

华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 26 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 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 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遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	34
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	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	36
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	38
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	38
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	38
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	38
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	38
7.11 投资组合报告附注	38

§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	44

§ 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	97,167,325.88 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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真	021-38505777	010-66275853
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区	北京市西城区金融大街 25 号

	区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	
办公地址	中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 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

§ 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(2016 年 1 月 1 日 – 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-19, 630, 395. 21
本期利润	-19, 729, 170. 50

加权平均基金份额本期利润	-0. 1530
本期加权平均净值利润率	-13. 55%
本期基金份额净值增长率	-6. 34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-20, 835, 727. 45
期末可供分配基金份额利润	-0. 2144
期末基金资产净值	114, 795, 922. 92
期末基金份额净值	1. 181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	18. 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
过去一个月	-0. 08%	1. 43%	1. 98%	1. 33%	-2. 06%	0. 10%
过去三个月	1. 81%	1. 14%	2. 91%	1. 16%	-1. 10%	-0. 02%
过去六个月	-6. 34%	1. 37%	-2. 37%	1. 45%	-3. 97%	-0. 08%
过去一年	-18. 50%	1. 90%	-17. 78%	1. 65%	-0. 72%	0. 25%
过去三年	0. 85%	1. 48%	20. 13%	1. 34%	-19. 28%	0. 14%
自基金合同生效日起至今	18. 10%	1. 46%	-15. 41%	1. 82%	33. 51%	-0. 36%

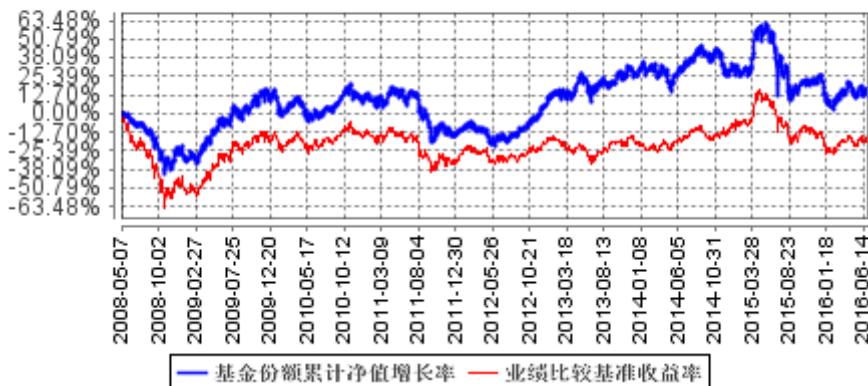
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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 2016 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 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（2016 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、新兴产业基金、可转债债券、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接、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、华宝兴业核心优势、华宝兴业转型升级、华宝标普美国消费、华宝宝鑫纯债及华宝香港中小，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 157,478,315,809.98 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）	证券从业年	说明
----	----	--------------	-------	----

		理) 期限		限	
		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	-	17 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	-	11 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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超过 95%、单只股票投资超过基金资产净值 10% 及现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值低于 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，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 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 股市场波动、人民币贬值预期、美国加息预期起伏和国际市场波动影响下先跌后升，震荡下行。恒生指数下跌 5.1%，恒生国企指数下跌 9.8%，MSCI China Free 指数下跌 2.4%。年初 A 股市场波动两次触发向下熔断机制，引发国际市场对中国经济基本面恶化的担忧并带动港股下跌。人民币对美元汇率连续几个交易日显著下行，重新引发市场对于人民币贬值的担忧。国际原油价格跌破每桶 30 美元，带来投资者对风险资产的偏好下降，也对港股和海外中概股带来抛压。四月份由于美联储对于货币政策的表态偏于鸽派，并且下调了美国今年的经济增速预测，市场预期今年美国加息将延后，美元一度走软，人民币兑美元贬值预期减弱。同时国际原油价格由于主要产油国政策协调改善而显著上涨，投资者风险偏好上升，带动港股市场上涨。五月份人民日报发表权威人士解读中国一季度经济走势时强调中国经济走势是 L 型，并将持续相当长时间，另外中国信用债券违约事件上升，引发市场对于中国银行业坏账和金融系统性风险的

担忧，压制了港股中中资银行和保险板块的表现。6 月下旬英国公投脱离欧盟，这是欧洲经济政治一体化进程的重大挫折，影响深远，一度导致英镑、欧元、欧洲股票市场暴跌，也带动港股下跌。

上半年下跌最为剧烈的是与宏观经济关系密切的可选消费、金融和工业类股，分别下跌 17.1%、13.0% 和 12.7%。由于工业生产仍然不振，公用事业中的火力发电类股受发电利用小时下降的拖累，盈利增速将显著放缓，公用事业下跌 11.1%。此外医疗保健和必需消费板块分别下跌 8.2% 和 6.9%。表现最好的是受益于原油价格反弹和煤炭产业去产能的能源板块，上涨 14.1%。科技板块由于盈利仍然平稳而表现坚挺，小涨 2.8%。原材料板块小涨 2.1%，电信服务板块小跌 0.1%。本基金鉴于较为动荡的国内外因素，在上半年大部分时间保持较为谨慎的总体仓位。我们增持了盈利前景较确定的电子商务类股、受益于限电改善的风力发电类股、以及市场环境改善的互联网类股，减持了中小市值地产股以及缺乏业绩催化剂的可选消费类股。

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-6.34%，而同期业绩比较基准收益率为-2.37%，跑输业绩基准 3.97%。业绩差异主要由于投资组合低配了表现较好的能源、原材料等板块。

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 年下半年，我们认为下半年市场的系统性风险相比上半年有所下降，港股和海外中国概念股市场有望震荡上行。首先，英国公投退欧之后，英国和欧元区股票市场经历初期的下跌之后转而上行，总体下跌幅度有限，显示英国退出欧盟所带来的冲击处于可控范围，短期内尚不至于引发其他国家退出欧盟。其次，英国公投脱欧导致美元对其他主要货币汇率上涨，为避免对国际金融市场造成进一步冲击，美联储可能将加息时间点推迟到四季度或者明年，使得新兴市场资本外流压力减缓，投资者风险偏好上升。另外，中国经济在上半年取得 6.7% 的 GDP 增速，同时人民币对美元汇率仅小幅下跌，显示中国经济硬着陆的风险下降，上半年基建投资加码和房地产销售转暖起到稳定固定资产投资和经济增速的作用。但是，我们也必须警惕部分欧洲银行脆弱的资产质量会引发银行业危机并对全球金融市场造成冲击。另外中国部分一二线城市房地产销售畅旺在地价高企的环境下并未带动房地产投资全面上升，因此对于中国经济复苏的支持的可持续性或将有限。我们下半年将继续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、教育、消费、环保类个股机会。

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

本基金本报告期内未进行利润分配，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的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,100,177.29	52,045,228.77
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	102,744,000.74	173,285,276.80
其中：股票投资		102,744,000.74	173,285,276.80
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		985,900.84	184,375.97
应收利息	6.4.7.5	655.25	739.20
应收股利		706,260.60	—
应收申购款		48,216.90	321,901.08
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		115,585,211.62	225,837,521.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		—	—

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		362, 244. 28	469, 757. 14
应付管理人报酬		166, 944. 44	336, 694. 83
应付托管费		32, 461. 41	65, 468. 42
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	227, 638. 57	151, 227. 46
负债合计		789, 288. 70	1, 023, 147. 85
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	97, 167, 325. 88	178, 242, 021. 71
未分配利润	6.4.7.10	17, 628, 597. 04	46, 572, 352. 26
所有者权益合计		114, 795, 922. 92	224, 814, 373. 97
负债和所有者权益总计		115, 585, 211. 62	225, 837, 521. 82

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.181 元，基金份额总额 97, 167, 325. 88 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-17, 754, 673. 11	-6, 513, 336. 80
1.利息收入		18, 511. 13	35, 732. 60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18, 511. 13	35, 732. 60
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）		-18, 303, 348. 62	7, 254, 691. 10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-19, 201, 094. 02	4, 475, 468. 51
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	6.4.7.14.5	-	-
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	897,745.40	2,779,222.59
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-98,775.29	-10,519,041.05
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		497,162.42	-3,477,098.62
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	131,777.25	192,379.17
减: 二、费用		1,974,497.39	2,909,934.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,314,645.29	1,616,836.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	255,625.45	314,384.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	249,879.82	899,823.88
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	154,346.83	78,888.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-19,729,170.50	-9,423,271.02
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-19,729,170.50	-9,423,271.02

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混合型证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	178,242,021.71	46,572,352.26	224,814,373.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-19,729,170.50	-19,729,170.50
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)	-81,074,695.83	-9,214,584.72	-90,289,280.55
其中: 1.基金申购款	13,398,854.75	2,430,717.74	15,829,572.49

2. 基金赎回款	-94,473,550.58	-11,645,302.46	-106,118,853.04
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）	97,167,325.88	17,628,597.04	114,795,922.92
项目	上年度可比期间 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

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：

黄小蕙

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业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)。

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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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[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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	11,100,177.29
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	11,100,177.29

于 2016 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 1,986,175.04 元，港元活期存款 10,649,663.90 元(折合人民币 9,102,218.41 元)和美元活期存款 1,777.03 元(折合人民币 11,783.84 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 6 月 30 日	成本	公允价值
股票	119,932,825.96	102,744,000.74	-17,188,825.22
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	119,932,825.96	102,744,000.74	-17,188,825.22

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	
	2016 年 6 月 30 日	
应收活期存款利息		655.25
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	655.25

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

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	
	2016 年 6 月 30 日	
应付券商交易单元保证金		
应付赎回费		1,309.73
预提费用		226,328.84
合计		227,638.57

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	账面金额
上年度末	178,242,021.71	178,242,021.71
本期申购	13,398,854.75	13,398,854.75
本期赎回(以"-"号填列)	-94,473,550.58	-94,473,550.58
本期末	97,167,325.88	97,167,325.88

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	-2,634,177.13	49,206,529.39	46,572,352.26
本期利润	-19,630,395.21	-98,775.29	-19,729,170.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,428,844.89	-10,643,429.61	-9,214,584.72
其中：基金申购款	-1,682,170.53	4,112,888.27	2,430,717.74
基金赎回款	3,111,015.42	-14,756,317.88	-11,645,302.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,835,727.45	38,464,324.49	17,628,597.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	18,244.01
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	267.12
合计	18,511.13

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	107,909,115.38
减：卖出股票成本总额	127,110,209.40
买卖股票差价收入	-19,201,094.02

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	897,745.40
基金投资产生的股利收益	—
合计	897,745.40

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-98,775.29
——股票投资	-98,775.29
——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	-98,775.29

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	130,802.29
其他	974.96
合计	131,777.25

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	249,879.82
银行间市场交易费用	-
合计	249,879.82

6.4.7.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	106,493.58
银行汇划费	210.00
其他	17,807.99
合计	154,346.83

6.4.7.22 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
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 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,314,645.29	1,616,836.60
其中：支付销售机构的客户维护费	107,886.75	159,871.61

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	255,625.45	314,384.94

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

该基金没有销售服务费用。

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

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	份额单位：份
期初持有的基金份额	1,447,222.63	475,646.38	
期间申购/买入总份额	1,146,820.76	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	2,594,043.39	1,101,103.74	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.67%	0.51%	

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

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
	2,000,106.73	18,244.01	8,913,680.86	31,449.23
中国建设银行	9,100,070.56	-	12,351,377.67	-

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（2016 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。

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面临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建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理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，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 2016 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发行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 2016 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 2016 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	11,100,177.29	-	-	-	11,100,177.29
交易性金融资产	-	-	-	102,744,000.74	102,744,000.74
应收证券清算款	-	-	-	985,900.84	985,900.84
应收利息	-	-	-	655.25	655.25
应收股利	-	-	-	706,260.60	706,260.60
应收申购款	497.02	-	-	47,719.88	48,216.90
资产总计	11,100,674.31	-	-	104,484,537.31	115,585,211.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	362,244.28	362,244.28
应付托管费	-	-	-	166,944.44	166,944.44
应付销售服务费	-	-	-	32,461.41	32,461.41
其他负债	-	-	-	227,638.57	227,638.57
负债总计	-	-	-	789,288.70	789,288.70
利率敏感度缺口	11,100,674.31	-	-	103,695,248.61	114,795,922.92
上年度末 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

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 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(2015 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 2016 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	11,783.84	9,102,218.41	—	9,114,002.25
交易性金融资产	20,016,924.09	82,727,076.65	—	102,744,000.74
应收股利	—	463,450.20	—	463,450.20
应收证券清算款	—	985,900.84	—	985,900.84
资产合计	20,028,707.93	93,278,646.10	—	113,307,354.03
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	20,028,707.93	93,278,646.10	—	113,307,354.03
项目	上年度末 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

6.4.13.4.2.2 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 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	5,665,367.70	11,110,499.34
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-5,665,367.70	-11,110,499.34

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	102,744,000.74	89.50	173,285,276.80	77.08
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	102,744,000.74	89.50	173,285,276.80	77.08

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 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	5,853,763.24	12,016,070.88
	2. 业绩比较基准下降 5%	-5,853,763.24	-12,016,070.88

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 2016 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 102,744,000.74 元, 无属于第二层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 173,285,276.80 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 2016 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 (2015 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	102,744,000.74	88.89
	其中: 普通股	84,722,046.65	73.30
	存托凭证	18,021,954.09	15.59
	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	11,100,177.29	9.60
8	其他各项资产	1,741,033.59	1.51
9	合计	115,585,211.62	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	82,727,076.65	72.06
美国	20,016,924.09	17.44
合计	102,744,000.74	89.50

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(%)
工业	25,029,724.79	21.80
非必需消费品	27,375,689.69	23.85
必需消费品	-	0.00
保健	2,302,207.44	2.01
金融	19,541,378.84	17.02
信息技术	7,581,647.05	6.60
电信服务	-	0.00
公用事业	20,913,352.93	18.22
合计	102,744,000.74	89.50

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	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	香港	CH	980,000	10,403,010.15	9.06
2	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港	337 HK	香港	CH	3,500,000	8,017,042.56	6.98
3	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	绿色动力环保集团股份有限公司	1330 HK	香港	CH	2,529,000	7,327,568.35	6.38
4	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水务集团	371 HK	香港	CH	1,818,000	7,240,876.60	6.31
5	DONGJIANG	东江环保	895 HK	香港	CH	609,700	6,920,311.13	6.03

	ENVIRONMENTAL-H							
6	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港	CH	1, 100, 000	6, 035, 858. 69	5. 26
7	CTRIP. COM INTERNATIONAL-ADR	Ctrip. com 国际有限公司	CTRP US	纳斯达克	AE	21, 100	5, 764, 634. 79	5. 02
8	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能源	958 HK	香港	CH	2, 390, 000	5, 249, 795. 36	4. 57
9	JD. COM INC-ADR	京东	JD US	纳斯达克	AE	35, 670	5, 021, 636. 01	4. 37
10	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港	CH	324, 000	5, 012, 275. 52	4. 37
11	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	香港	CH	120, 000	4, 764, 071. 98	4. 15
12	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约	AE	6, 645	3, 504, 435. 69	3. 05
13	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	香港	CH	800, 000	3, 282, 030. 21	2. 86
14	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	688 HK	香港	CH	150, 000	3, 141, 005. 48	2. 74
15	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	华住酒店集团有限公司	HTHT US	纳斯达克	AE	11, 100	2, 681, 478. 24	2. 34
16	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	香港	CH	278, 000	2, 428, 326. 29	2. 12
17	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	中国动物保健品	940 HK	香港	CH	518, 000	2, 302, 207. 44	2. 01
18	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港	CH	236, 000	2, 134, 071. 77	1. 86
19	SINA CORP	新浪公司	SINA US	纳斯达克	AE	5, 800	1, 994, 970. 00	1. 74
20	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园	1448 HK	香港	CH	333, 000	1, 556, 836. 16	1. 36
21	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	中国光大国际	257 HK	香港	CH	198, 000	1, 455, 375. 27	1. 27
22	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	CH	60, 000	1, 392, 298. 76	1. 21
23	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	816 HK	香港	CH	918, 000	1, 333, 837. 59	1. 16
24	KANGDA INTERNATIONAL ENVIRON	康达环保	6136 HK	香港	CH	770, 000	1, 052, 984. 69	0. 92
25	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港	CH	400, 000	1, 032, 472. 00	0. 90

26	WEIBO CORP-SPON ADR	新浪微博	WB US	纳斯达克	AE	5,000	941,961.96	0.82
27	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	香港	CH	90,000	535,381.18	0.47
28	YY INC-ADR	欢聚时代	YY US	纳斯达克	AE	480	107,807.40	0.09
29	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	香港	CH	12,400	89,025.07	0.08
30	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	27 HK	香港	CH	700	13,760.60	0.01
31	SANDS CHINA LTD	金沙中国有限公司	1928 HK	香港	CH	300	6,653.80	0.01

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	CTRI.P. COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP US	5,848,685.12	2.60
2	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	5,579,433.10	2.48
3	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	5,306,259.78	2.36
4	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	5,074,884.50	2.26
5	BYD CO LTD-H	1211 HK	3,871,384.62	1.72
6	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	3,703,605.78	1.65
7	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	3,152,745.66	1.40
8	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	2,710,545.56	1.21
9	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	HTHT US	2,530,613.05	1.13
10	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	QUNR US	2,525,952.40	1.12
11	COGOBUY GROUP	400 HK	2,042,560.75	0.91
12	SINA CORP	SINA US	2,024,850.67	0.90
13	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	1,921,497.00	0.85
14	JD. COM INC-ADR	JD US	1,885,871.00	0.84
15	BEIJING ENTERPRISES WATER	371 HK	1,446,977.22	0.64

	GR			
16	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1, 394, 862. 84	0.62
17	YY INC-ADR	YY US	1, 160, 562. 33	0.52
18	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	1, 033, 702. 77	0.46
19	BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	1, 023, 633. 19	0.46
20	WEIBO CORP-SPON ADR	WB US	865, 058. 22	0.38

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	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	10, 578, 832. 31	4.71
2	BOER POWER HOLDINGS LTD	1685 HK	6, 879, 881. 75	3.06
3	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	3699 HK	6, 648, 449. 03	2.96
4	YY INC-ADR	YY US	5, 429, 949. 53	2.42
5	21VIANET GROUP INC-ADR	VNET US	4, 700, 491. 15	2.09
6	BONA FILM GROUP LTD-SPON ADR	BONA US	4, 600, 111. 00	2.05
7	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	QIHU US	4, 463, 053. 61	1.99
8	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	2298 HK	4, 130, 432. 01	1.84
9	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	4, 110, 813. 64	1.83
10	SOHU.COM INC	SOHU US	4, 072, 132. 79	1.81
11	BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	4, 062, 362. 90	1.81
12	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	4, 034, 398. 50	1.79
13	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	3, 918, 876. 55	1.74
14	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	3, 663, 280. 88	1.63
15	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	3, 577, 564. 73	1.59
16	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	1330 HK	3, 004, 272. 94	1.34
17	AIRMEDIA GROUP INC-ADR	AMCN US	2, 777, 884. 82	1.24
18	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	QUNR US	2, 452, 482. 32	1.09
19	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	2, 241, 881. 18	1.00
20	CHINA RESOURCES GAS GROUP	1193 HK	2, 172, 878. 43	0.97

	LT		
--	----	--	--

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	56,667,708.63
卖出收入（成交）总额	107,909,115.38

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	985,900.84
3	应收股利	706,260.60

4	应收利息	655.25
5	应收申购款	48,216.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,741,033.59

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
3,419	28,419.81	11,075,896.08	11.40%	86,091,429.80	88.60%

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	3,606,626.17	3.7118%

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	>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	178,242,021.71
本报告期基金总申购份额	13,398,854.75
减: 本报告期基金总赎回份额	94,473,550.58
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	97,167,325.88

§ 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

本报告期内，管理人、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	-	84,400,971.42	51.28%	30,463.71	22.34%	-
BOCI Securities Ltd	-	29,743,175.33	18.07%	44,614.76	32.72%	-
J. P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	25,407,151.99	15.44%	11,207.03	8.22%	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	-	23,842,512.99	14.49%	47,685.06	34.98%	-
申万	-	1,183,012.36	0.72%	2,366.03	1.74%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

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新增。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
申万	-	-	-	-	-	-	-	-

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	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 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在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 6 月 24 日
3	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珠海盈米财富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、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 31 日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于	上证报、中证报、证	2016 年 5 月 30 日

	旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行“基金通”费率优惠活动的公告	券时报以及基金管理人网站	
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰资产管理有限公司开通转换、定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 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上海联泰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、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 4 月 12 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加渤海银行申购及定投申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 27 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国都证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
9	华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金资产净值公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
 华宝兴业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。

11.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

11.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2016 年 8 月 26 日