 日
8	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金第十二次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 1 月 13 日
9	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2015 年 1 月 1 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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 8 月 28 日