

华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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 2016 年 3 月 23 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	41
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	41
8.4 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	41
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	44
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	50

8.7 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	50
8.8 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	51
8.9 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	51
8.10 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	51
8.11 投资组合报告附注	51
§9 基金份额持有人信息.....	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
9.3 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	52
§10 开放式基金份额变动.....	52
§11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
11.2 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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 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混合型证券投资基金
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	178,242,021.71 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	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金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
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
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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-34,941,790.24	5,302,298.82	23,795,422.72
本期利润	-54,861,895.60	1,019,840.03	19,151,214.94

加权平均基金份额本期利润	-0.3736	0.0163	0.2057
本期加权平均净值利润率	-27.80%	1.22%	17.29%
本期基金份额净值增长率	-2.25%	0.70%	19.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	-2,634,177.13	11,970,519.83	9,637,519.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0148	0.2252	0.1407
期末基金资产净值	224,814,373.97	68,565,674.55	87,760,941.48
期末基金份额净值	1.261	1.290	1.281
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	26.10%	29.00%	28.10%

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、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
过去三个月	9.84%	0.80%	6.22%	1.40%	3.62%	-0.60%
过去六个月	-12.97%	2.30%	-15.78%	1.83%	2.81%	0.47%
过去一年	-2.25%	1.96%	-3.47%	1.64%	1.22%	0.32%
过去三年	17.63%	1.49%	7.86%	1.30%	9.77%	0.19%
过去五年	14.85%	1.38%	2.34%	1.38%	12.51%	0.00%
自基金合同生效日起至今	26.10%	1.47%	-13.35%	1.84%	39.45%	-0.37%

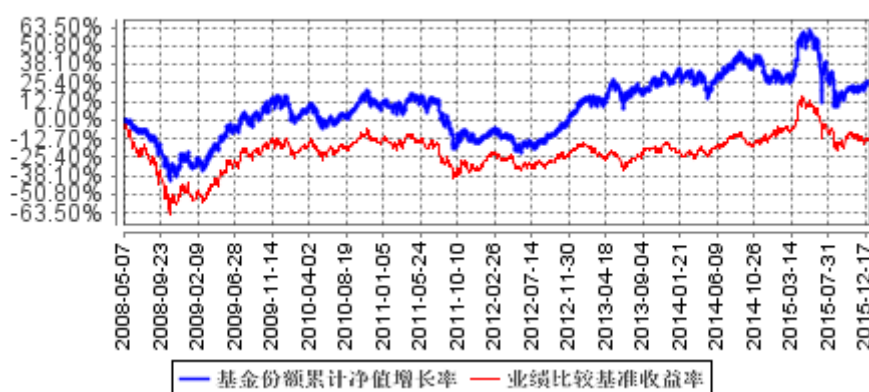
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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 12 月 31 日)

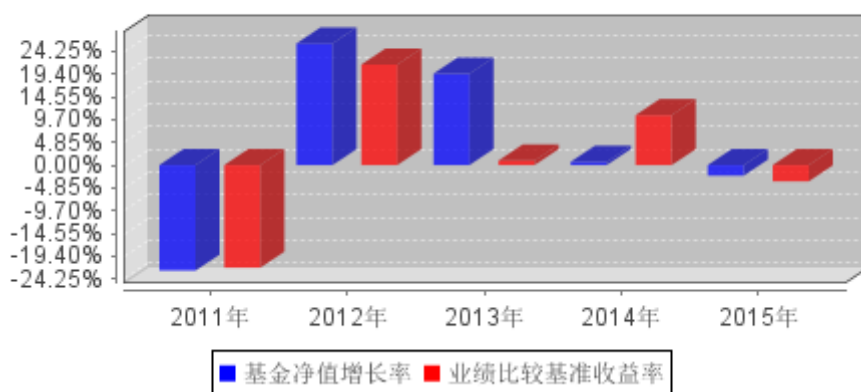
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 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 12

月 31 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、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、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业中国互联网和华宝兴业转型升级基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 182,703,481,955.16 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、华宝中国互联股票基金经理、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混合型证券投资基金基金经理、2015 年 9 月兼任华宝兴业中国互联网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混合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混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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，海外中国成长混合型证券投资基金在短期内出现过股票资产占基金资产净值比低于 60%、持有股票占基金资产净值超过 95%、持有单个股票占基金资产净值比超过 10%及持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于 5%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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，

由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2015 年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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，分析了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；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

4.3.3 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 年港股市场在 A 股市场波动、人民币汇率贬值、美国加息预期加剧、新兴市场资金外流、原油价格暴跌等多重因素影响下跌宕起伏，前涨后跌。恒生指数下跌 7.2%，恒生国企指数大跌 19.4%，MSCI China Free 指数下跌 3.5%。上半年港股市场在 A 股市场强劲表现带动下大幅上涨。中国央行 2015 年实行偏宽松的货币政策，多次降息和降低存款准备金率，释放流动性，推动了市场情绪上升，A 股市场上半年大幅上涨。港股相对 A 股的显著估值折扣引导大量大陆资金投资港股，推动港股市场显著攀升。7 月上旬，监管机构清理 A 股场外配资行为引起处于估值高位的 A 股市场的一轮剧烈的去杠杆过程，资金踩踏抛售以及 A 股涨跌停板制度触发的流动性枯竭加剧了市场的恐慌情绪，A 股股灾引起港股暴跌。8 月中国改革人民币兑美元汇率中间价定价机制，同时人民币汇率三天内下跌 3%，市场预期后续人民币还有较大贬值空间进而抛售香港中资公司股票。国际市场原油和其他大宗商品价格暴跌引发投资者风险偏好下降，资金从新兴市场持续流出，对港股构成压力。四季度由于人民币对美元汇率逐渐稳定，同时中国推出降低汽车购置税和居民首套住房首付比例下调等政策，一度缓解了市场对于中国经济下行的担忧，港股有所反弹。

全年增长最为强劲的是以腾讯控股为代表的盈利增速较为确定的信息科技股，上涨 19.3%。由于国际原油价格暴跌，国内工业生产需求疲弱，能源和原材料板块跌幅最大，分别下跌 32.4% 和 21.0%。必需消费、公用事业、金融分别下跌 16.9%、14.9% 和 12.6%。对宏观经济波动不太敏感的医疗保健板块较为抗跌，下跌 4.2%。可选消费、电信服务和工业板块分别下跌 5.0%、5.4% 和 8.6%。本基金在上半年增持了估值较低的环保、地产和保险类股，因此在其后的市场大幅调整中下跌压力相对较小，三季度增持了部分我们判断超跌的互联网、电子商务类股，四季度增持持有了大盘地产、可选消费类、汽车以及受益于行业整合的在线旅游类股。由于全年我们低配能源、原材料、必需消费等板块，同时三季度市场超跌时我们增持了部分优质个股，投资组合跑赢了业绩基准。

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-2.25%，而同期业绩比较基准收益率为

-3.47%，跑赢业绩基准 1.22%。

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 2016 年，我们判断港股市场将呈现波动加大，震荡上行格局。美国联邦储备银行于 2015 年 12 月宣布加息 25 个基点，标志美国正式脱离零利率而迈入加息周期，同时对 2016 年的加息前景美联储也表态将视经济数据情况而定。2 月份公布的美国服务业采购经理人指数、非农就业人数等主要经济数据显露疲态，显示美国 2016 年经济增长的基础并不稳固，因此我们判断美国 2016 年继续加息的节奏是循序渐进的，这将有助于投资者情绪改善，并带动港股市场估值修复。在美国经济复苏趋势持续，美元保持强势的同时，中国仍然面临制造业产能过剩、通缩压力增大、企业部门去杠杆、经济增长的内生动力不足的形势，因此人民币兑美元仍然有一定的贬值压力，不过由于中国人民银行拥有巨额外汇储备，同时中国受益于原油等国际大宗商品价格大幅下跌而享有经常账户贸易盈余，因此我们判断人民币兑美元在 2016 年贬值空间有限。由于除美国之外的世界其他主要经济体经济增长情况仍然不佳，人民币对一篮子货币的有效汇率可能基本保持稳定。2016 年人民币对美元的贬值压力可能短期压制港股的市场表现，其后待人民币汇率找到新的平衡点之后港股即有望在估值修复的基础上开始反弹。

国际原油市场目前供过于求的市场格局仍在持续，如果产油国之间的利益博弈使得各方不能达成限制产量的协议，则原油价格可能进一步下跌并引发包括港股在内的风险资产价格波动下跌。不过我们认为目前延续一年多的原油价格持续大幅下跌已经对所有产油国造成巨大利益损失，各方加强政策协调的动力有可能上升并在 2016 年努力稳定原油价格。中国近期可能继续出台消化过剩产能、提高基建投资、稳定房地产投资、推进房地产去库存、促进新型城镇化等一系列政策，同时推进各方面的改革措施，提高经济运行效率和企业活力。我们将密切关注中国信贷资金增长和周期品价格的变化趋势，注意规避由国内外宏观因素引发的市场系统性风险并以此确定资产配置策略，同时注重自下而上挖掘盈利增速强劲或稳定而估值合理的个股，利用市场波动择机增持，主要挖掘 TMT、消费、环保类个股机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级

公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2015 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，不断加强了对防控内幕交易等行为的稽核力度；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.9 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20982 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金 全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金(原华宝兴业海外中国长股票型证券投资基金，以下简称“华宝兴业海外中国成长基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华宝兴业海外中国成长基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述华宝兴业海外中国成长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华宝兴业海外中国成长基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	张勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体： 华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	52,045,228.77	6,484,408.54
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	173,285,276.80	62,603,693.14
其中：股票投资		173,285,276.80	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		184,375.97	679,457.56
应收利息	7.4.7.5	739.20	569.75
应收股利		-	-
应收申购款		321,901.08	23,587.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		225,837,521.82	69,791,716.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		469,757.14	698,181.39
应付管理人报酬		336,694.83	109,498.90
应付托管费		65,468.42	21,291.48
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	151,227.46	397,069.85
负债合计		1,023,147.85	1,226,041.62
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	178,242,021.71	53,164,071.61
未分配利润	7.4.7.10	46,572,352.26	15,401,602.94
所有者权益合计		224,814,373.97	68,565,674.55
负债和所有者权益总计		225,837,521.82	69,791,716.17

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.261 元，基金份额总额 178,242,021.71 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		-49,058,851.48	3,626,406.11
1. 利息收入		84,803.55	18,746.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	84,803.55	18,746.19
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）		-28,817,080.97	7,720,997.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-32,147,151.61	6,774,251.73
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	3,330,070.64	946,745.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-19,920,105.36	-4,282,458.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-782,808.56	134,780.04
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	376,339.86	34,341.02

减：二、费用		5,803,044.12	2,606,566.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,499,141.94	1,502,251.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	680,388.73	292,104.33
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,462,460.84	517,171.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	161,052.61	295,039.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-54,861,895.60	1,019,840.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-54,861,895.60	1,019,840.03

7.3 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混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	-	-54,861,895.60	-54,861,895.60
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）	125,077,950.10	86,032,644.92	211,110,595.02
其中：1. 基金申购款	362,730,777.06	163,747,355.50	526,478,132.56
2. 基金赎回款	-237,652,826.96	-77,714,710.58	-315,367,537.54
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）	178,242,021.71	46,572,352.26	224,814,373.97
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	-	1,019,840.03	1,019,840.03
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）	-15,351,807.67	-4,863,299.29	-20,215,106.96
其中：1. 基金申购款	13,853,125.97	4,846,921.09	18,700,047.06
2. 基金赎回款	-29,204,933.64	-9,710,220.38	-38,915,154.02
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）	53,164,071.61	15,401,602.94	68,565,674.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金(原名为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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金。

根据《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混合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。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)。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2016 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额，确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》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，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	52,045,228.77	6,484,408.54
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	52,045,228.77	6,484,408.54

注：

于 2015 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 3,304,894.74 元，港元活期存款 58,163,667.84 元(折合人民币 48,729,769.53 元)和美元活期存款 1,626.91 元(折合人民币 10,564.50 元)。

于 2014 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 2,000,955.57 元，港元活期存款 5,680,184.80 元(折合人民币 4,481,574.14 元)和美元活期存款 307.05 元(折合人民币 1,878.83 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		190,375,326.73	173,285,276.80	-17,090,049.93
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		190,375,326.73	173,285,276.80	-17,090,049.93
项目		上年度末 2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		59,773,637.71	62,603,693.14	2,830,055.43

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	59,773,637.71	62,603,693.14	2,830,055.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	739.20	569.75
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	739.20	569.75

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末及上年度末应付交易费用无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,227.46	2,069.85
预提费用	150,000.00	395,000.00
合计	151,227.46	397,069.85

7.4.7.9 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 12 月 31 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	362,730,777.06	362,730,777.06
本期赎回（以“-”号填列）	-237,652,826.96	-237,652,826.96
本期末	178,242,021.71	178,242,021.71

7.4.7.10 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	-34,941,790.24	-19,920,105.36	-54,861,895.60
本期基金份额交易产生的变动数	20,337,093.28	65,695,551.64	86,032,644.92
其中：基金申购款	59,465,248.50	104,282,107.00	163,747,355.50
基金赎回款	-39,128,155.22	-38,586,555.36	-77,714,710.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,634,177.13	49,206,529.39	46,572,352.26

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	78,493.64	18,711.49
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	6,309.91	34.70
合计	84,803.55	18,746.19

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	346,821,208.77	133,282,073.06
减：卖出股票成本总额	378,968,360.38	126,507,821.33
买卖股票差价收入	-32,147,151.61	6,774,251.73

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,330,070.64	946,745.92
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,330,070.64	946,745.92

7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-19,920,105.36	-4,282,458.79
——股票投资	-19,920,105.36	-4,282,458.79
——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	-19,920,105.36	-4,282,458.79

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	376,339.86	34,341.02
合计	376,339.86	34,341.02

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。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,462,460.84	517,171.29
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,462,460.84	517,171.29

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
----	---	--

审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	90,000.00	210,000.00
银行汇划费	155.00	494.00
其他	10,897.61	24,545.40
合计	161,052.61	295,039.40

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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（“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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	3,499,141.94	1,502,251.06
其中：支付销售机构的客户维护费	291,481.02	167,522.27

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×1.8% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	680,388.73	292,104.33

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× 0.35% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

该基金没有销售服务费用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期末均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	971,576.25	-
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	1,447,222.63	475,646.38
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.81%	0.89%

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。

7.4.10.4.2 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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	3,335,907.16	78,493.64	2,003,404.74	18,711.49
纽约梅隆银行	48,709,321.61	-	4,481,003.80	-

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保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。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。

7.4.13.2 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，因而与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，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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 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 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	52,045,228.77	-	-	-	52,045,228.77
交易性金融资产	-	-	-	173,285,276.80	173,285,276.80
应收证券清算款	-	-	-	184,375.97	184,375.97
应收利息	-	-	-	739.20	739.20
应收申购款	199,700.45	-	-	122,200.63	321,901.08
资产总计	52,244,929.22	-	-	173,592,592.60	225,837,521.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	469,757.14	469,757.14
应付管理人报酬	-	-	-	336,694.83	336,694.83
应付托管费	-	-	-	65,468.42	65,468.42
其他负债	-	-	-	151,227.46	151,227.46
负债总计	-	-	-	1,023,147.85	1,023,147.85
利率敏感度缺口	52,244,929.22	-	-	172,569,444.75	224,814,373.97
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015 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	10,564.50	48,729,769.53	-	48,740,334.03
交易性金融资产	36,638,250.18	136,647,026.62	-	173,285,276.80
应收利息	-	0.09	-	0.09
应收证券清算款	-	184,375.97	-	184,375.97
资产合计	36,648,814.68	185,561,172.21	-	222,209,986.89
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	36,648,814.68	185,561,172.21	-	222,209,986.89
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

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	11,110,499.34	3,388,330.21
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-11,110,499.34	-3,388,330.21

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	173,285,276.80	77.08	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	173,285,276.80	77.08	62,603,693.14	91.30

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)	上年度末(2014 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	12,016,070.88	2,496,016.82
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-12,016,070.88	-2,496,016.82

7.4.14 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 12 月 31 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 173,285,276.80 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 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	173,285,276.80	76.73
	其中：普通股	141,697,644.82	62.74
	存托凭证	31,587,631.98	13.99
	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	52,045,228.77	23.05
8	其他各项资产	507,016.25	0.22
9	合计	225,837,521.82	100.00

8.2 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	136,647,026.62	60.78
美国	36,638,250.18	16.30
合计	173,285,276.80	77.08

8.3 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	2,077,754.60	0.92
材料	0.00	0.00
工业	48,240,533.86	21.46
非必需消费品	36,839,850.67	16.39
必需消费品	0.00	0.00
保健	2,256,709.59	1.00
金融	45,935,756.10	20.43
信息技术	19,134,494.88	8.51
电信服务	0.00	0.00
公用事业	18,800,177.10	8.36
合计	173,285,276.80	77.08

8.4 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)	公司名	证券代	所在	所属国	数量(股)	公允价值	占基金资
----	---------	-----	-----	----	-----	-------	------	------

	文)	称(中 文)	码	证券 市场	家(地 区)			产净值比 例(%)
1	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	绿色动 力环保	1330 HK	香港	CH	3,531,000	14,998,514.55	6.67
2	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中 国	1918 HK	香港	CH	2,975,000	14,954,806.30	6.65
3	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香 港	337 HK	香港	CH	3,950,000	9,994,167.19	4.45
4	BOER POWER HOLDINGS LTD	博耳电 力	1685 HK	香港	CH	827,000	9,672,383.32	4.30
5	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	东江环 保	895 HK	香港	CH	609,700	6,712,033.76	2.99
6	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	万达商 业	3699 HK	香港	CH	173,800	6,588,869.83	2.93
7	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水 务集团	371 HK	香港	CH	1,412,000	6,423,579.42	2.86
8	COGOBUY GROUP	科通芯 城	400 HK	香港	CH	706,000	6,127,834.51	2.73
9	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	香港	CH	1,072,000	5,415,700.88	2.41
10	JD.COM INC-ADR	京东	JD US	纳斯达 克	AE	25,100	5,258,851.72	2.34
11	YY INC-ADR	欢聚时 代	YY US	纳斯达 克	AE	12,800	5,192,386.47	2.31
12	SOHU.COM INC	搜狐公 司	SOHU US	纳斯达 克	AE	13,600	5,050,618.20	2.25
13	21VIANET GROUP INC-ADR	北京世 纪互联 宽带数 据中心 有限	VNET US	纳斯达 克	AE	36,193	4,968,383.38	2.21
14	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽 人	2298 HK	香港	CH	886,000	4,817,491.87	2.14
15	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	4,644,435.02	2.07
16	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科 技	2208 HK	香港	CH	371,200	4,633,794.90	2.06
17	BONA FILM GROUP	博纳影	BONA US	纳斯达	AE	53,213	4,571,546.30	2.03

	LTD-SPON ADR	业集团 有限公司		克				
18	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控 股集团	884 HK	香港	CH	2,500,000	3,623,503.49	1.61
19	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	奇虎 360 科技有 限公司	QIHU US	纽约	AE	7,600	3,593,272.53	1.60
20	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建 筑国际	3311 HK	香港	CH	278,000	3,134,963.06	1.39
21	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	康达环 保	6136 HK	香港	CH	1,955,000	3,079,265.83	1.37
22	BAOXIN AUTO GROUP LTD	宝信汽 车	1293 HK	香港	CH	727,000	2,954,055.98	1.31
23	AIRMEDIA GROUP INC-ADR	航美传 媒	AMCN US	纳斯达 克	AE	77,000	2,795,040.26	1.24
24	TUNIU CORP-SPON ADR	南京途 牛科技 有限公司	TOUR US	纳斯达 克	AE	25,000	2,594,193.21	1.15
25	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航 空	1055 HK	香港	CH	486,000	2,434,893.81	1.08
26	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华润燃 气	1193 HK	香港	CH	120,000	2,327,420.27	1.04
27	500.COM LTD-CLASS A-ADR	500 彩票 网	WBAI US	纽约	AE	17,500	2,284,123.81	1.02
28	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	中国动 物保健 品	940 HK	香港	CH	518,000	2,256,709.59	1.00
29	CAR INC	神州租 车	699 HK	香港	CH	195,000	2,097,694.34	0.93
30	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	新天绿 色能源	956 HK	香港	CH	2,000,000	2,077,754.60	0.92
31	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国 际	902 HK	香港	CH	360,000	2,017,767.81	0.90
32	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	中国宏 泰发展	6166 HK	香港	CH	741,000	1,986,601.50	0.88
33	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	中海发 展	1138 HK	香港	CH	410,000	1,769,023.73	0.79
34	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福 新	816 HK	香港	CH	918,000	1,707,411.60	0.76

35	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	1071 HK	香港	CH	400,000	1,692,364.63	0.75
36	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	中国光大国际	257 HK	香港	CH	198,000	1,652,217.05	0.73
37	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	1813 HK	香港	CH	317,000	1,527,107.74	0.68
38	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	688 HK	香港	CH	62,000	1,412,873.13	0.63
39	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	香港	CH	320,000	1,117,966.02	0.50
40	SOUND GLOBAL LTD	桑德国际	967 HK	香港	CH	182,000	1,067,362.65	0.47
41	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	香港	CH	89,800	713,226.13	0.32
42	HOLLY FUTURES CO LTD-H	弘业期货	3678 HK	香港	CH	294,000	490,165.77	0.22
43	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	新奥能源	2688 HK	香港	CH	14,000	485,004.89	0.22
44	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团 控股有限公司	BABA US	纽约	AE	625	329,834.30	0.15
45	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	香港	CH	1,000	17,049.32	0.01
46	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	27 HK	香港	CH	700	14,339.02	0.01
47	SANDS CHINA LTD	金沙中国有限公司	1928 HK	香港	CH	300	6,673.11	0.00

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	31,079,904.61	45.33

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	19,919,646.36	29.05
7	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	18,117,960.55	26.42
8	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	15,958,552.85	23.27
9	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3328 HK	15,905,187.25	23.20
10	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	14,270,442.08	20.81
11	CAR INC	699 HK	12,548,546.24	18.30
12	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	12,546,211.50	18.30
13	YY INC-ADR	YY US	12,502,269.72	18.23
14	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	11,812,908.90	17.23
15	BOER POWER HOLDINGS LTD	1685 HK	11,624,049.75	16.95
16	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	10,791,081.10	15.74
17	TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	TEDU US	10,370,372.34	15.12
18	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	10,086,086.03	14.71
19	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	2298 HK	9,483,243.35	13.83
20	TUNIU CORP-SPON ADR	TOUR US	8,154,110.50	11.89
21	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	8,107,161.73	11.82
22	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	7,957,101.07	11.61
23	CTrip.COM	CTRP US	7,341,973.94	10.71

	INTERNATIONAL-ADR			
24	E-COMMERCE CHINA-SPON ADR -A	DANG US	7, 110, 172. 64	10. 37
25	XUNLEI LTD-ADR	XNET US	6, 968, 833. 99	10. 16
26	PHOENIX NEW MEDIA LTD -ADR	FENG US	6, 893, 606. 46	10. 05
27	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	6136 HK	6, 773, 441. 66	9. 88
28	YOUKU TUDOU INC-ADR	YOKU US	6, 620, 261. 18	9. 66
29	BONA FILM GROUP LTD-SPON ADR	BONA US	6, 413, 891. 58	9. 35
30	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	QIHU US	6, 264, 220. 28	9. 14
31	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	NOAH US	6, 186, 909. 56	9. 02
32	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	6, 177, 689. 83	9. 01
33	CHINA MOBILE GAMES-ADR	CMGE US	6, 153, 076. 19	8. 97
34	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	5, 958, 552. 61	8. 69
35	COGOBUY GROUP	400 HK	5, 775, 699. 19	8. 42
36	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	5, 142, 292. 22	7. 50
37	CHINA EVERBRIGHT LTD	165 HK	4, 935, 378. 59	7. 20
38	21VIANET GROUP INC-ADR	VNET US	4, 595, 513. 67	6. 70
39	SOHU. COM INC	SOHU US	4, 542, 197. 45	6. 62
40	JD. COM INC-ADR	JD US	4, 387, 832. 64	6. 40
41	NETEASE INC-ADR	NTES US	3, 914, 548. 29	5. 71
42	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	3, 644, 447. 70	5. 32
43	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	3898 HK	3, 630, 950. 80	5. 30
44	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	3, 579, 566. 04	5. 22
45	NQ MOBILE INC - ADR -CLASS A	NQ US	3, 550, 613. 59	5. 18
46	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	2, 965, 025. 21	4. 32

47	CHINA MERCHANTS LAND LTD	978 HK	2,938,177.92	4.29
48	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	2,473,848.77	3.61
49	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	2,432,507.46	3.55
50	JUMEI INTERNATIONAL-ADR	JMEI US	2,410,346.11	3.52
51	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	2,373,024.17	3.46
52	AIRMEDIA GROUP INC-ADR	AMCN US	2,353,493.06	3.43
53	500.COM LTD-CLASS A-ADR	WBAI US	2,278,937.61	3.32
54	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	6166 HK	2,255,817.03	3.29
55	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	2,252,729.45	3.29
56	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	2,251,993.75	3.28
57	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	956 HK	2,218,900.23	3.24
58	CHINACACHE INTERNAT-SPON ADR	CCIH US	2,137,848.63	3.12
59	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	1138 HK	1,999,686.87	2.92
60	BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	1,961,413.02	2.86
61	HUADIAN POWER INTL CORP-H	1071 HK	1,837,120.83	2.68
62	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	SFUN US	1,755,702.30	2.56
63	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	QUNR US	1,639,556.58	2.39
64	SOUND GLOBAL LTD	967 HK	1,522,095.23	2.22
65	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	816 HK	1,507,919.58	2.20
66	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	1,394,502.78	2.03
67	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。

8.5.2 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	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	23,325,280.01	34.02
2	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	21,375,877.93	31.18
3	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	20,430,378.64	29.80
4	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3328 HK	17,029,977.57	24.84
5	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	15,608,521.67	22.76
6	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	12,484,982.80	18.21
7	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	12,446,996.32	18.15
8	TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	TEDU US	12,021,342.04	17.53
9	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	9,610,350.91	14.02
10	CTRP.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP US	8,979,047.59	13.10
11	CAR INC	699 HK	8,841,913.36	12.90
12	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	8,839,488.88	12.89
13	YY INC-ADR	YY US	7,850,207.05	11.45
14	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	7,769,447.70	11.33
15	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	7,171,410.01	10.46
16	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	337 HK	6,627,483.32	9.67
17	CHINA MOBILE GAMES-ADR	CMGE US	6,302,523.56	9.19
18	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	6,108,894.70	8.91
19	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	NOAH US	6,053,883.07	8.83

20	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	5,497,665.56	8.02
21	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	5,277,597.57	7.70
22	PHOENIX NEW MEDIA LTD -ADR	FENG US	5,200,933.15	7.59
23	XUNLEI LTD-ADR	XNET US	5,098,709.47	7.44
24	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	5,033,508.47	7.34
25	YOUKU TUDOU INC-ADR	YOKU US	4,870,183.56	7.10
26	CHINA EVERBRIGHT LTD	165 HK	4,869,669.82	7.10
27	TUNIU CORP-SPON ADR	TOUR US	4,705,522.83	6.86
28	E-COMMERCE CHINA-SPON ADR -A	DANG US	4,637,418.59	6.76
29	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	2298 HK	4,385,100.63	6.40
30	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	4,295,258.69	6.26
31	BONA FILM GROUP LTD-SPON ADR	BONA US	4,026,723.93	5.87
32	DAWN RAYS PHARMACEUTICAL HOLD	2348 HK	3,900,164.63	5.69
33	NETEASE INC-ADR	NTES US	3,898,192.52	5.69
34	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	3898 HK	3,854,403.24	5.62
35	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	QIHU US	3,773,908.53	5.50
36	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	1330 HK	3,717,493.79	5.42
37	CHINA MERCHANTS LAND LTD	978 HK	3,624,831.06	5.29
38	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	3,619,717.75	5.28
39	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	3,427,692.83	5.00
40	BOER POWER HOLDINGS LTD	1685 HK	3,141,845.03	4.58
41	SIHUAN PHARMACEUTICAL	460 HK	2,665,096.62	3.89

	HLDGS			
42	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	182 HK	2,493,819.85	3.64
43	NQ MOBILE INC – ADR –CLASS A	NQ US	2,318,018.11	3.38
44	BAIDU INC – SPON ADR	BIDU US	2,290,348.65	3.34
45	JUMEI INTERNATIONAL-ADR	JMEI US	1,985,335.74	2.90
46	JINKOSOLAR HOLDING CO-ADR	JKS US	1,920,320.76	2.80
47	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	QUNR US	1,857,808.27	2.71
48	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	1,850,546.51	2.70
49	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	1,791,519.28	2.61
50	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	SFUN US	1,690,802.74	2.47
51	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	1,672,708.12	2.44
52	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	1,579,079.44	2.30
53	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	3377 HK	1,538,242.50	2.24
54	CHINACACHE INTERNAT-SPON ADR	CCIH US	1,381,270.32	2.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.5.3 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	509,570,049.4
卖出收入（成交）总额	346,821,208.77

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	184,375.97
3	应收股利	-
4	应收利息	739.20
5	应收申购款	321,901.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	507,016.25

8.11.4 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。

8.11.5 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的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
3,164	56,334.39	88,427,437.53	49.61%	89,814,584.18	50.39%

9.2 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	3,201,619.92	1.7962%

9.3 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	>100

§ 10 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	362,730,777.06
减：本报告期基金总赎回份额	237,652,826.96
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	178,242,021.71

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内，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

基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 60,000.00 元人民币。目前该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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	487,765,322.90	56.96%	210,558.67	26.98%	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	-	115,424,763.59	13.48%	230,849.57	29.58%	-
申万	-	98,665,499.13	11.52%	197,331.12	25.29%	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	86,726,373.29	10.13%	34,690.53	4.45%	-
BOCI Securities Ltd	-	43,695,714.67	5.10%	65,543.60	8.40%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	21,137,480.52	2.47%	35,498.68	4.55%	-
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	2,976,104.15	0.35%	5,952.20	0.76%	-

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：资质雄厚，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。

11.7.2 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。

11.8 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	关于华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金 2016 年开放日的提示性公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 12 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平安证券有限责任公司申购及定投费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 10 月 20 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 9 月 29 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增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 9 月 1 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上海浦东发展银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 8 月 3 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增加申万宏源西部证券有限公司为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 8 月 3 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增加中信期货有限公司为代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 7 月 27 日
8	华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金基金合同	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 7 月 22 日
9	华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金托管协议	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 7 月 22 日
10	华宝兴业基金管理有限公司关于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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 7 月 22 日
11	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费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 7 月 14 日

	告		
12	华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金资产净值公告	华宝兴业基金官方网站	2015 年 7 月 2 日
13	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	华宝兴业基金官方网站	2015 年 7 月 1 日
14	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日
15	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 5 月 30 日
16	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 4 月 14 日
17	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 4 月 10 日
18	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 4 月 9 日
19	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 3 月 3 日
20	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 3 月 2 日
21	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	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2015 年 2 月 14 日
22	华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金资产净值公告	华宝兴业基金官方网站	2015 年 1 月 5 日

§ 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混合型证券投资基金基金合同；

华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金招募说明书；

华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

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
2016 年 3 月 28 日