

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§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	18
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.11 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	41

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
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.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业增强收益债券型证券投资基金	
基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 2 月 17 日	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	270,896,901.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
下属分级基金的交易代码:	240012	240013
报告期末下属分级基金的份额总额	157,545,697.85 份	113,351,203.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求较高的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别（包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等）的预期收益进行动态跟踪，决定其配置比例。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	蒋松云
	联系电话	021-38505888	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588 021-38924558	95588
传真		021-38505777	010-66105798

注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	郑安国	姜建清

2.4 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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼

§ 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

基金级别	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
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)	报告期(2016 年 1 月 1 日 – 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,981,479.64	4,969,544.49
本期利润	2,998,736.10	4,334,053.93
加权平均基金份额本期利润	0.0254	0.0226
本期加权平均净值利润率	1.75%	1.61%
本期基金份额净值增长率	2.05%	1.85%
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	66,791,934.30	43,289,923.06
期末可供分配基金份额利润	0.4240	0.3819
期末基金资产净值	230,668,436.26	161,091,861.01
期末基金份额净值	1.4641	1.4212

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	49.22%	44.87%

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

华宝兴业增强收益债券 A

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	0.51%	0.03%	0.44%	0.05%	0.07%	-0.02%
过去三个月	0.48%	0.05%	-0.70%	0.08%	1.18%	-0.03%
过去六个月	2.05%	0.05%	-0.44%	0.09%	2.49%	-0.04%
过去一年	7.21%	0.11%	3.25%	0.10%	3.96%	0.01%
过去三年	34.47%	0.22%	5.43%	0.13%	29.04%	0.09%
自基金合同生效日起至 今	49.22%	0.23%	4.21%	0.11%	45.01%	0.12%

华宝兴业增强收益债券 B

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	0.49%	0.03%	0.44%	0.05%	0.05%	-0.02%
过去三个月	0.39%	0.05%	-0.70%	0.08%	1.09%	-0.03%
过去六个月	1.85%	0.05%	-0.44%	0.09%	2.29%	-0.04%
过去一年	6.77%	0.11%	3.25%	0.10%	3.52%	0.01%
过去三年	32.85%	0.22%	5.43%	0.13%	27.42%	0.09%
自基金合同生效日起至 今	44.87%	0.23%	4.21%	0.11%	40.66%	0.12%

注： 1、本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

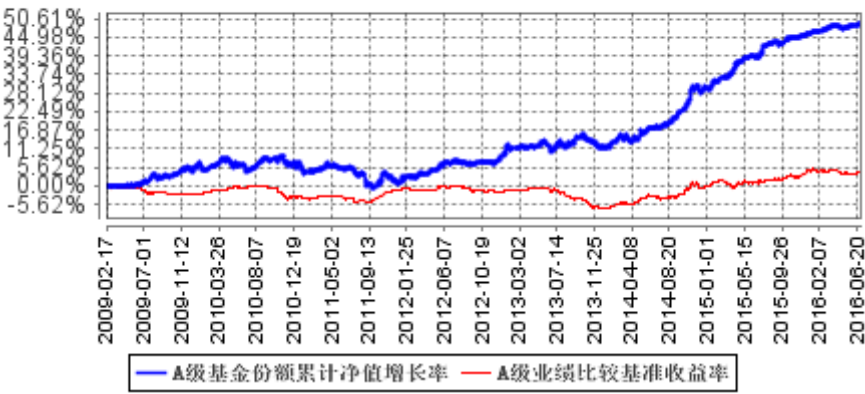
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非

交易日)。

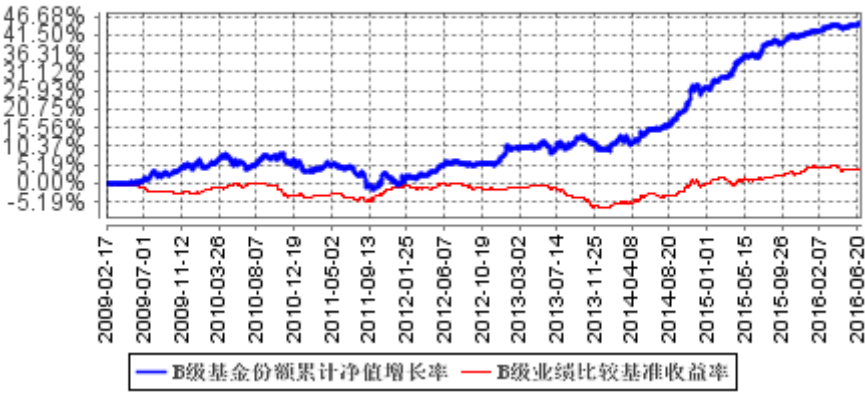
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2009 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日)

A级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



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2009 年 8 月 16 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李栋梁	固定收益部副总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康债券、华宝新机遇混合、华宝新价值混合、华宝兴业可转债债券、华宝宝鑫债券基金经理	2014 年 10 月 11 日	—	13 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资，2010 年 9 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师，2010 年 12 月至 2011 年 6 月任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理助理，2011 年 6 月起担任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）和华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 4 月兼任华宝兴业宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016 年 5 月任固定收益部副总经理。2016 年 6 月兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金经理。
梅峻玺	本基金基金经理	2015 年 3 月 5 日	—	6 年	硕士。曾在长江证券研究部从事研究工作。2011 年

	理助理、 华宝新 价值混 合、华 宝新 机遇 混合基 金经理 助理				2月加入华宝兴业基金管理有限公司担任研究部高级分析师。2015年3月起担任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理。2015年6月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）和华宝兴业新价值灵活配置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》及其各项实施细则、《华宝兴业增强收益债券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。

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

2016 年 1-6 月份，固定资产投资完成额同比增长 9%，1 季度固定资产投资增速微幅反弹，进入 2 季度固定资产投资增速压力再现。分行业来看，制造业投资完成额同比增速下降至 3.3%，房地产开发投资完成额同比增速反弹至 6.1%，但是 2 季度房地产开发投资增速转为下降；制造业投资增速持续下滑且难有起色，房地产投资增速表现相对较好但持续性堪忧，后期存在下滑的压力，基建投资增速维持在 20%左右。房地产销售好转带动投资增速的回升，但是进入 2 季度房地产销售增速下滑，后期房地产固定资产增速可能下降，基建成为唯一的对冲工具了。1-6 月份出口金额同比下降 7.7%，出口增速降幅较 1 季度收窄；1-6 月份进口金额同比下降 10.2%，进口增速较低表明内需很不乐观。1-6 月份社会消费品零售总额同比增长 10.6%，实际消费增速为 10.3%，名义和实际消费增速相对稳定。物价水平相对稳定，6 月份 CPI 为 1.9%，1-6 月份 CPI 为 2.1%，1 季度蔬菜和猪肉价格上涨是物价水平高于预期的主要原因。1 季度央行降准一次，2 季度央行没有大的动作，以公开市场为主，辅之以其他工具，央行 7 天公开市场操作利率保持稳定。1 季度信贷和社会融资总量表现较好，但是 2 季度新增信贷和社会融资总量萎缩的非常快，4 月份信贷事件集中爆发导致信用债融资规模大幅下降，5 月份信用债融资有所修复但仍持续下降，票据风险爆发后票据融资规模下降，地方债置换导致信贷和债券规模下降，企业降低投资增速对于信贷的需求下降等因素共同导致了社会融资总量增速的下降。上半年债券市场波动较大，1 季度长久期债券收益率小幅上行，短久期债券收益率小幅下行，收益率曲线出现平坦化；4 月份违约事件频出，投资者风险偏好的下降导致债券收益率出现快速上行，低等级信用债因信用状况不佳收益率出现快速上升，高等级信用债和利率债因流动性冲击收益率上升；5 月中旬“权威人士”的讲话改变了债券投资者的悲观预期，所有债券收益率都下降，但是高等级信用债和低等级信用债之间的利差拉大；6 月中，债券市场再度上涨，6 月份资金紧张状态低于预期、5 月份信贷和社会融资总量数据欠佳以及英国脱欧等事件共同推动债券收益率的快速下降，收益率曲线整体呈现平坦化走势，信用利差拉大。

股市的波动很大，1 季度股票市场快速下跌且盘中多次出现急涨急跌，3-4 月份股市持续反弹，4 月底至 5 月中股市持续下跌，随后市场再度持续反弹，期间虽有大幅调整，但是市场很快修复。2 季度股市出现结构性机会，从行业板块来看，酒类、新能源、自动驾驶、有色中的黄金等板块走势相对持续，其他板块持续性较差，部分板块如强周期性板块多出现短期快速拉升而长期横盘的走势。从股市走势来看，多次有神秘资金通过拉抬券商板块或者创业板指数权重股来引导市场，降低市场波动。从做绝对收益的角度来说，这样的市场波动对交易的要求极高，择股和择时能力

要非常强，否则很难实现绝对正收益。

可转债整体以下跌为主，一方面股市整体下跌，另一方面新增转债规模较大。新增转债供给规模大幅超过市场存量规模，导致转债的估值水平下降，转债整体的转股溢价率压缩。2 季度随着股市企稳反弹出现结构性行情，转债中的少数品种表现较好。目前转债总体安全性不足，攻击性也不足。

2016 年上半年增强收益债券基金对债券进行了灵活的操作，4 月份债券投资比例较低，4 月底增加了债券的配置比例，6 月份再度增加了债券的配置比例，总体上提高了利率债和中高等级信用债的配置比例，提高了组合的久期；增强收益债券基金对股票进行了灵活操作，总体上采用少量投资股票的策略，2 季度市场出现结构性行情，基金股票配置较低导致收益表现不佳，管理人行业配置和个股选择能力有待提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内增强收益 A 基金份额净值增长率为 2.05%，同期业绩比较基准收益率为-0.44%；增强收益 B 基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为-0.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济走势来看，下半年经济下行压力依然很大。居民消费保持相对稳定，但是出口和投资难有起色。全球经济较为低迷，中国的出口难有好的表现；固定资产投资中，制造业投资增速持续下降，下半年房地产销售增速下滑，房地产销售增速的下滑可能导致房地产固定资产投资增速的下滑，固定资产投资增速全靠基建对冲。下半年物价水平整体稳定，3 季度物价水平是全年低点，4 季度物价水平转为上升，总体来看，物价水平较为温和。货币政策预计以稳健为主，春节后央行为了对冲外汇占款的下降，降低存款准备金率一次，随后央行始终以公开市场操作为主，辅之以其他工具，公开市场操作利率也保持稳定。近期央行表态，货币宽松政策已经持续很久，目前货币政策有效性下降，预计下半年央行货币政策以稳健为主，降准的概率很低，降息的可能性极低。下半年经济政策可能更多的依赖宽松的财政政策。

整体的经济环境和政策环境对于债券市场依然是有利的。经济下行压力依然很大，物价水平较为温和，货币政策较为稳健但可能根据经济和物价的组合情况相机决策。只是债券市场在经历了 5-7 月份的快速上涨之后，收益率曲线较为平坦化，在央行不下调 7 天公开市场操作利率的情况下，收益率曲线的进一步平坦化需要更强的推动因素，如信贷和社会融资总量的快速下行、经济增速的快速下行等；总体来看，下半年债券市场可能出现慢牛的走势，收益率曲线可能进一步

平坦化，期间资金面紧张、单月经济数据的好转可能对收益率的下行造成扰动。信用债的风险依然较大，尤其是低等级的信用债，需要回归本源，对债券发行人的经营状态、财务状况等进行仔细分析之后进行投资决策；中高等级信用债的走势和利率债较为一致。股票市场整体难有好的表现，还是以结构性行情为主，行业和个券的选择更加重要。转债整体的安全性和攻击性均不足，转债的走势很可能和股市一致，以结构性行情为主，转债的投资需要精选个券。总得来说市场依然存在不确定性，我们会高度关注经济和政策的变化，分析其对大类资产配置的影响，以改善业绩。

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应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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华宝兴业增强收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华宝兴业增强收益债券型证券投资基金的管理人——华宝兴业基金管理有限公司在华宝兴业增强收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，华宝兴业增强收益债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华宝兴业基金管理有限公司编制和披露的华宝兴业增强收益债券型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

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	6,285,272.14	5,038,386.13
结算备付金		1,303,129.50	1,044,816.23
存出保证金		125,949.14	88,991.40
交易性金融资产	6.4.7.2	417,694,357.00	406,899,979.36
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		417,694,357.00	406,899,979.36
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		-	923,503.08
应收利息	6.4.7.5	7,202,750.65	9,979,846.98
应收股利		-	-
应收申购款		465,877.59	1,180,598.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		433,077,336.02	425,156,121.61
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		38,000,000.00	27,000,000.00
应付证券清算款		2,006,701.91	230,245.27
应付赎回款		629,596.04	572,890.45
应付管理人报酬		198,826.76	200,372.91
应付托管费		66,275.57	66,790.96
应付销售服务费		57,017.09	92,218.97
应付交易费用	6.4.7.7	170,159.62	311,792.27
应交税费		-	-
应付利息		-	4,253.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,461.76	141,478.90
负债合计		41,317,038.75	28,620,043.57
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	270,896,901.81	281,737,492.90
未分配利润	6.4.7.10	120,863,395.46	114,798,585.14
所有者权益合计		391,760,297.27	396,536,078.04
负债和所有者权益总计		433,077,336.02	425,156,121.61

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 A 类：1.4641 元，B 类：1.4212 元，基金份额总额 A 类：157,545,697.85 份，B 类：113,351,203.96 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

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	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015
-----	-----	-----------------------	---------------------------------

		2016 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		10,400,712.47	6,423,158.83
1.利息收入		10,830,922.64	2,249,045.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,811.04	27,359.74
债券利息收入		10,718,469.06	2,215,396.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,642.54	6,289.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		147,638.31	3,449,381.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	158,202.46	3,144,103.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-10,564.15	299,976.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	5,301.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-618,234.10	694,735.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	40,385.62	29,996.18
减：二、费用		3,067,922.44	986,317.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,310,547.62	260,960.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	436,849.14	86,986.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	536,538.32	118,019.74
4. 交易费用	6.4.7.19	316,915.60	182,292.55
5. 利息支出		317,200.04	255,520.12
其中：卖出回购金融资产支出		317,200.04	255,520.12
6. 其他费用	6.4.7.20	149,871.72	82,537.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,332,790.03	5,436,840.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,332,790.03	5,436,840.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

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)	281,737,492.90	114,798,585.14	396,536,078.04
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	7,332,790.03	7,332,790.03
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)	-10,840,591.09	-1,267,979.71	-12,108,570.80
其中：1.基金申购款	221,389,254.08	95,131,870.34	316,521,124.42
2.基金赎回款	-232,229,845.17	-96,399,850.05	-328,629,695.22
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)	270,896,901.81	120,863,395.46	391,760,297.27
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)	32,126,547.48	8,380,429.64	40,506,977.12
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	5,436,840.96	5,436,840.96
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)	58,381,200.51	17,505,824.88	75,887,025.39
其中：1.基金申购款	132,672,182.52	41,922,217.35	174,594,399.87
2.基金赎回款	-74,290,982.01	-24,416,392.47	-98,707,374.48
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)	90,507,747.99	31,323,095.48	121,830,843.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金(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”)证监许可[2008]第 1294 号《关于核准华宝兴业增强收益债券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《华宝兴业增强收益债券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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,257,644,988.35 元,业经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2009)验字第 60737318_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 2 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,258,208,383.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 563,394.90 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即 A 类基金份额和 B 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业增强收益债券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具有良好流动性的金融工具,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、权证,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可通过投资首次发行股票、增发新股、可转换债券转股票以及权证行权等方式获得股票,也可直接从二级市场买入股票。本基金可通过参与可分离转债申购而获得权证,也可直接从二级市场买入权证。本基金的业绩比较基准为:中国债券总指数收益率 $\times 100\%$ 。

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》、《华宝兴业增强收益债券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

本基金 2016 半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	6,285,272.14
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	6,285,272.14

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	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	335,920,187.80	335,495,357.00	-424,830.80
	银行间市场	79,961,244.80	82,199,000.00	2,237,755.20
	合计	415,881,432.60	417,694,357.00	1,812,924.40
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		415,881,432.60	417,694,357.00	1,812,924.40

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	2,104.28
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	586.40
应收债券利息	7,200,003.27
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	56.70
合计	7,202,750.65

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	169,409.62
银行间市场应付交易费用	750.00
合计	170,159.62

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	1,786.96
预提费用	186,674.80
合计	188,461.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 A		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,147,485.27	86,147,485.27
本期申购	108,971,258.86	108,971,258.86
本期赎回(以“-”号填列)	-37,573,046.28	-37,573,046.28
本期末	157,545,697.85	157,545,697.85

金额单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 B		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	195,590,007.63	195,590,007.63
本期申购	112,417,995.22	112,417,995.22
本期赎回(以“-”号填列)	-194,656,798.89	-194,656,798.89
本期末	113,351,203.96	113,351,203.96

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,990,945.54	3,461,575.07	37,452,520.61
本期利润	2,981,479.64	17,256.46	2,998,736.10
本期基金份额交易产生的变动数	29,819,509.12	2,851,972.58	32,671,481.70
其中：基金申购款	45,154,748.36	4,324,391.35	49,479,139.71
基金赎回款	-15,335,239.24	-1,472,418.77	-16,807,658.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,791,934.30	6,330,804.11	73,122,738.41

单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	69,665,549.38	7,680,515.15	77,346,064.53
本期利润	4,969,544.49	-635,490.56	4,334,053.93
本期基金份额交易产生的变动数	-31,345,170.81	-2,594,290.60	-33,939,461.41
其中：基金申购款	41,339,106.82	4,313,623.81	45,652,730.63
基金赎回款	-72,684,277.63	-6,907,914.41	-79,592,192.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,289,923.06	4,450,733.99	47,740,657.05

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	52,211.44
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	24,568.70
其他	5,030.90
合计	81,811.04

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	103,014,262.97
减：卖出股票成本总额	102,856,060.51
买卖股票差价收入	158,202.46

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,564.15
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-10,564.15

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	459,180,299.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	451,345,083.34
减：应收利息总额	7,845,780.61
买卖债券差价收入	-10,564.15

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 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	-618,234.10
——股票投资	-
——债券投资	-618,234.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-618,234.10

6.4.7.18 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	23,273.67
转换费收入 240012	17,111.95
合计	40,385.62

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	315,765.60
银行间市场交易费用	1,150.00
合计	316,915.60

6.4.7.20 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	24,863.02
信息披露费	101,811.78
银行汇划费用	4,996.92
清算所 CFCA 证书服务费	200.00
帐户维护费	18,000.00
合计	149,871.72

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝钢集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,310,547.62	260,960.81
其中：支付销售机构的客户维护费	53,038.78	31,519.22

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	436,849.14	86,986.84

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝兴业增强收益 债券 A	华宝兴业增强收益 债券 B	合计
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	-	12,690.98	12,690.98
华宝兴业基金管理有限公司	-	470,799.58	470,799.58
合计	-	483,490.56	483,490.56
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华宝兴业增强收益 债券 A	华宝兴业增强收益 债券 B	合计
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	-	13,347.57	13,347.57
华宝兴业基金管理有限公司	-	89,298.48	89,298.48
合计	-	102,646.05	102,646.05

注:销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,A类不收取销售服务费,B类销售服务费年费率为 0.4%。B 类基金销售服务费计算方法如下:

$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的 B 类基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

本基金本报告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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
基金合同生效日（2009年2月17日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,573,548.84	117,989.49
期间申购/买入总份额	225,343.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	117,989.49
期末持有的基金份额	1,798,891.84	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.14%	0.00%

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
基金合同生效日（2009年2月17日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	86,597.54	63,497.82
期间申购/买入总份额	538,431.12	54,491.67
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	625,028.66	117,989.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.59%	0.23%

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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 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
中国工商银行	6,285,272.14	52,211.44	17,012,631.98	18,572.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 38,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。本基金投资的金融工具主要包括债券、股票等。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在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求较高的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券

发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	10,061,000.00	40,244,000.00
A-1 以下	—	—
AAA	11,941,584.90	—
未评级	52,153,800.00	32,989,900.00
合计	74,156,384.90	73,233,900.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债券、超短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	148,663,205.70	80,116,285.50
AAA 以下	157,789,748.00	196,215,792.56
未评级	37,085,018.40	57,334,001.30
合计	343,537,972.10	333,666,079.36

注：未评级债券为国债、政策性金融债券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，除卖出回购金融资产款余额 38,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	6,285,272.14	-	-	-	6,285,272.14
结算备付金	1,303,129.50	-	-	-	1,303,129.50
存出保证金	125,949.14	-	-	-	125,949.14
交易性金融资产	238,039,801.10	142,569,537.50	37,085,018.40	-	417,694,357.00

应收利息	-	-	-	7,202,750.65	7,202,750.65
应收申购款	-	-	-	465,877.59	465,877.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	245,754,151.88	142,569,537.50	37,085,018.40	7,668,628.24	433,077,336.02
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	38,000,000.00	-	-	-	38,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,006,701.91	2,006,701.91
应付赎回款	-	-	-	629,596.04	629,596.04
应付管理人报酬	-	-	-	198,826.76	198,826.76
应付托管费	-	-	-	66,275.57	66,275.57
应付销售服务费	-	-	-	57,017.09	57,017.09
应付交易费用	-	-	-	170,159.62	170,159.62
其他负债	-	-	-	188,461.76	188,461.76
负债总计	38,000,000.00	-	-	3,317,038.75	41,317,038.75
利率敏感度缺口	207,754,151.88	142,569,537.50	37,085,018.40	4,351,589.49	391,760,297.27
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	5,038,386.13	-	-	-	5,038,386.13
结算备付金	1,044,816.23	-	-	-	1,044,816.23
存出保证金	88,991.40	-	-	-	88,991.40
交易性金融资产	201,631,036.30	157,705,941.76	47,563,001.30	-	406,899,979.36
应收证券清算款	-	-	-	923,503.08	923,503.08
应收利息	-	-	-	9,979,846.98	9,979,846.98
应收申购款	20,123.83	-	-	1,160,474.60	1,180,598.43
资产总计	207,823,353.89	157,705,941.76	47,563,001.30	12,063,824.66	425,156,121.61
负债					
卖出回购金融资产款	27,000,000.00	-	-	-	27,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	230,245.27	230,245.27
应付赎回款	-	-	-	572,890.45	572,890.45
应付管理人报酬	-	-	-	200,372.91	200,372.91
应付托管费	-	-	-	66,790.96	66,790.96
应付销售服务费	-	-	-	92,218.97	92,218.97
应付交易费用	-	-	-	311,792.27	311,792.27
应付利息	-	-	-	4,253.84	4,253.84
其他负债	-	-	-	141,478.90	141,478.90
负债总计	27,000,000.00	-	-	1,620,043.57	28,620,043.57
利率敏感度缺口	180,823,353.89	157,705,941.76	47,563,001.30	10,443,781.09	396,536,078.04

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

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个百分点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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. 市场利率下降 25%	2, 222, 330. 28	2, 065, 056. 24
	2. 市场利率上升 25%	-2, 196, 571. 06	-2, 041, 164. 08

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2015 年 12 月 31 日：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 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二层次的余额为 417,694,357.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额(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二层次的余额为 406,899,979.36 元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	417,694,357.00	96.45
	其中：债券	417,694,357.00	96.45
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,588,401.64	1.75
7	其他各项资产	7,794,577.38	1.80
8	合计	433,077,336.02	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600037	歌华有线	14,673,009.00	3.70
2	300059	东方财富	10,417,134.00	2.63
3	603008	喜临门	9,555,868.95	2.41
4	601377	兴业证券	7,625,606.49	1.92
5	002415	海康威视	6,284,016.18	1.58
6	300284	苏交科	5,749,817.00	1.45
7	002191	劲嘉股份	4,972,384.25	1.25
8	300359	全通教育	4,931,134.50	1.24
9	002236	大华股份	4,852,924.50	1.22
10	002223	鱼跃医疗	4,717,152.12	1.19
11	002390	信邦制药	4,656,299.82	1.17
12	000967	盈峰环境	4,170,336.00	1.05
13	000566	海南海药	3,570,750.00	0.90
14	002488	金固股份	3,143,341.00	0.79
15	002588	史丹利	2,935,458.00	0.74
16	300027	华谊兄弟	2,872,700.00	0.72
17	002454	松芝股份	1,685,604.60	0.43
18	002657	中科金财	1,650,922.00	0.42
19	600718	东软集团	1,524,708.10	0.38
20	002172	澳洋科技	1,481,004.00	0.37

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600037	歌华有线	14,598,517.64	3.68
2	300059	东方财富	10,325,696.20	2.60
3	603008	喜临门	9,528,707.82	2.40
4	601377	兴业证券	6,983,271.60	1.76
5	002415	海康威视	6,195,876.37	1.56

6	300284	苏交科	5,840,105.00	1.47
7	002191	劲嘉股份	5,370,914.00	1.35
8	002236	大华股份	5,142,314.05	1.30
9	002390	信邦制药	4,892,156.57	1.23
10	002223	鱼跃医疗	4,792,749.90	1.21
11	300359	全通教育	4,753,986.20	1.20
12	000967	盈峰环境	4,091,985.50	1.03
13	000566	海南海药	3,457,945.00	0.87
14	002488	金固股份	3,171,053.57	0.80
15	002588	史丹利	3,026,100.00	0.76
16	300027	华谊兄弟	2,769,772.00	0.70
17	002454	松芝股份	1,721,808.00	0.43
18	002657	中科金财	1,686,159.34	0.43
19	600718	东软集团	1,661,369.21	0.42
20	002172	澳洋科技	1,553,149.00	0.39

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	102,856,060.51
卖出股票收入（成交）总额	103,014,262.97

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	17,100,818.40	4.37
2	央行票据	—	—
3	金融债券	42,070,000.00	10.74
	其中：政策性金融债	42,070,000.00	10.74
4	企业债券	318,394,538.60	81.27
5	企业短期融资券	40,129,000.00	10.24
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	417,694,357.00	106.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	122112	11 沪大众	360,200	37,233,874.00	9.50
2	112232	14 长证债	309,037	32,572,499.80	8.31
3	122049	10 营口港	268,520	28,025,432.40	7.15
4	122399	15 中投 G1	263,080	26,523,725.60	6.77
5	011699144	16 洋河 SCP001	200,000	20,042,000.00	5.12

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

14 长证债（112232）于 2016 年 1 月 23 日收到中国证监会湖北监管局行政监管措施决定书，因公司在开展研究报告业务时，存在内部控制不完善的情形，决定对公司采取出具警示函的监管措施；于 2016 年 3 月 17 日收到中国证监会湖北监管局《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》（[2016]3 号），因公司在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责，未按照相关约定，如实披露募集资金使用情况，上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》的

规定，湖北证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施；于 2016 年 3 月 23 日收到全国中小企业股份转让系统《关于对长江证券采取出具警示函的监管措施》，公司主办券商未严格履行投资者适当性管理义务，未健全投资者适当性管理制度和业务流程，未正确配置投资者交易权限及明确告知投资者可正常交易时点，构成违规。

16 洋河 SCP001 (011699144) 于 2015 年 9 月 28 日收到中国银行间市场交易商协会自律处分，因公司延迟披露 2014 年年报及 2015 年一季报，中国银行间市场交易商协会决定对公司及相关责任人员通报批评处分。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人上述债券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	125,949.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,202,750.65
5	应收申购款	465,877.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,794,577.38

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

§ 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

份额级别	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
华宝兴业增强收益债券 A	1,142	137,955.95	124,267,024.69	78.88%	33,278,673.16	21.12%
华宝兴业增强收益债券 B	612	185,214.39	84,391,425.41	74.45%	28,959,778.55	25.55%
合计	1,754	154,445.21	208,658,450.10	77.03%	62,238,451.71	22.97%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华宝兴业增强收益债券 A	3,168,580.87	2.0112%
	华宝兴业增强收益债券 B	50,818.22	0.0448%
	合计	3,219,399.09	1.1884%

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	份额级别	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	华宝兴业增强收益债券 A	>100
	华宝兴业增强收益债券 B	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业增强收益债券 A	>100
	华宝兴业增强收益债券 B	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
基金合同生效日（2009 年 2 月 17 日）基金份额总额	615,728,987.54	1,642,479,395.71
本报告期期初基金份额总额	86,147,485.27	195,590,007.63
本报告期基金总申购份额	108,971,258.86	112,417,995.22
减：本报告期基金总赎回份额	37,573,046.28	194,656,798.89
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	157,545,697.85	113,351,203.96

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本基金自 2015 年 12 月 15 日起更换会计师事务所,由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)更换为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。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:2015 年 12 月 15 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
申万宏源	1	139,719,264.67	67.87%	130,120.56	67.87%	-
国泰君安	1	66,151,058.81	32.13%	61,605.97	32.13%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注:1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下:

(1) 选择标准: 资力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 5 亿元人民币; 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定; 经营行为规范, 最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚; 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求; 具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务; 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专门研究报告; 适当的地域分散化。

(2) 选择程序: (a) 服务评价; (b) 拟定备选交易单元; (c) 签约。

2、本期交易单元无变动。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	114,356,809.43	14.87%	-	-	-	-

国泰君安	654,844,281.03	85.13%	3,011,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、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	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016年5月30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	关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝APP转换业务费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016年2月24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
9	华宝兴业基金管理有限公司	基金管理人网站	2016年1月7日

	关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告		
10	关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
11	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
12	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工商银行“2016 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	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
13	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
14	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	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；
 华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同；
 华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业增强收益债券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