

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金 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
(2008 年 10 月 7 日至 2015 年 6 月 30 日)	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
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	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40

7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金
基金简称	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 7 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
报告期末基金份额总额	72,098,535.26 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		上海浦东新区世纪大道 100	北京市西城区复兴门内大街 1

	号上海环球金融中心 58 楼	号
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	郑安国	田国立

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	安永华明会计师事务所	北京市东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

§ 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	135,211,177.36
本期利润	102,704,716.55
加权平均基金份额本期利润	0.7797
本期加权平均净值利润率	36.07%
本期基金份额净值增长率	34.29%
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	95,303,654.23
期末可供分配基金份额利润	1.3219
期末基金资产净值	167,402,189.49
期末基金份额净值	2.3219
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	142.66%

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、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。

4、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）。

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	-20.40%	4.11%	-5.84%	2.80%	-14.56%	1.31%
过去三个月	8.69%	3.12%	8.86%	2.09%	-0.17%	1.03%
过去六个月	34.29%	2.47%	22.00%	1.81%	12.29%	0.66%
过去一年	63.92%	1.90%	81.80%	1.47%	-17.88%	0.43%
过去三年	73.07%	1.51%	67.10%	1.19%	5.97%	0.32%
自基金合同生效日起至 今	142.66%	1.44%	97.47%	1.32%	45.19%	0.12%

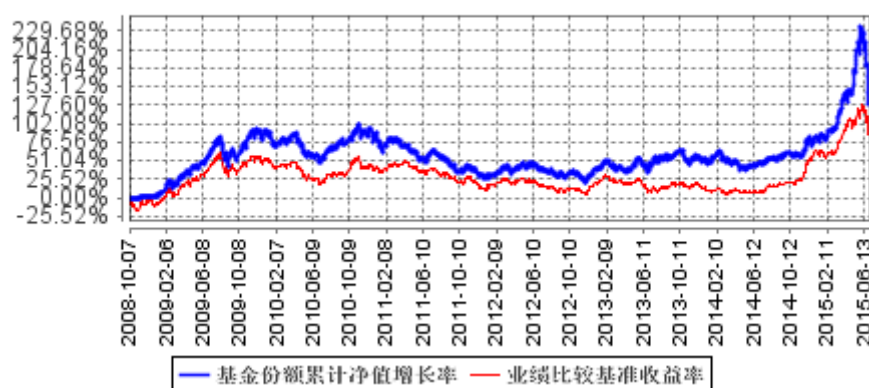
注：1、本基金比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

（2008 年 10 月 7 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 2009 年 4 月 7

日，本基金已达到基金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		
王智慧	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2012 年 1 月 19 日	-	14 年	管理学博士。曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009 年 8 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理和研究部总经理的职务，2012 年 1 月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理，2012 年 2 月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型

					证券投资基金基金经理，2013 年 2 月起兼任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2014 年 6 月任助理投资总监。
夏林锋	本基金经理、华宝兴业生态股票基金经理、华宝新价值混合基金经理	2014 年 10 月 22 日	-	5 年	硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任分析师，2012 年 10 月至 2014 年 10 月担任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理，2014 年 10 月起担任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，2015 年 2 月兼任华宝兴业生态中国股票型证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起兼任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、《华宝兴业大盘精选股票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。

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，大盘精选股票型证券投资基金在短期内出现过债券及现金投资占基金资产净值比超过 40%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，市场在持续强势之后出现回落。政策方面，传统经济政策仍然保持相当定力，“托而不举”的思路持续，强调在“双限”区间内调结构、促改革，而李克强总理在两会所提的“互联网+”行动计划成为重点转型方向，“大众创业、万众创新”有望成为经济增长新的动力。流动性方面，央行自去年四季度重启降息降准周期以来，一、二季度末各有一次降准、降息，同时采用 SLF、MLF、PSL 等方式进行调整，整体流动性较为宽松的局面得以维持，同时随着地产需求走向平稳，社会整体资金利率系统性下行，中国有望进入低利率时代。经济走势方面，截止目前来看，整体经济情况较弱，地产、基建等行业景气一般，社会发电、用电量、经济增加值等月度数据处于较低水平，虽然随着流动性宽松以及地产景气企稳等推动，长尾风险已然大幅减弱，但经济整体也较难向上超预期。企业盈利方面，从目前披露及跟踪的情况来看较为一般，且向上受制于整体经济“L”型走势以及新经济短期较难贡献盈利；向下得益于长尾风险消除，且新经济短期较难大幅贡献盈利，预估维持区间振荡的概率更大。海外市场方面，美联储加息时点日益临近，且希腊危机等导致欧元的不确定性因素加大，国际局势也不算特别平稳，美元仍有持续走强可能，新兴经济整体面临压力较大。

在上述背景下，叠加增量资金及互联网逻辑，市场持续上行，热点由均衡转向以“互联网+”为首的创新成长类公司。不过 6 月之后，监管部门对场外配资的规范导致增量资金逻辑有所弱化，市场出现较大幅度调整。本基金在上半年维持了较高仓位，并持续进行结构调整、优化，适度增

仓计算机、医药、新能源汽车等板块，适度降仓金融、地产、采掘、环保等板块，持续重视大盘价值与大盘成长之间的轮换。

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 34.29%，同期业绩比较基准增长率为 22.00%，基金表现领先比较基准 12.29%。

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，政策预期方面，宏观经济方面仍有可能维持“托而不举”的核心思路，重点在于深化改革相关措施的持续落实，同时十三五规划及相关重点产业规划、“互联网+”行动计划等值得重点关注；流动性方面，预期整体仍将维持宽松态势，降准降息周期有望延续，且随着城镇化进入中后期、人口逐步进入老龄化阶段，资金需求系统性下行，中国可能正式进入低利率时代；经济形势方面，整体可能仍然较弱，但在流动性宽松和政策托底的背景下，尾部风险爆发的概率不大，不过新经济短期也较难有大的贡献，估计仍将维持“L”型态势，而在此背景下，企业盈利可能也较一般，较难向上超预期。

综上判断，叠加市场预期演变及增量资金逻辑的弱化，2015 年下半年可能呈现宽幅震荡态势。一方面，前期市场涨幅较大，而严查配资等导致增量资金逻辑弱化，目前已在交易层面出现“股灾”迹象；另一方面，政府呵护市场态度较为坚决，居民资产配置在低利率时代转向风险资产的趋势仍在持续，因此牛市中长期的根基并未破坏，不应对市场过度悲观。本基金计划在 2015 年下半年维持中性略高仓位，持续重视结构调整，并在契约规定的范围内进一步优化大盘价值与大盘成长之间的配置，持续挖掘低估值蓝筹个股及能够穿越周期的优质成长股。

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及其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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

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	29,844,356.67	30,066,992.54
结算备付金		1,394,779.37	1,315,528.93
存出保证金		189,351.09	180,265.81
交易性金融资产	6.4.7.2	151,564,278.02	237,543,239.32
其中：股票投资		151,186,472.02	237,543,239.32
基金投资		-	-
债券投资		377,806.00	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,511.95	8,959.74
应收股利		-	-
应收申购款		539,835.72	284,946.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		183,541,112.82	269,399,933.24
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		4,603,711.98	1,675,965.28
应付赎回款		7,559,268.51	1,163,180.40
应付管理人报酬		333,158.63	343,591.08
应付托管费		55,526.44	57,265.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,234,118.43	1,931,639.15
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	353,139.34	511,033.12
负债合计		16,138,923.33	5,682,674.17
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	72,098,535.26	152,529,167.37
未分配利润	6.4.7.10	95,303,654.23	111,188,091.70
所有者权益合计		167,402,189.49	263,717,259.07
负债和所有者权益总计		183,541,112.82	269,399,933.24

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3219 元，基金份额总额 72,098,535.26 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

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		108,890,352.43	-6,494,456.10
1.利息收入		171,767.53	187,737.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	157,940.32	187,737.36
债券利息收入		21.65	-
资产支持证券利息收入		13,805.56	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		141,067,942.59	31,869,508.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	139,949,534.18	28,734,827.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	1,118,408.41	3,134,680.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-32,506,460.81	-38,567,242.71
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	157,103.12	15,540.36
减：二、费用		6,185,635.88	4,954,939.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,111,443.13	2,878,854.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	351,907.25	479,809.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,540,761.15	1,418,468.44
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	181,524.35	177,807.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		102,704,716.55	-11,449,395.30
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		102,704,716.55	-11,449,395.30
-------------------	--	----------------	----------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

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（基金净值）	152,529,167.37	111,188,091.70	263,717,259.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	102,704,716.55	102,704,716.55
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）	-80,430,632.11	-118,589,154.02	-199,019,786.13
其中：1.基金申购款	47,809,723.90	54,377,927.66	102,187,651.56
2.基金赎回款	-128,240,356.01	-172,967,081.68	-301,207,437.69
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	72,098,535.26	95,303,654.23	167,402,189.49
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）	319,417,631.23	148,507,845.95	467,925,477.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,449,395.30	-11,449,395.30
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）	-87,059,743.44	-40,282,279.59	-127,342,023.03

列)			
其中：1.基金申购款	10,063,514.00	4,680,772.55	14,744,286.55
2.基金赎回款	-97,123,257.44	-44,963,052.14	-142,086,309.58
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	232,357,887.79	96,776,171.06	329,134,058.85

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：

<u>黄小薏</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2008]956 号文《关于核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华宝兴业基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2008 年 10 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 490,050,880.11 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金对股票投资比例为基金资产净值的 60%–95%，其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%；权证投资比例为基金资产净值的 0%–3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%–20%；债券及现金投资比例为基金资产的 5%–40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%）。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，

同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 年上半年度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。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

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，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	29,844,356.67
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	29,844,356.67

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	161,766,115.22	151,186,472.02	-10,579,643.20
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	260,000.00	377,806.00
	银行间市场	—	—
	合计	260,000.00	377,806.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	162,026,115.22	151,564,278.02	-10,461,837.20

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	7,775.65
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	629.12
应收债券利息	21.65
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.33
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	85.20
合计	8,511.95

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	3,234,118.43
银行间市场应付交易费用	-

合计	3,234,118.43
----	--------------

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	-
应付赎回费	9,495.43
预提费用	343,643.91
合计	353,139.34

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	152,529,167.37	152,529,167.37
本期申购	47,809,723.90	47,809,723.90
本期赎回(以“-”号填列)	-128,240,356.01	-128,240,356.01
本期末	72,098,535.26	72,098,535.26

注：申购含转换入份额；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	81,332,504.44	29,855,587.26	111,188,091.70
本期利润	135,211,177.36	-32,506,460.81	102,704,716.55
本期基金份额交易产生的变动数	-98,157,097.41	-20,432,056.61	-118,589,154.02
其中：基金申购款	39,796,111.41	14,581,816.25	54,377,927.66
基金赎回款	-137,953,208.82	-35,013,872.86	-172,967,081.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	118,386,584.39	-23,082,930.16	95,303,654.23

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	139,458.83
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	16,774.01
其他	1,707.48
合计	157,940.32

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	1,240,213,108.30
减：卖出股票成本总额	1,100,263,574.12
买卖股票差价收入	139,949,534.18

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

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	1,118,408.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,118,408.41

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	-32,506,460.81
——股票投资	-32,624,266.81
——债券投资	117,806.00
——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	-32,506,460.81

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	55,593.40
转换费收入	101,509.72
合计	157,103.12

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2. 本基金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	3,540,761.15
银行间市场交易费用	-
合计	3,540,761.15

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	34,712.18
信息披露费	128,931.73
银行汇划费用	8,880.44
债券帐户维护费	9,000.00
合计	181,524.35

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

自 2015 年 7 月 22 日起，本基金名称由“华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金”变更为“华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金”，并相应修改基金简称，基金代码不变，投资范围不变（股票投资比例为基金资产的 60%-95%）。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

本基金本报告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 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,111,443.13	2,878,854.63
其中：支付销售机构的客户维护费	320,122.50	431,637.86

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	351,907.25	479,809.10

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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 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
期初持有的基金份额	266,740.28	266,740.28
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	-	-
期末持有的基金份额	266,740.28	266,740.28
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.37%	0.17%

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。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	29,844,356.67	139,458.83	37,558,851.93	179,987.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
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	34,200	4,958,575.00	4,573,908.00	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项停牌	27.70	2015年7月1日	30.00	49,411	889,391.50	1,368,684.70	-
002044	江苏三友	2015年6月18日	重大事项停牌	44.80	2015年7月1日	49.50	129,681	4,555,153.69	5,809,708.80	-
002589	瑞康医药	2015年5月21日	重大事项停牌	93.85	-	-	60,600	5,157,084.00	5,687,310.00	-
300155	安居宝	2015年6月15日	重大事项停牌	40.15	2015年7月20日	32.54	110,700	5,782,692.00	4,444,605.00	-
600645	中源协和	2015年4月27日	重大事项停牌	81.31	-	-	77,800	5,558,458.72	6,325,918.00	-

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。

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

本基金是一只股票型的证券投资基金，属于较高风险较高收益的基金品种。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以上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“风险和收益相匹配”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，独立地就内部控制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银行股份有限公司，因而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以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，因此违约风险可能性很小；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，通过对投资品种的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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金投资于一家上市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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分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 中列示的部分暂时流通受限的证券外，本基金持有的其余证券均能及时变现。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。

本基金所持有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、结算备付金及债券投资等。

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	29,844,356.67	-	-	-	29,844,356.67
结算备付金	1,394,779.37	-	-	-	1,394,779.37
存出保证金	189,351.09	-	-	-	189,351.09
交易性金融资产	377,806.00	-	-	151,186,472.02	151,564,278.02
应收利息	-	-	-	8,511.95	8,511.95
应收申购款	297.77	-	-	539,537.95	539,835.72
资产总计	31,806,590.90	-	-	151,734,521.92	183,541,112.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,603,711.98	4,603,711.98
应付赎回款	-	-	-	7,559,268.51	7,559,268.51
应付管理人报酬	-	-	-	333,158.63	333,158.63
应付托管费	-	-	-	55,526.44	55,526.44
应付交易费用	-	-	-	3,234,118.43	3,234,118.43
其他负债	-	-	-	353,139.34	353,139.34
负债总计	-	-	-	16,138,923.33	16,138,923.33
利率敏感度缺口	31,806,590.90	-	-	135,595,598.59	167,402,189.49
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	30,066,992.54	-	-	-	30,066,992.54
结算备付金	1,315,528.93	-	-	-	1,315,528.93
存出保证金	180,265.81	-	-	-	180,265.81
交易性金融资产	-	-	-	237,543,239.32	237,543,239.32
应收利息	-	-	-	8,959.74	8,959.74
应收申购款	298.21	-	-	284,648.69	284,946.90
资产总计	31,563,085.49	-	-	237,836,847.75	269,399,933.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,675,965.28	1,675,965.28
应付赎回款	-	-	-	1,163,180.40	1,163,180.40

应付管理人报酬	-	-	-	343,591.08	343,591.08
应付托管费	-	-	-	57,265.14	57,265.14
应付交易费用	-	-	-	1,931,639.15	1,931,639.15
其他负债	-	-	-	511,033.12	511,033.12
负债总计	-	-	-	5,682,674.17	5,682,674.17
利率敏感度缺口	31,563,085.49	-	-	-232,154,173.58	263,717,259.07

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资(2014 年 12 月 31 日：无)，但市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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，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，做出资产配置及投资组合构建的策略；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价格风险。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	151,186,472.02	90.31	237,543,239.32	90.07
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	377,806.00	0.23	—	—
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	151,564,278.02	90.54	237,543,239.32	90.07

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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. 业绩比较基准上升 5%	8,603,772.80	12,567,755.85
	2. 业绩比较基准下降 5%	-8,603,772.80	-12,567,755.85

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 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级的余额为 122,976,337.52 元，属于第二层级的余额为 28,587,940.50 元，无属于第三层级的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 214,521,552.77 元，属于第二层级的余额为 23,021,686.55 元，无属于第三层级的余额)。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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	151,186,472.02	82.37
	其中：股票	151,186,472.02	82.37
2	固定收益投资	377,806.00	0.21
	其中：债券	377,806.00	0.21
	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	31,239,136.04	17.02
7	其他各项资产	737,698.76	0.40
8	合计	183,541,112.82	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	-	-
B	采矿业	2,992,268.43	1.79
C	制造业	62,116,968.64	37.11
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	5,687,310.00	3.40
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	37,378,821.75	22.33
J	金融业	8,585,325.00	5.13
K	房地产业	15,743,087.10	9.40
L	租赁和商务服务业	7,688,869.70	4.59
M	科学研究和技术服务业	6,325,918.00	3.78
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	4,667,903.40	2.79
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	151,186,472.02	90.31

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	600649	城投控股	1,116,531	15,743,087.10	9.40

2	600271	航天信息	162,233	10,498,097.43	6.27
3	002236	大华股份	308,363	9,842,946.96	5.88
4	600446	金证股份	70,775	8,737,881.50	5.22
5	601166	兴业银行	497,700	8,585,325.00	5.13
6	002657	中科金财	87,967	8,094,723.34	4.84
7	600699	均胜电子	171,776	6,580,738.56	3.93
8	600645	中源协和	77,800	6,325,918.00	3.78
9	002044	江苏三友	129,681	5,809,708.80	3.47
10	002589	瑞康医药	60,600	5,687,310.00	3.40
11	300178	腾邦国际	144,142	5,204,967.62	3.11
12	300244	迪安诊断	55,610	4,667,903.40	2.79
13	300392	腾信股份	34,200	4,573,908.00	2.73
14	300155	安居宝	110,700	4,444,605.00	2.66
15	300168	万达信息	80,714	3,964,671.68	2.37
16	600570	恒生电子	33,680	3,773,844.00	2.25
17	002488	金固股份	114,250	3,710,840.00	2.22
18	300253	卫宁软件	68,962	3,586,024.00	2.14
19	300154	瑞凌股份	124,200	3,336,012.00	1.99
20	002153	石基信息	24,077	3,129,769.23	1.87
21	300157	恒泰艾普	202,317	2,992,268.43	1.79
22	002188	新嘉联	94,500	2,954,070.00	1.76
23	300165	天瑞仪器	71,600	2,489,532.00	1.49
24	600138	中青旅	117,609	2,483,902.08	1.48
25	002152	广电运通	67,134	2,171,113.56	1.30
26	002363	隆基机械	63,011	2,130,401.91	1.27
27	300109	新开源	25,200	1,788,696.00	1.07
28	002029	七匹狼	73,029	1,533,609.00	0.92
29	300348	长亮科技	13,800	1,518,000.00	0.91
30	300281	金明精机	63,600	1,499,688.00	0.90
31	002665	首航节能	49,411	1,368,684.70	0.82
32	300337	银邦股份	41,694	1,099,887.72	0.66
33	300242	明家科技	12,811	858,337.00	0.51

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	600570	恒生电子	36,466,719.17	13.83
2	600030	中信证券	25,973,666.19	9.85
3	002236	大华股份	25,273,110.66	9.58
4	600048	保利地产	22,474,877.00	8.52
5	600309	万华化学	18,860,169.86	7.15
6	002657	中科金财	18,708,601.40	7.09
7	600837	海通证券	17,621,948.00	6.68
8	600446	金证股份	16,413,789.00	6.22
9	002153	石基信息	15,427,485.72	5.85
10	600271	航天信息	15,078,705.45	5.72
11	600645	中源协和	14,053,048.72	5.33
12	601318	中国平安	13,928,081.71	5.28
13	600571	信雅达	13,640,964.95	5.17
14	600369	西南证券	13,638,008.93	5.17
15	300178	腾邦国际	13,420,224.02	5.09
16	002363	隆基机械	13,400,553.38	5.08
17	600699	均胜电子	13,147,281.15	4.99
18	000963	华东医药	13,134,553.31	4.98
19	601166	兴业银行	13,082,079.60	4.96
20	300231	银信科技	12,487,811.95	4.74
21	002594	比亚迪	11,584,381.06	4.39
22	000166	申万宏源	11,163,264.95	4.23
23	300273	和佳股份	10,932,535.53	4.15
24	300168	万达信息	10,745,957.50	4.07
25	300166	东方国信	10,142,311.23	3.85
26	300020	银江股份	9,796,240.44	3.71
27	002029	七匹狼	9,741,813.96	3.69
28	300291	华录百纳	9,692,875.00	3.68
29	300244	迪安诊断	9,688,972.21	3.67
30	601788	光大证券	9,527,481.99	3.61
31	300253	卫宁软件	9,051,407.40	3.43
32	300075	数字政通	8,793,561.03	3.33
33	300155	安居宝	8,654,963.00	3.28
34	600251	冠农股份	8,609,436.00	3.26
35	002664	信质电机	8,604,223.15	3.26

36	002462	嘉事堂	8,589,220.91	3.26
37	600690	青岛海尔	8,540,283.47	3.24
38	601169	北京银行	8,294,326.00	3.15
39	600138	中青旅	8,209,305.45	3.11
40	000776	广发证券	8,199,480.77	3.11
41	600089	特变电工	8,199,378.83	3.11
42	000961	中南建设	8,146,725.49	3.09
43	600000	浦发银行	7,907,401.35	3.00
44	600535	天士力	7,862,220.45	2.98
45	601928	XD 凤凰传	7,644,208.50	2.90
46	002044	江苏三友	7,010,680.00	2.66
47	300212	易华录	6,803,704.00	2.58
48	002098	浔兴股份	6,453,607.90	2.45
49	002551	尚荣医疗	6,269,334.17	2.38
50	300250	初灵信息	6,113,153.00	2.32
51	300154	瑞凌股份	6,011,596.55	2.28
52	000937	冀中能源	5,976,600.00	2.27
53	600958	东方证券	5,948,924.00	2.26
54	002315	焦点科技	5,940,908.65	2.25
55	002146	荣盛发展	5,926,509.58	2.25
56	600015	华夏银行	5,892,617.00	2.23
57	601088	中国神华	5,775,098.00	2.19
58	601179	中国西电	5,771,432.00	2.19
59	600312	平高电气	5,713,264.00	2.17
60	300147	香雪制药	5,713,132.41	2.17
61	002396	星网锐捷	5,697,179.00	2.16
62	002444	巨星科技	5,688,119.46	2.16
63	600366	宁波韵升	5,681,222.40	2.15
64	300205	天喻信息	5,614,608.00	2.13
65	000024	招商地产	5,571,594.70	2.11
66	002262	恩华药业	5,560,902.10	2.11
67	600594	益佰制药	5,463,461.28	2.07
68	601058	赛轮金宇	5,451,964.64	2.07
69	002009	天奇股份	5,425,287.16	2.06
70	300130	新国都	5,411,010.71	2.05
71	002188	新 嘉 联	5,370,551.00	2.04

72	002085	万丰奥威	5,359,255.00	2.03
----	--------	------	--------------	------

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	35,320,062.86	13.39
2	600030	中信证券	31,911,690.24	12.10
3	600837	海通证券	23,922,083.83	9.07
4	601318	中国平安	23,110,069.73	8.76
5	600048	保利地产	22,776,519.19	8.64
6	600309	万华化学	21,211,611.30	8.04
7	000024	招商地产	17,413,042.90	6.60
8	600000	浦发银行	17,411,289.75	6.60
9	600571	信雅达	17,338,326.70	6.57
10	002029	七匹狼	16,504,549.34	6.26
11	002236	大华股份	15,852,922.20	6.01
12	000963	华东医药	15,288,051.57	5.80
13	300291	华录百纳	14,709,393.62	5.58
14	600369	西南证券	14,230,414.04	5.40
15	600584	长电科技	13,816,479.06	5.24
16	601788	光大证券	13,666,545.03	5.18
17	002594	比亚迪	13,607,107.16	5.16
18	002153	石基信息	13,593,036.00	5.15
19	300231	银信科技	13,424,912.10	5.09
20	601928	XD 凤凰传	12,817,463.55	4.86
21	300020	银江股份	12,293,178.88	4.66
22	300178	腾邦国际	11,645,581.99	4.42
23	300166	东方国信	11,615,681.69	4.40
24	300273	和佳股份	11,548,127.87	4.38
25	000002	万科A	11,380,058.00	4.32
26	000166	申万宏源	10,886,702.86	4.13
27	601628	中国人寿	10,805,502.00	4.10
28	000937	冀中能源	10,740,246.80	4.07
29	002363	隆基机械	10,649,818.98	4.04
30	600690	青岛海尔	10,378,314.32	3.94
31	600352	浙江龙盛	9,955,116.08	3.77

32	002462	嘉事堂	9,626,037.20	3.65
33	600893	中航动力	9,351,186.27	3.55
34	600015	华夏银行	9,172,237.14	3.48
35	300212	易华录	9,035,873.32	3.43
36	002482	广田股份	8,761,380.47	3.32
37	002098	浔兴股份	8,719,522.17	3.31
38	600645	中源协和	8,646,712.64	3.28
39	002664	信质电机	8,585,594.02	3.26
40	601169	北京银行	8,553,138.48	3.24
41	000961	中南建设	8,437,101.87	3.20
42	600251	冠农股份	8,429,843.98	3.20
43	600699	均胜电子	8,383,555.88	3.18
44	002657	中科金财	8,301,168.20	3.15
45	600376	首开股份	8,249,996.60	3.13
46	000776	广发证券	8,124,298.67	3.08
47	600535	天士力	8,097,220.90	3.07
48	600089	特变电工	7,903,993.06	3.00
49	002146	荣盛发展	7,743,509.74	2.94
50	002185	华天科技	7,632,697.25	2.89
51	002444	巨星科技	7,562,135.46	2.87
52	300075	数字政通	7,183,913.80	2.72
53	002712	思美传媒	7,158,711.03	2.71
54	300130	新国都	7,101,777.08	2.69
55	300070	碧水源	7,060,707.14	2.68
56	600366	宁波韵升	6,919,599.11	2.62
57	600138	中青旅	6,873,616.63	2.61
58	002085	万丰奥威	6,780,810.95	2.57
59	002440	闰土股份	6,762,536.36	2.56
60	600118	中国卫星	6,711,970.00	2.55
61	002009	天奇股份	6,571,084.54	2.49
62	601699	潞安环能	6,555,039.00	2.49
63	300205	天喻信息	6,523,910.96	2.47
64	300250	初灵信息	6,520,443.51	2.47
65	601801	皖新传媒	6,376,022.18	2.42
66	600594	益佰制药	6,295,609.28	2.39
67	000598	兴蓉环境	6,278,683.90	2.38
68	002104	恒宝股份	6,268,592.00	2.38
69	601328	交通银行	6,203,500.00	2.35

70	300168	万达信息	6,057,618.12	2.30
71	000948	南天信息	5,984,106.00	2.27
72	600008	首创股份	5,952,805.31	2.26
73	600958	东方证券	5,917,719.00	2.24
74	601166	兴业银行	5,899,430.00	2.24
75	601058	赛轮金宇	5,846,485.61	2.22
76	300242	明家科技	5,844,255.00	2.22
77	300244	迪安诊断	5,836,065.20	2.21
78	002665	首航节能	5,835,833.34	2.21
79	002488	金固股份	5,796,693.69	2.20
80	600403	大有能源	5,796,179.22	2.20
81	002315	焦点科技	5,785,996.85	2.19
82	000728	国元证券	5,761,703.68	2.18
83	002051	中工国际	5,759,309.92	2.18
84	002551	尚荣医疗	5,669,501.67	2.15
85	300003	乐普医疗	5,622,648.76	2.13
86	600312	平高电气	5,423,118.68	2.06
87	002191	劲嘉股份	5,418,754.34	2.05
88	300347	泰格医药	5,383,999.30	2.04
89	002262	恩华药业	5,365,333.07	2.03
90	002396	星网锐捷	5,356,396.60	2.03

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	1,046,531,073.63
卖出股票收入（成交）总额	1,240,213,108.30

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	377,806.00	0.23
8	其他	—	—
9	合计	377,806.00	0.23

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	110031	航信转债	2,600	377,806.00	0.23

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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	189,351.09
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	8,511.95
5	应收申购款	539,835.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	737,698.76

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	002044	江苏三友	5,809,708.80	3.47	重大事项停牌
2	002589	瑞康医药	5,687,310.00	3.40	重大事项停牌
3	600645	中源协和	6,325,918.00	3.78	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
7,660	9,412.34	378,277.44	0.52%	71,720,257.82	99.48%

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	167,350.71	0.2321%

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（2008年10月7日）基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	152,529,167.37
本报告期基金总申购份额	47,809,723.90
减：本报告期基金总赎回份额	128,240,356.01
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	72,098,535.26

注：总申购份额含转换入份额；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

1、基金管理人的重大人事变动

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
海通证券	1	531,743,931.66	23.25%	470,539.75	22.97%	-
招商证券	1	406,124,241.58	17.76%	359,379.87	17.54%	-
广发证券	1	272,800,562.27	11.93%	248,357.11	12.12%	-
中金国际	2	209,231,724.62	9.15%	185,571.96	9.06%	-
兴业证券	2	202,629,368.58	8.86%	184,473.95	9.00%	-
国泰君安	1	142,026,410.18	6.21%	129,302.21	6.31%	-
中信建投	1	139,469,228.36	6.10%	126,972.34	6.20%	-
国海证券	2	125,994,800.75	5.51%	111,893.34	5.46%	-
齐鲁证券	1	96,883,751.91	4.24%	88,202.81	4.31%	-
申银万国	1	58,054,317.56	2.54%	52,852.26	2.58%	-
光大证券	1	48,367,245.71	2.12%	42,800.27	2.09%	-
中信金通	1	23,443,660.97	1.03%	21,343.06	1.04%	-
安信证券	1	15,033,164.74	0.66%	13,302.91	0.65%	-
长江证券	1	14,941,773.04	0.65%	13,602.76	0.66%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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：资力雄厚，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. 本基金本报告期新增券商交易单元信息如下：

兴业证券、安信证券、浙商证券、华创证券

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2015 年 6 月 30 日

	行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	报》以及基金管理人网站	
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	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
4	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
5	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
6	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
7	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 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2015 年 7 月 22 日发布了《华宝兴业基金管理有限公司关于修改华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金名称及基金合同的公告》，基金名称变更为“华宝兴业大盘精选混合型

证券投资基金”，基金简称变更为“华宝大盘精选混合”并相应修改了《基金合同》中的相关内容。本次变更事项自公告之日起生效，变更事项对本基金投资及投资者无不利影响，本公司已履行相关程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同；
华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书；
华宝兴业大盘精选股票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。

12.2 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。

12.3 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