

华宝兴业海外中国成长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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	12
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	13
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	13
§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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	35
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	38
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
7.7 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	41
7.8 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	41
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金融衍生品投资明细	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	41
7.11 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	43
§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	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业海外中国股票（QDII）
基金主代码	241001
交易代码	241001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 5 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	217,542,723.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于海外上市的中国公司的股票，在全球资本市场分享中国经济增长，追求资本长期增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。本基金各类资产配置的比例范围为：股票占基金资产总值的 60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的 5%-40%。
业绩比较基准	MSCI china free 指数(以人民币计算)
风险收益特征	本基金为股票型基金，在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。

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 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York, NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		-	NY10286

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《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	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.6 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	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	1,095,770.03
本期利润	-9,423,271.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0757

本期加权平均净值利润率	-5.07%
本期基金份额净值增长率	12.33%
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	49,929,321.71
期末可供分配基金份额利润	0.2295
期末基金资产净值	315,280,086.30
期末基金份额净值	1.449
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	44.90%

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	-7.88%	2.01%	-5.57%	1.60%	-2.31%	0.41%
过去三个月	5.84%	1.81%	6.10%	1.74%	-0.26%	0.07%
过去六个月	12.33%	1.53%	14.62%	1.42%	-2.29%	0.11%
过去一年	10.27%	1.30%	24.53%	1.24%	-14.26%	0.06%
过去三年	74.16%	1.19%	48.48%	1.14%	25.68%	0.05%
自基金合同生效日起至今	44.90%	1.39%	2.88%	1.85%	42.02%	-0.46%

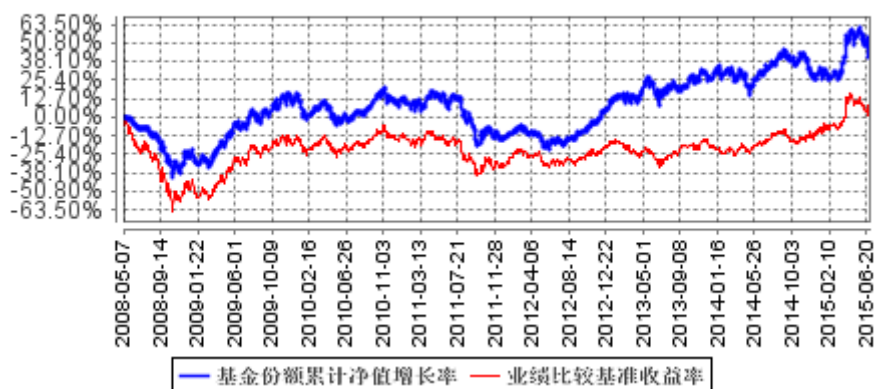
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：MSCI china free 指数(以人民币计算)。

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 5 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，自基金合同生效之日起不超过 6 个月内完成建仓，截至 2008 年 11 月 6 日，本基金已经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		
周欣	本基金基金经理， 华宝兴业资产管理（香港）有限公司投资部经理	2009 年 12 月 31 日	—	16 年	北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士，曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任海外投资管理部总经理。2009 年 12 月至今担任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理（香港）有限公司投资部经理。
俞翼之	本基金基金经理助理	2013 年 3 月 7 日	—	10 年	硕士。曾在上海上元投资管理有限公司、永丰金证券（上海代表处）、凯基证券（上海代表处）从事证券研究工作。2011 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任海外投资管理部高级分析师，2013 年 3 月起兼任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理。

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业海外中国成长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，海外中国成长股票型证券投资基金在短期内出现过持有股票占基金资产净值比低于 60%以及持有股票占基金资产净值超过 95%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

上半年港股市场在 A 股市场强劲表现带动下大幅上涨, 恒生指数上涨 11.2%, 恒生国企指数上涨 8.3%, MSCI China Free 指数上涨 14.6%。中国央行在去年 11 月底第一次降息之后, 在上半年继续实行偏宽松的货币政策, 多次降息和降低存款准备金率, 有利于降低企业的融资成本, 释放流动性, 推动市场情绪上升。A 股市场自去年底以来呈现出巨大的赚钱效应, 刺激后续资金来源不断流入股市, A 股市场的乐观情绪也带动了港股市场, 一季度首先推动保险、券商、银行等强周期股上涨。4 月初中国证监会宣布开放公募基金通过沪港通投资港股市场, 引起市场对于增量大陆资金投资港股的强烈预期。同时由于此时港股相对 A 股估值折扣非常明显, 因此带动港股大小盘中资股票大幅上涨。6 月中旬香港立法会就 2017 年香港特首选举改革方案进行投票未获通过, 市场担心此前酝酿之中的深港通、QDII2 等支持香港经济的政策会延缓实施, 造成各行业板块的普遍下跌, 尤其是前期涨幅较高的中小市值 TMT 类个股。另外 6 月中旬举行的美国联储的议息会议使市场担心美国提前加息会引发资金从新兴市场流向美国, 关于希腊债务违约问题的谈判失败也加重了市场的紧张情绪, 造成港股市场的一定卖压。A 股市场在 6 月中旬开始的剧烈调整也拖累了港股市场表现。

上半年表现最为强劲的是信息科技板块, 大涨 32.3%, 显著跑赢大盘表现, 主要是由于腾讯的朋友圈广告的推出大大提高了投资者对其移动广告盈利前景的预期。工业板块也十分强劲, 大涨 18.4%, 主要是由于环保公司业绩前景强劲带动估值提升, 中国推动“一路一带”计划带动铁路设备和基建类公司股价上涨。医疗保健板块下跌 1.4%, 主要因为医药类公司的盈利前景受到中国医保药物招标政策收紧的负面影响。能源板块受到原油价格下跌和煤炭价格低迷拖累只小涨 0.3%。原材料、可选消费、金融板块分别上涨 13.8%、13.5%和 11.6%。电信服务、公用事业、必需消费分别上涨 10.3%、8.9%和 5.0%。本基金在上半年增持了环保、地产、保险类股和可能受益于私有化浪潮的在美上市中概股, 减持了暂时缺乏催化剂的医药、汽车、新能源类股, 由于在二季度基金出现大额申购, 摊薄了收益率, 投资组合跑输了业绩基准。

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 12.33%, 而同期业绩比较基准收益率为 14.62%, 跑输业绩基准 2.29%。业绩差异主要由于二季度基金出现大额申购, 摊薄了收益率。

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，我们认为香港市场以及海外中国概念股市场可能呈现震荡上涨，表现分化格局。制约港股市场表现的几个主要外部因素趋于缓和。中国 A 股经过 6 月中旬到 7 月中旬的剧烈下跌之后，市场的炙热炒风明显降低。中国政府已经宣布组建市场平准基金的救市一揽子计划，在政府强力救市措施影响之下，市场的流动性危机已经基本消除，市场信心处于逐步恢复过程之中，A 股市场经过短期大幅震荡之后有望走稳，因此港股市场与 A 股相关的流动性收缩基本消除。A 股股灾消退之后，使得市场预期中国金融体系不会出现显著的系统性风险，股灾对实体经济的损害也很有限。这些都有利于港股市场下半年的良好表现。美国联储 6 月议息会议的公告总体比较鸽派，降低了对 2016 年底美国利息水平的预测，调低了未来一两年美国经济增长率的预测，因此有助于稳定市场预期，稳定新兴市场的资金流动性。我们判断美国将于年底之前开始加息，并且加息的幅度和频率也将是温和的。希腊已经与欧元区达成通过经济改革获得持续的资金援助的协议，希腊退出欧元区的风险短期内暂时消除。此外，香港政制改革方案在立法会投票未能获得通过之后，香港并未出现此前市场担心的占领中环等政治抗争事件，中央政府对香港的经济支持政策也未改变。中港基金互认于 7 月 1 日开始实施。酝酿中的深港通和 QDII2 政策在相关细则确定之后仍有望年内公布实施，有助于有分散投资需求的大陆资金南下配置估值相对较低的香港股票并推动市场表现。二季度一度在 A 股牛市溢出效应影响下大幅上涨的中小市值股票近期受 A 股市场深幅调整带动下调较多，从估值角度看十分具有吸引力。目前港股的估值水平位于其历史区间的底部区域，非常便宜。我们对下半年市场表现总体持乐观态度，我们拟利用短期的市场波动挖掘环保、地产、保险等板块、国企改革主题类个股。

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，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，本基金未实施利润分配。

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

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： 华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

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	21,265,058.53	6,484,408.54
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	300,659,686.06	62,603,693.14
其中：股票投资		300,659,686.06	62,603,693.14
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		8,881,337.20	679,457.56
应收利息	6.4.7.5	1,065.10	569.75
应收股利		2,173,076.95	-
应收申购款		52,195.85	23,587.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	346,916.23	-
资产总计		333,379,335.92	69,791,716.17
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		4,763,464.45	-
应付赎回款		12,256,714.33	698,181.39
应付管理人报酬		514,015.97	109,498.90
应付托管费		99,947.55	21,291.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	465,107.32	397,069.85
负债合计		18,099,249.62	1,226,041.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	217,542,723.56	53,164,071.61
未分配利润	6.4.7.10	97,737,362.74	15,401,602.94
所有者权益合计		315,280,086.30	68,565,674.55
负债和所有者权益总计		333,379,335.92	69,791,716.17

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.449 元，基金份额总额 217,542,723.56 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

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		-6,513,336.80	3,453,574.26
1.利息收入		35,732.60	8,623.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,732.60	8,623.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
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）		7,254,691.10	1,709,442.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,475,468.51	944,128.16
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,779,222.59	765,314.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-10,519,041.05	1,630,943.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-3,477,098.62	91,331.63
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	192,379.17	13,233.70
减：二、费用		2,909,934.22	1,294,936.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,616,836.60	751,802.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	314,384.94	146,183.74
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.20	899,823.88	238,440.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	78,888.80	158,510.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,423,271.02	2,158,638.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,423,271.02	2,158,638.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

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）	53,164,071.61	15,401,602.94	68,565,674.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-9,423,271.02	-9,423,271.02
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）	164,378,651.95	91,759,030.82	256,137,682.77
其中：1.基金申购款	272,120,832.03	149,674,232.48	421,795,064.51
2.基金赎回款	-107,742,180.08	-57,915,201.66	-165,657,381.74
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）	217,542,723.56	97,737,362.74	315,280,086.30
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）	68,515,879.28	19,245,062.20	87,760,941.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,158,638.05	2,158,638.05
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）	-5,816,979.75	-1,715,238.16	-7,532,217.91
其中：1.基金申购款	5,094,446.76	1,444,695.82	6,539,142.58
2.基金赎回款	-10,911,426.51	-3,159,933.98	-14,071,360.49
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）	62,698,899.53	19,688,462.09	82,387,361.62

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	_____ 向辉	_____ 张幸骏
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

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2007]第 333 号《关于同意华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 462,646,980.69 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 052 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 5 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 462,709,489.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 62,508.33 份基金份额。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，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New

York Mellon Corporation)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为股票、固定收益证券、银行存款和法律法规允许的其他投资工具，其中股票投资范围包括香港证交所上市的所有股票和在新加坡、美国上市的中国公司，中国公司指收入的 50%以上来源于中国大陆的公司；固定收益证券投资范围为具有标准普尔评级为“A”以上或同等评级的发行人在中国证监会认可的中国大陆以外市场(包括香港、新加坡、美国)发行的固定收益证券，在流动性充足的情况下，主要投资香港债券市场。在正常市场情况下，本基金各类资产配置的比例范围是：股票占基金资产总值的 60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的 5%-40%。本基金的业绩比较基准为：MSCI China Free 指数(以人民币计算)。

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》、《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注中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于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	21,265,058.53
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计：	21,265,058.53

注：于2015年6月30日，活期存款包括人民币活期存款6,512,510.35元，港元活期存款7,981,214.34元(折合人民币6,293,931.88元)和美元活期存款1,383,573.72元(折合人民币8,458,616.30)。

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	308,348,671.68	300,659,686.06	-7,688,985.62

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		308,348,671.68	300,659,686.06	-7,688,985.62

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	1,065.10
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,065.10

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	346,916.23
待摊费用	—
合计	346,916.23

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

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	43,795.44
应付在途资金	346,929.93
预提费用	74,381.95
合计	465,107.32

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	53,164,071.61	53,164,071.61
本期申购	272,120,832.03	272,120,832.03
本期赎回(以“-”号填列)	-107,742,180.08	-107,742,180.08
本期末	217,542,723.56	217,542,723.56

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	11,970,519.83	3,431,083.11	15,401,602.94
本期利润	1,095,770.03	-10,519,041.05	-9,423,271.02
本期基金份额交易产生的变动数	36,863,031.85	54,895,998.97	91,759,030.82
其中：基金申购款	60,420,061.68	89,254,170.80	149,674,232.48
基金赎回款	-23,557,029.83	-34,358,171.83	-57,915,201.66
本期已分配利润	—	—	—
本期末	49,929,321.71	47,808,041.03	97,737,362.74

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	31,449.23
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	-
其他	4,283.37
合计	35,732.60

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	140,316,767.04
减：卖出股票成本总额	135,841,298.53
买卖股票差价收入	4,475,468.51

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 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	2,779,222.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,779,222.59

6.4.7.18 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	-10,519,041.05
——股票投资	-10,519,041.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-10,519,041.05

6.4.7.19 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	192,379.17
合计	192,379.17

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.20 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	899,823.88
银行间市场交易费用	-
合计	899,823.88

6.4.7.21 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	29,752.78
信息披露费	44,629.17
银行汇划费	125.00
其他	4,381.85
合计	78,888.80

6.4.7.22 分部报告

无。

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“华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金”变更为“华宝兴业海外中国成长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
纽约梅隆银行股份有限公司（“纽约梅隆银行”）(The Bank of New York Mellon Corporation)	境外资产托管人
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

本基金本报告期内与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	1,616,836.60	751,802.29
其中：支付销售机构的客户维护费	159,871.61	83,746.82

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%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 X1.8% / 当年天数。

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	314,384.94	146,183.74

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 0.35%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 X0.35% / 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 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	475,646.38	475,646.38
期间申购/买入总份额	625,457.36	-
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	1,101,103.74	475,646.38
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.51%	0.76%

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
中国建设银行	8,913,680.86	31,449.23	2,472,127.31	8,597.14
纽约梅隆银行	12,351,377.67	-	13,827,193.96	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金是一只主动投资海外证券的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、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及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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行以及境外托管行纽约梅隆银行，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

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，其余亦可在场外交易市场交易，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。

本基金持有及承担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	21,265,058.53	-	-	-	21,265,058.53
交易性金融资产	-	-	-	300,659,686.06	300,659,686.06
应收证券清算款	-	-	-	8,881,337.20	8,881,337.20
应收利息	-	-	-	1,065.10	1,065.10
应收股利	-	-	-	2,173,076.95	2,173,076.95
应收申购款	-	-	-	52,195.85	52,195.85
其他资产	-	-	-	346,916.23	346,916.23
资产总计	21,265,058.53	-	-	312,114,277.39	333,379,335.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,763,464.45	4,763,464.45
应付赎回款	-	-	-	12,256,714.33	12,256,714.33
应付管理人报酬	-	-	-	514,015.97	514,015.97
应付托管费	-	-	-	99,947.55	99,947.55
其他负债	-	-	-	465,107.32	465,107.32
负债总计	0.00	0.00	0.00	18,099,249.62	18,099,249.62
利率敏感度缺口	21,265,058.53	0.00	0.00	294,015,027.77	315,280,086.30
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	6,484,408.54	-	-	-	6,484,408.54
交易性金融资产	-	-	-	62,603,693.14	62,603,693.14
应收证券清算款	-	-	-	679,457.56	679,457.56
应收利息	-	-	-	569.75	569.75
应收申购款	497.02	-	-	23,090.16	23,587.18
资产总计	6,484,905.56	-	-	63,306,810.61	69,791,716.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	698,181.39	698,181.39
应付管理人报酬	-	-	-	109,498.90	109,498.90
应付托管费	-	-	-	21,291.48	21,291.48
其他负债	-	-	-	397,069.85	397,069.85
负债总计	-	-	-	1,226,041.62	1,226,041.62
利率敏感度缺口	6,484,905.56	-	-	62,080,768.99	68,565,674.55

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，本基金未持有交易性债券投资(2014年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014年12月31日：同)。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	8,458,616.30	6,293,931.88	-	14,752,548.18
交易性金融资产	58,756,088.73	241,903,597.33	-	300,659,686.06
应收股利	-	1,580,120.95	-	1,580,120.95
应收利息	-	1.59	-	1.59
应收证券清算款	-	8,881,337.20	-	8,881,337.20
其它资产	346,916.23	-	-	346,916.23
资产合计	67,561,621.26	258,658,988.95	-	326,220,610.21
以外币计价的负债				
应付证券清算款	4,763,464.45	-	-	4,763,464.45
其它负债	-	346,929.93	-	346,929.93
负债合计	4,763,464.45	346,929.93	-	5,110,394.38
资产负债表外汇风险敞口净额	62,798,156.81	258,312,059.02	-	321,110,215.83
项目	上年度末 2014年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,878.83	4,481,574.14	-	4,483,452.97
交易性金融资产	7,578,781.46	55,024,911.68	-	62,603,693.14
应收利息	-	0.43	-	0.43
应收证券清算款	-	679,457.56	-	679,457.56
资产合计	7,580,660.29	60,185,943.81	-	67,766,604.10
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	7,580,660.29	60,185,943.81	-	67,766,604.10

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假	除汇率以外的其他市场变量保持不变
---	------------------

设			
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. 所有外币相对人民币升值 5%	16,055,510.79	3,388,330.21
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-16,055,510.79	-3,388,330.21

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占基金资产总值的 60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的 5%-40%。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	300,659,686.06	95.36	62,603,693.14	91.30
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	300,659,686.06	95.36	62,603,693.14	91.30

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%	13,348,096.56	2,496,016.82
	2. 业绩比较基准下降 5%	-13,348,096.56	-2,496,016.82

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次的余额为 300,659,686.06 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 62,603,693.14 元，无第二层次和第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(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	300,659,686.06	90.19
	其中：普通股	241,903,597.33	72.56
	存托凭证	58,756,088.73	17.62
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,265,058.53	6.38
8	其他各项资产	11,454,591.33	3.44
9	合计	333,379,335.92	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
香港	241,903,597.33	76.73
美国	58,756,088.73	18.64
合计	300,659,686.06	95.36

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	0.00	0.00
材料	0.00	0.00
工业	70,533,022.83	22.37
非必需消费品	31,693,923.57	10.05
必需消费品	0.00	0.00
保健	2,124,154.82	0.67
金融	146,726,017.69	46.54
信息技术	33,669,031.07	10.68
电信服务	0.00	0.00
公用事业	15,913,536.08	5.05
合计	300,659,686.06	95.36

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港	CH	316,500	26,132,048.74	8.29
2	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	香港	CH	3,784,000	25,334,473.40	8.04
3	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	香港	CH	5,262,000	24,938,962.33	7.91
4	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL	绿色动力环保	1330 HK	香港	CH	4,449,000	18,664,961.63	5.92

	PR-H							
5	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港	CH	686,000	15,066,153.18	4.78
6	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑 国际	3311 HK	香港	CH	1,318,000	14,509,548.28	4.60
7	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港	CH	1,149,800	14,217,440.72	4.51
8	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外 发展	688 HK	香港	CH	494,000	10,654,604.74	3.38
9	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港	CH	532,000	10,551,220.16	3.35
10	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	中国光大 国际	257 HK	香港	CH	821,000	8,999,347.48	2.85
11	CAR INC	神州租车	699 HK	香港	CH	689,000	8,965,122.53	2.84
12	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大 控股	165 HK	香港	CH	330,000	7,000,342.41	2.22
13	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水务 集团	371 HK	香港	CH	1,352,000	6,780,892.68	2.15
14	XUNLEI LTD-ADR	迅雷公司	XNET US	纳斯 达克	AE	88,422	6,508,543.95	2.06
15	TUNIU CORP-SPON ADR	南京途牛 科技有限 公司	TOUR US	纳斯 达克	AE	57,500	6,334,606.65	2.01
16	YY INC-ADR	欢聚时代	YY US	纳斯 达克	AE	14,904	6,334,460.41	2.01
17	E-COMMERCE CHINA-SPON ADR -A	当当网	DANG US	纽约	AE	111,300	6,117,188.69	1.94
18	PHOENIX NEW MEDIA LTD -ADR	凤凰新媒 体有限公 司	FENG US	纽约	AE	125,900	6,096,041.75	1.93
19	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	2628 HK	香港	CH	228,000	6,068,225.17	1.92
20	YOUKU TUDOU INC-ADR	优酷土豆	YOKU US	纽约	AE	39,500	5,923,681.02	1.88
21	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村 商业银行 股份有限 公司	3618 HK	香港	CH	1,182,000	5,788,448.05	1.84
22	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	康达环保	6136 HK	香港	CH	1,955,000	5,442,200.41	1.73
23	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	东江环保	895 HK	香港	CH	391,500	5,155,862.19	1.64

24	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股 集团	884 HK	香港	CH	3,032,000	4,853,760.00	1.54
25	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽人	2298 HK	香港	CH	772,000	4,651,186.16	1.48
26	BONA FILM GROUP LTD-SPON ADR	博纳影业 集团有限 公司	BONA US	纳斯 达克	AE	62,169	4,636,932.06	1.47
27	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	万达商业	3699 HK	香港	CH	70,000	3,441,815.30	1.09
28	CTRP.COM INTERNATIONAL-ADR	Ctrip.com 国际有限 公司	CTRP US	纳斯 达克	AE	7,500	3,329,772.24	1.06
29	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	奇虎 360 科技有限 公司	QIHU US	纽约	AE	7,870	3,256,838.83	1.03
30	NQ MOBILE INC - ADR	北京网秦 天下科技 有限公司	NQ US	纽约	AE	95,000	3,066,581.76	0.97
31	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	香港	CH	918,000	2,685,775.17	0.85
32	TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	达内科技 国际有限 公司	TEDU US	纳斯 达克	AE	30,910	2,392,377.62	0.76
33	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	1813 HK	香港	CH	463,000	2,387,876.18	0.76
34	JUMEI INTERNATIONAL-ADR	聚美优品	JMEI US	纽约	AE	16,300	2,276,044.37	0.72
35	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	中国动物 保健品	940 HK	香港	CH	518,000	2,124,154.82	0.67
36	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	中国宏泰 发展	6166 HK	香港	CH	741,000	2,115,338.35	0.67
37	CHINACACHE INTERNAT-SPON ADR	蓝汛国际 控股有限 公司	CCIH US	纳斯 达克	AE	24,570	1,880,643.62	0.60
38	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	远洋地产	3377 HK	香港	CH	360,000	1,663,616.35	0.53
39	SOUND GLOBAL LTD	桑德国际	967 HK	香港	CH	182,000	1,004,667.82	0.32
40	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	香港	CH	290,000	985,662.72	0.31
41	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港	CH	174,000	946,785.07	0.30
42	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO	花样年控 股	1777 HK	香港	CH	690,000	729,133.33	0.23
43	NETEASE INC-ADR	网易公司	NTES US	纳斯	AE	680	602,239.73	0.19

				达克				
44	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	香港	CH	1,000	20,740.00	0.01
45	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	27 HK	香港	CH	700	17,057.27	0.01
46	SANDS CHINA LTD	金沙中国有限公司	1928 HK	香港	CH	300	6,174.69	0.00
47	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	唯品会控股有限公司	VIPS US	纽约	AE	1	136.03	0.00

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	337 HK	28,466,121.06	41.52
2	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	22,194,648.81	32.37
3	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	21,848,955.34	31.87
4	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	20,335,603.01	29.66
5	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	20,183,502.66	29.44
6	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	1330 HK	19,252,287.99	28.08
7	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3328 HK	15,905,187.25	23.20
8	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	12,546,211.50	18.30
9	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	12,388,272.55	18.07
10	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	10,645,149.79	15.53
11	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	10,520,576.18	15.34
12	TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	TEDU US	10,370,372.34	15.12
13	CAR INC	699 HK	9,153,354.55	13.35
14	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	8,905,807.53	12.99

15	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	8,107,161.73	11.82
16	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	7,957,101.07	11.61
17	YY INC-ADR	YY US	7,849,270.13	11.45
18	E-COMMERCE CHINA-SPON ADR -A	DANG US	7,110,172.64	10.37
19	XUNLEI LTD-ADR	XNET US	6,968,833.99	10.16
20	PHOENIX NEW MEDIA LTD -ADR	FENG US	6,893,606.46	10.05
21	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	6136 HK	6,773,441.66	9.88
22	TUNIU CORP-SPON ADR	TOUR US	6,754,846.38	9.85
23	YOUKU TUDOU INC-ADR	YOKU US	6,620,261.18	9.66
24	BONA FILM GROUP LTD-SPON ADR	BONA US	6,413,891.58	9.35
25	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	NOAH US	6,186,909.56	9.02
26	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	6,177,689.83	9.01
27	CHINA MOBILE GAMES-ADR	CMGE US	6,153,076.19	8.97
28	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	5,598,222.83	8.16
29	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	5,142,292.22	7.50
30	CHINA EVERBRIGHT LTD	165 HK	4,935,378.59	7.20
31	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	3,990,608.15	5.82
32	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	2298 HK	3,975,277.25	5.80
33	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	3,644,447.70	5.32
34	NQ MOBILE INC - ADR	NQ US	3,550,613.59	5.18
35	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	3,499,139.81	5.10
36	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP US	3,431,861.40	5.01
37	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	QIHU US	3,193,947.51	4.66
38	CHINA MERCHANTS LAND LTD	978 HK	2,938,177.92	4.29
39	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	2,473,848.77	3.61
40	JUMEI INTERNATIONAL-ADR	JMEI US	2,410,346.11	3.52
41	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	6166 HK	2,255,817.03	3.29
42	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	2,179,940.37	3.18
43	CHINACACHE INTERNAT-SPON ADR	CCIH US	2,137,848.63	3.12
44	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	SFUN US	1,755,702.30	2.56
45	SOUND GLOBAL LTD	967 HK	1,522,095.23	2.22
46	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	816 HK	1,507,919.58	2.20

47	FRANSHION PROPERTIES	817 HK	1,394,502.78	2.03
48	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	3377 HK	1,386,143.61	2.02

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	21,375,877.93	31.18
2	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3328 HK	17,029,977.57	24.84
3	TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	TEDU US	10,148,621.67	14.80
4	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	7,853,168.92	11.45
5	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	7,171,410.01	10.46
6	CHINA MOBILE GAMES-ADR	CMGE US	6,302,523.56	9.19
7	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	NOAH US	6,053,883.07	8.83
8	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	4,250,445.64	6.20
9	DAWN RAYS PHARMACEUTICAL HOLD	2348 HK	3,900,164.63	5.69
10	CHINA MERCHANTS LAND LTD	978 HK	3,624,831.06	5.29
11	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	3,619,717.75	5.28
12	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	3,427,692.83	5.00
13	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	3,387,582.97	4.94
14	BONA FILM GROUP LTD-SPON ADR	BONA US	3,366,544.04	4.91
15	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	3,215,713.55	4.69
16	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	2,908,028.81	4.24
17	SIHUA PHARMACEUTICAL HLDGS	460 HK	2,665,096.62	3.89
18	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	182 HK	2,493,819.85	3.64
19	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	2,291,544.58	3.34
20	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	2,290,348.65	3.34
21	YY INC-ADR	YY US	2,249,499.05	3.28
22	JINKOSOLAR HOLDING CO-ADR	JKS US	1,920,320.76	2.80
23	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	1,858,211.08	2.71
24	FRANSHION PROPERTIES	817 HK	1,850,546.51	2.70
25	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	1,791,519.28	2.61

26	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	SFUN US	1,690,802.74	2.47
27	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	1,579,079.44	2.30

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	384,416,332.5
卖出收入（成交）总额	140,316,767.04

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	8,881,337.20

3	应收股利	2,173,076.95
4	应收利息	1,065.10
5	应收申购款	52,195.85
6	其他应收款	346,916.23
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,454,591.33

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
4,146	52,470.51	90,443,096.81	41.57%	127,099,626.75	58.43%

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	2,504,166.60	1.1511%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年5月7日）基金份额总额	462,709,489.02
本报告期期初基金份额总额	53,164,071.61
本报告期基金总申购份额	272,120,832.03
减：本报告期基金总赎回份额	107,742,180.08
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	217,542,723.56

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

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（2008年5月7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	
Nomura International (HK) Ltd	-	288,185,774.94	54.92%	125,764.70	26.64%	-
申万	-	68,402,034.10	13.04%	136,804.06	28.97%	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	68,036,328.27	12.97%	27,214.53	5.76%	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	-	53,838,245.58	10.26%	107,676.51	22.81%	-
BOCI Securities Ltd	-	22,157,132.05	4.22%	33,235.69	7.04%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	21,137,480.52	4.03%	35,498.68	7.52%	-
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	2,976,104.15	0.57%	5,952.20	1.26%	-

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、本报告期租用的证券公司交易单元无变化。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

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华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金增加代销机构的公告	《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 14 日
4	关于调整华宝兴业海外中国成长基金网上直销申购费率优惠的公告	《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 10 日
5	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
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
7	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
8	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
9	华宝兴业海外中国成长股票型证	基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日

	券投资基金资产净值公告	
--	-------------	--

§ 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《修改华宝兴业海外中国成长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“华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金”，基金简称变更为“华宝海外中国混合”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；
华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同；
华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金招募说明书；
华宝兴业海外中国成长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办公场所备投资者查阅。

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