

# 华宝兴业品质生活股票型证券投资基金 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
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.....	38
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.....	38
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.....	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权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	39

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
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.....	40
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.....	40
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
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.....	43
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>45</b>
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	华宝兴业品质生活股票型证券投资基金
基金简称	华宝品质生活股票
基金主代码	000867
交易代码	000867
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 21 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	307,143,695.29 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资那些致力于提升大众生活品质的相关公司股票，在控制风险的前提下，力争为投资者带来长期、稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过投资于那些符合生活品质主题且具有较强竞争优势的上市公司，把握中国经济增长和居民消费升级过程中的投资机会。本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人可根据法律法规及监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942
注册地址		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 1 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 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		郑安国	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

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

## § 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	-61,542,479.94
本期利润	-69,706,437.39
加权平均基金份额本期利润	-0.2250

本期加权平均净值利润率	-29.06%
本期基金份额净值增长率	-22.55%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-64,596,364.13
期末可供分配基金份额利润	-0.2103
期末基金资产净值	242,547,331.16
期末基金份额净值	0.790
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-18.16%

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、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）。

4、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。

### 3.2 基金净值表现

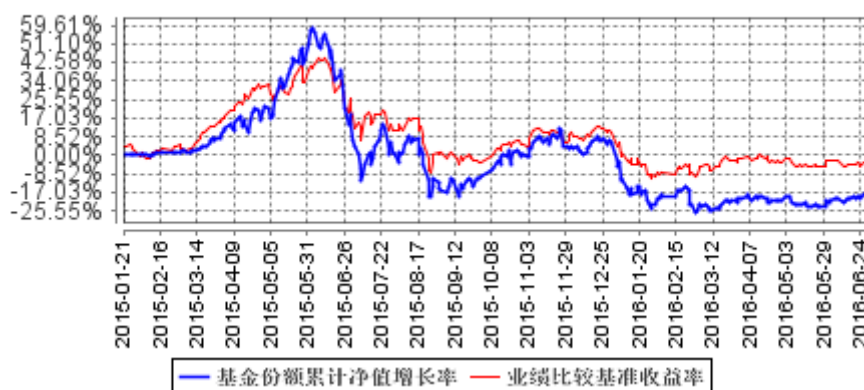
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.95%	0.94%	-0.32%	0.78%	4.27%	0.16%
过去三个月	1.80%	1.02%	-1.42%	0.81%	3.22%	0.21%
过去六个月	-22.55%	2.10%	-11.93%	1.47%	-10.62%	0.63%
过去一年	-31.00%	2.59%	-22.77%	1.84%	-8.23%	0.75%
自基金合同生效日起至 今	-18.16%	2.52%	-2.93%	1.82%	-15.23%	0.70%

#### 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

(2015年1月21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：按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 7 月 21 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

基金管理人于 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		
胡戈游	助理投资	2015 年 1	-	11 年	硕士，拥有 CFA 资格。2005 年 2



	总监、本基金基金经理、华宝兴业宝康消费品混合、华宝核心优势混合基金经理	月 21 日			月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、国内投资部基金经理助理的职务，2009 年 5 月至 2010 年 6 月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010 年 1 月至 2012 年 1 月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。2011 年 2 月起任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至 2015 年 12 月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2015 年 1 月兼任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起任助理投资总监。2016 年 1 月起任华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
光磊	本基金基金经理	2015 年 4 月 9 日	-	9 年	硕士。曾在汇添富基金管理有限公司任投资研究部高级行业分析师。2012 年 10 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月兼任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理助理。2015 年 4 月起任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

上半年市场整体呈现出宽幅震荡的走势。尽管年初的熔断因素和全球货币政策的扰动曾给市场带来了较大影响，但随着美国加息的不断推迟，欧洲出现去全球化的隐忧，国内市场反而进入了相对平稳期。在这种经济 L 型预期，市场震荡的大背景下，一些板块和个股的结构性机会涌现。

上半年上证指数下跌了 18%，深成指下跌 18.62%，中小板指下跌 19.31%，创业板指下跌 19.85%。食品饮料、有色、家电、银行等行业表现较好，休闲服务、互联网、传媒等行业表现较差。

本基金在年初的配置相对均衡，随着市场的变化，持仓结构有所调整，目前主要的配置板块为电子、家电、食品饮料等行业。

#### 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-22.55%，同期业绩比较基准收益率为-11.93%，基金表现落后于比较基准 10.62%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计中国经济总体将保持平稳增长，通胀处于可控范围，整体流动性还比较宽裕。随着十年期国债收益率的下行，股票市场相对的吸引力在扩大。从消费的角度看，我们认为决定消费变化的几个长期趋势依然存在：（1）以“90 后”为代表的新生代逐步走向成熟，新兴消费需求不断提升，特别是在文化传媒领域的需求将持续旺盛；（2）“银发人群”的逐步增加和养老产业的有待完善，导致老龄化消费相关的产业链有长期发展空间；（3）新兴技术广泛应用于消费领域，消费电子、新能源汽车、可穿戴设备等子行业发展迅速。因此，我们对消费行业的产业升级和长期发

展仍比较乐观。我们将会继续在相关的领域中努力发掘投资机会。

感谢持有人一直以来对我们的支持，在后续投资中，我们将继续总结经验，勤勉尽责，努力实现本基金的良好表现。

#### 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 & 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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝兴业品质生活股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业品质生活股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	37,849,439.16	30,846,932.17
结算备付金		1,037,833.62	4,838,713.75
存出保证金		273,445.42	366,862.11
交易性金融资产	6.4.7.2	205,601,467.73	277,932,288.06
其中：股票投资		205,601,467.73	277,481,588.06
基金投资		-	-
债券投资		-	450,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,938,771.76	-
应收利息	6.4.7.5	7,026.04	7,292.41
应收股利		-	-
应收申购款		11,407.24	68,668.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		246,719,390.97	314,060,756.98

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
<b>负 债:</b>			
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		-	2,214,042.38
应付赎回款		451,515.46	693,239.45
应付管理人报酬		293,760.59	397,154.52
应付托管费		48,960.08	66,192.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,870,805.98	3,976,176.01
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	507,017.70	442,332.84
负债合计		4,172,059.81	7,789,137.62
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	307,143,695.29	300,296,150.20
未分配利润	6.4.7.10	-64,596,364.13	5,975,469.16
所有者权益合计		242,547,331.16	306,271,619.36
负债和所有者权益总计		246,719,390.97	314,060,756.98

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.790 元，基金份额总额 307,143,695.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业品质生活股票型证券投资基金

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 21 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-64,095,241.55	337,198,023.86
1.利息收入		146,949.13	7,998,270.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	146,855.29	2,739,973.93
债券利息收入		93.84	29.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	5,258,266.41

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-56,122,552.24	334,893,470.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-57,957,819.19	333,300,223.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	56,406.05	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
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	1,778,860.90	1,593,247.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-8,163,957.45	-12,277,361.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	44,319.01	6,583,644.42
<b>减：二、费用</b>		5,611,195.84	18,378,118.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,794,065.05	8,415,376.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	299,010.85	1,402,562.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	3,357,754.30	8,330,958.03
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	160,365.64	229,221.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-69,706,437.39	318,819,905.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-69,706,437.39	318,819,905.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业品质生活股票型证券投资基金

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）	300,296,150.20	5,975,469.16	306,271,619.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-69,706,437.39	-69,706,437.39
三、本期基金份额交易	6,847,545.09	-865,395.90	5,982,149.19

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	26,312,730.02	-4,951,182.16	21,361,547.86
2.基金赎回款	-19,465,184.93	4,085,786.26	-15,379,398.67
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)	307,143,695.29	-64,596,364.13	242,547,331.16
项目	上年度可比期间 2015年1月21日(基金合同生效日)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)	1,770,403,712.60	-	1,770,403,712.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	318,819,905.55	318,819,905.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,360,544,153.56	-233,280,128.79	-1,593,824,282.35
其中: 1.基金申购款	244,751,248.10	62,069,719.33	306,820,967.43
2.基金赎回款	-1,605,295,401.66	-295,349,848.12	-1,900,645,249.78
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)	-	-25,919,600.83	-25,919,600.83
五、期末所有者权益(基金净值)	409,859,559.04	59,620,175.93	469,479,734.97

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

\_\_\_\_\_  
向辉

\_\_\_\_\_  
张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业品质生活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”)证监许可【2014】1117号文《关于准予华宝兴业品质生活股票型证券

投资基金注册的批复》准予，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《华宝兴业品质生活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 1,769,911,314.36 元，业经安永华明会计师事务所安永华明（2015）验字第 60737318\_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,770,403,712.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 492,398.24 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券、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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于品质生活主题类上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于现金、货币市场工具、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中，持有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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴生态中国股票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

本基金本报告期无重大会计差错。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
活期存款	37,849,439.16
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	37,849,439.16

#### 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	201,855,751.14	205,601,467.73	3,745,716.59
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	201,855,751.14	205,601,467.73	3,745,716.59

#### 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	6,434.87
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	468.07
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	123.10
合计	7,026.04

#### 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	2,870,805.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,870,805.98

#### 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	742.56
预提费用	506,275.14
合计	507,017.70

#### 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	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	300,296,150.20	300,296,150.20
本期申购	26,312,730.02	26,312,730.02
本期赎回(以“-”号填列)	-19,465,184.93	-19,465,184.93
本期末	307,143,695.29	307,143,695.29

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,074,709.02	-44,099,239.86	5,975,469.16
本期利润	-61,542,479.94	-8,163,957.45	-69,706,437.39
本期基金份额交易产生的变动数	1,566,378.19	-2,431,774.09	-865,395.90
其中：基金申购款	1,613,888.55	-6,565,070.71	-4,951,182.16
基金赎回款	-47,510.36	4,133,296.62	4,085,786.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,901,392.73	-54,694,971.40	-64,596,364.13

### 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	128,160.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	16,246.56
其他	2,447.78
合计	146,855.29

### 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	1,115,331,776.18
减：卖出股票成本总额	1,173,289,595.37
买卖股票差价收入	-57,957,819.19

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 ——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	507,269.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	450,700.00
减：应收利息总额	162.99
买卖债券差价收入	56,406.05

#### 6.4.7.14 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	1,778,860.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,778,860.90

#### 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	-8,163,957.45
——股票投资	-8,163,957.45
——债券投资	-
——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	-8,163,957.45

#### 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	37,292.33
转换费收入	7,026.68
合计	44,319.01

#### 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	3,357,754.30
银行间市场交易费用	-
合计	3,357,754.30

#### 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	39,781.56
信息披露费	106,493.58
银行汇划费用	5,090.50
债券帐户维护费	9,000.00
开户费	-
合计	160,365.64

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本期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21日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,794,065.05	8,415,376.10
其中：支付销售机构的客户维护费	670,778.02	4,101,114.80

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 X 1.5% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

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21日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	299,010.85	1,402,562.71

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日
期初持有的基金份额	373,231.35	0.00
期间申购/买入总份额	-	322,758.94
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	373,231.35	322,758.94
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.12%	0.08%

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。

### 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月21日(基金合同生效日)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
中国银行	37,849,439.16	128,160.95	102,676,079.79	1,310,688.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002127	南极电商	2016年5月16日	重大事项停牌	9.63	-	-	156,502	1,498,842.29	1,507,114.26	-
000018	神州长城	2016年6月24日	重大事项停牌	12.17	2016年7月11日	12.88	116,600	1,219,159.20	1,419,022.00	-
600576	万家文化	2016年4月11日	重大事项停牌	22.35	-	-	49,900	1,076,734.48	1,115,265.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动股票型证券投资基金，属于较高风险较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，因而与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。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分暂时流通受限的资产外，本基金持有的其余证券均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有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、结算

备付金、存出保证金及债券投资等。

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	37,849,439.16	-	-	-	37,849,439.16
结算备付金	1,037,833.62	-	-	-	1,037,833.62
存出保证金	273,445.42	-	-	-	273,445.42
交易性金融资产	-	-	-	-205,601,467.73	205,601,467.73
应收证券清算款	-	-	-	1,938,771.76	1,938,771.76
应收利息	-	-	-	7,026.04	7,026.04
应收申购款	-	-	-	11,407.24	11,407.24
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,160,718.20	-	-	-207,558,672.77	246,719,390.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	451,515.46	451,515.46
应付管理人报酬	-	-	-	293,760.59	293,760.59
应付托管费	-	-	-	48,960.08	48,960.08
应付交易费用	-	-	-	2,870,805.98	2,870,805.98
其他负债	-	-	-	507,017.70	507,017.70
负债总计	-	-	-	4,172,059.81	4,172,059.81
利率敏感度缺口	39,160,718.20	-	-	-203,386,612.96	242,547,331.16
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	30,846,932.17	-	-	-	30,846,932.17
结算备付金	4,838,713.75	-	-	-	4,838,713.75
存出保证金	366,862.11	-	-	-	366,862.11
交易性金融资产	-	-	450,700.00	277,481,588.06	277,932,288.06
应收利息	-	-	-	7,292.41	7,292.41
应收申购款	-	-	-	68,668.48	68,668.48
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,052,508.03	-	450,700.00	277,557,548.95	314,060,756.98
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,214,042.38	2,214,042.38
应付赎回款	-	-	-	693,239.45	693,239.45
应付管理人报酬	-	-	-	397,154.52	397,154.52
应付托管费	-	-	-	66,192.42	66,192.42

应付交易费用	-	-	-	3,976,176.01	3,976,176.01
其他负债	-	-	-	442,332.84	442,332.84
负债总计	-	-	-	7,789,137.62	7,789,137.62
利率敏感度缺口	36,052,508.03	-	450,700.00	269,768,411.33	306,271,619.36

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。

#### 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，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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低价格风险。本基金投资组合中股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于品质生活主题类上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，持有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	205,601,467.73	84.77	277,481,588.06	90.60
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	205,601,467.73	84.77	277,481,588.06	90.60

#### 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 )
	业绩比较基准上升 5%	14,983,894.99	-
	业绩比较基准下降 5%	-14,983,894.99	-

#### 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 201,560,066.47 元, 属于第二层次的余额为 4,041,401.26 元, 无属于第三

层次的余额（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 250,744,389.66 元，属于第二层次的余额为 27,187,898.40 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（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。

(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	205,601,467.73	83.33
	其中：股票	205,601,467.73	83.33
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	38,887,272.78	15.76
7	其他各项资产	2,230,650.46	0.90
8	合计	246,719,390.97	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,747.58	0.00
B	采矿业	30,334,967.36	12.51
C	制造业	146,967,798.17	60.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,878,045.00	2.42
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,006,612.00	2.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,399,478.21	5.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,691.52	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,999,127.89	1.65
S	综合	-	-
	合计	205,601,467.73	84.77



## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002236	大华股份	848,799	11,119,266.90	4.58
2	002415	海康威视	511,950	10,986,447.00	4.53
3	000858	五粮液	273,979	8,912,536.87	3.67
4	002032	苏泊尔	205,134	7,066,866.30	2.91
5	000333	美的集团	294,900	6,995,028.00	2.88
6	002563	森马服饰	574,900	6,226,167.00	2.57
7	300058	蓝色光标	575,900	5,591,989.00	2.31
8	002400	省广股份	375,115	5,300,374.95	2.19
9	002588	史丹利	424,200	5,238,870.00	2.16
10	000983	西山煤电	617,964	5,036,406.60	2.08
11	600887	伊利股份	298,352	4,973,527.84	2.05
12	600519	贵州茅台	16,955	4,949,503.60	2.04
13	002155	湖南黄金	361,840	4,765,432.80	1.96
14	000568	泸州老窖	159,100	4,725,270.00	1.95
15	002705	新宝股份	294,348	4,597,715.76	1.90
16	600547	山东黄金	116,100	4,517,451.00	1.86
17	600085	同仁堂	146,700	4,370,193.00	1.80
18	002182	云海金属	218,400	4,346,160.00	1.79
19	600006	东风汽车	468,700	4,157,369.00	1.71
20	002078	太阳纸业	835,500	4,077,240.00	1.68
21	600160	巨化股份	370,200	3,935,226.00	1.62
22	000673	当代东方	312,513	3,915,787.89	1.61
23	603866	桃李面包	86,900	3,889,644.00	1.60
24	601898	中煤能源	743,100	3,834,396.00	1.58
25	603898	好莱客	118,200	3,674,838.00	1.52
26	600489	中金黄金	317,800	3,572,072.00	1.47
27	002436	兴森科技	155,100	3,534,729.00	1.46
28	600988	赤峰黄金	175,900	3,280,535.00	1.35
29	600584	长电科技	157,400	3,193,646.00	1.32
30	000911	南宁糖业	121,927	3,057,929.16	1.26

31	002315	焦点科技	44,400	2,995,224.00	1.23
32	002079	苏州固锴	261,748	2,923,725.16	1.21
33	002626	金达威	168,071	2,831,996.35	1.17
34	002418	康盛股份	245,811	2,595,764.16	1.07
35	002405	四维图新	102,400	2,519,040.00	1.04
36	002085	万丰奥威	139,278	2,394,188.82	0.99
37	300219	鸿利光电	153,200	2,386,856.00	0.98
38	600188	兖州煤业	214,784	2,349,736.96	0.97
39	000705	浙江震元	165,200	2,327,668.00	0.96
40	600157	永泰能源	576,700	2,272,198.00	0.94
41	002090	金智科技	76,455	2,245,483.35	0.93
42	600750	江中药业	69,888	2,222,438.40	0.92
43	600153	建发股份	183,236	2,198,832.00	0.91
44	300375	鹏翎股份	68,000	1,838,040.00	0.76
45	000921	海信科龙	215,600	1,709,708.00	0.70
46	002156	通富微电	113,654	1,602,521.40	0.66
47	002127	南极电商	156,502	1,507,114.26	0.62
48	000018	神州长城	116,600	1,419,022.00	0.59
49	603020	爱普股份	53,300	1,220,037.00	0.50
50	600576	万家文化	49,900	1,115,265.00	0.46
51	002185	华天科技	83,800	1,066,774.00	0.44
52	600855	航天长峰	34,000	1,064,200.00	0.44
53	002239	奥特佳	52,400	844,164.00	0.35
54	600056	中国医药	52,100	826,306.00	0.34
55	300089	文化长城	63,500	782,320.00	0.32
56	600479	千金药业	45,300	765,117.00	0.32
57	601225	陕西煤业	136,700	706,739.00	0.29
58	600651	飞乐音响	50,400	638,064.00	0.26
59	300346	南大光电	11,100	496,503.00	0.20
60	300231	银信科技	26,700	492,348.00	0.20
61	002572	索菲亚	8,300	464,966.00	0.19
62	002049	同方国芯	9,519	418,360.05	0.17
63	600976	健民集团	8,800	236,280.00	0.10
64	601965	中国汽研	14,445	138,816.45	0.06
65	600136	当代明诚	3,600	83,340.00	0.03
66	002425	凯撒股份	2,000	44,000.00	0.02
67	000888	峨眉山 A	888	10,691.52	0.00
68	002234	民和股份	151	4,440.91	0.00
69	002458	益生股份	7	306.67	0.00

70	600418	江淮汽车	20	253.60	0.00
----	--------	------	----	--------	------

## 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	600519	贵州茅台	41,713,132.60	13.62
2	000858	五粮液	31,380,077.03	10.25
3	002236	大华股份	25,306,430.16	8.26
4	601398	工商银行	25,157,566.00	8.21
5	002090	金智科技	19,925,445.75	6.51
6	002299	圣农发展	18,476,080.13	6.03
7	600547	山东黄金	17,415,004.34	5.69
8	600489	中金黄金	16,794,418.94	5.48
9	600104	上汽集团	15,939,512.40	5.20
10	000333	美的集团	15,281,159.07	4.99
11	601288	农业银行	14,691,002.63	4.80
12	000895	双汇发展	14,251,357.64	4.65
13	600418	江淮汽车	13,367,249.53	4.36
14	600887	伊利股份	12,407,828.25	4.05
15	601328	交通银行	12,356,414.00	4.03
16	601939	建设银行	12,167,927.50	3.97
17	601555	东吴证券	11,754,127.00	3.84
18	002032	苏泊尔	10,863,519.91	3.55
19	600690	青岛海尔	10,571,968.94	3.45
20	002508	老板电器	10,374,994.91	3.39
21	002415	海康威视	10,040,538.20	3.28
22	002155	湖南黄金	9,722,773.99	3.17
23	000568	泸州老窖	9,656,502.42	3.15
24	600585	海螺水泥	8,722,921.15	2.85
25	000596	古井贡酒	8,095,812.77	2.64
26	002127	南极电商	8,070,043.86	2.63
27	000876	新希望	7,706,394.27	2.52
28	002739	万达院线	7,367,406.00	2.41

29	603308	应流股份	7,239,311.73	2.36
30	002094	青岛金王	7,183,790.54	2.35
31	000060	中金岭南	7,160,134.50	2.34
32	600201	生物股份	7,085,320.32	2.31
33	600028	中国石化	7,034,146.00	2.30
34	600048	保利地产	7,004,433.00	2.29
35	002343	慈文传媒	6,971,432.96	2.28
36	601699	潞安环能	6,746,745.00	2.20
37	000001	平安银行	6,718,239.75	2.19
38	601021	春秋航空	6,716,106.62	2.19
39	601166	兴业银行	6,697,894.44	2.19
40	300017	网宿科技	6,665,746.00	2.18
41	601668	中国建筑	6,660,732.00	2.17
42	002563	森马服饰	6,495,914.40	2.12
43	002385	大北农	6,260,802.43	2.04
44	002588	史丹利	6,228,039.80	2.03
45	000911	南宁糖业	6,173,758.15	2.02

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	600519	贵州茅台	38,761,894.42	12.66
2	002090	金智科技	25,480,855.91	8.32
3	601398	工商银行	25,418,728.01	8.30
4	000858	五粮液	25,081,077.25	8.19
5	002299	圣农发展	19,297,540.71	6.30
6	002739	万达院线	16,913,120.29	5.52
7	600104	上汽集团	16,702,870.22	5.45
8	600418	江淮汽车	15,664,090.38	5.11
9	300146	汤臣倍健	14,890,051.94	4.86
10	601288	农业银行	14,480,462.26	4.73
11	002236	大华股份	14,175,439.33	4.63
12	000895	双汇发展	13,852,234.37	4.52
13	300144	宋城演艺	13,021,283.15	4.25
14	601939	建设银行	12,546,241.30	4.10

15	601328	交通银行	12,399,914.90	4.05
16	600489	中金黄金	11,815,184.26	3.86
17	600547	山东黄金	11,545,050.33	3.77
18	601555	东吴证券	11,329,814.16	3.70
19	002508	老板电器	11,011,469.02	3.60
20	600060	海信电器	10,775,097.30	3.52
21	600690	青岛海尔	10,484,844.61	3.42
22	300017	网宿科技	10,437,203.28	3.41
23	002462	嘉事堂	10,340,455.00	3.38
24	000802	北京文化	10,260,591.84	3.35
25	002035	华帝股份	9,673,149.42	3.16
26	603308	应流股份	9,232,261.59	3.01
27	000333	美的集团	8,979,387.64	2.93
28	000596	古井贡酒	8,829,315.91	2.88
29	002234	民和股份	8,693,510.75	2.84
30	600585	海螺水泥	8,108,332.62	2.65
31	300058	蓝色光标	7,864,246.50	2.57
32	002421	达实智能	7,847,223.57	2.56
33	600887	伊利股份	7,518,877.30	2.45
34	000876	新希望	7,428,176.14	2.43
35	002188	巴士在线	7,415,098.78	2.42
36	600028	中国石化	7,289,666.55	2.38
37	002127	南极电商	7,102,526.63	2.32
38	600201	生物股份	6,890,028.62	2.25
39	000001	平安银行	6,842,255.52	2.23
40	601166	兴业银行	6,783,973.92	2.22
41	601668	中国建筑	6,776,204.27	2.21
42	600048	保利地产	6,761,552.20	2.21
43	300178	腾邦国际	6,756,058.22	2.21
44	002665	首航节能	6,744,157.14	2.20
45	002343	慈文传媒	6,674,891.64	2.18
46	002385	大北农	6,600,087.84	2.15
47	300160	秀强股份	6,295,411.79	2.06
48	002137	麦达数字	6,237,936.65	2.04
49	601021	春秋航空	6,207,915.67	2.03
50	000060	中金岭南	6,168,435.72	2.01
51	300248	新开普	6,161,788.63	2.01
52	002094	青岛金王	6,140,360.10	2.00

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,109,573,432.49
卖出股票收入（成交）总额	1,115,331,776.18

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	273,445.42
2	应收证券清算款	1,938,771.76
3	应收股利	-
4	应收利息	7,026.04
5	应收申购款	11,407.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,230,650.46

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
5,680	54,074.59	373,231.35	0.12%	306,770,463.94	99.88%

### 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	432,889.33	0.1409%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年1月21日）基金份额总额	1,770,403,712.60
本报告期期初基金份额总额	300,296,150.20
本报告期基金总申购份额	26,312,730.02
减：本报告期基金总赎回份额	19,465,184.93
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	307,143,695.29

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

本报告期内，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

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日(2015年1月21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，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
中泰证券	1	673,023,733.69	30.25%	626,784.79	30.65%	-
国金证券	2	363,643,198.22	16.34%	331,832.65	16.23%	-
广发证券	2	296,378,900.44	13.32%	270,090.37	13.21%	-
海通证券	1	240,436,708.37	10.81%	219,110.01	10.71%	-
安信证券	1	218,528,066.10	9.82%	199,144.45	9.74%	-
华创证券	2	108,766,127.13	4.89%	99,118.63	4.85%	-
长江证券	1	103,019,835.30	4.63%	95,941.72	4.69%	-
光大证券	1	61,837,277.99	2.78%	56,352.38	2.76%	-
兴业证券	2	41,046,521.25	1.84%	37,405.87	1.83%	-
中信金通	1	35,075,451.28	1.58%	32,665.82	1.60%	-
中信建投	1	30,154,461.26	1.36%	28,082.37	1.37%	-

浙商证券	2	22,507,137.30	1.01%	20,510.55	1.00%	-
国海证券	2	14,666,079.99	0.66%	13,365.20	0.65%	-
国泰君安	1	10,238,660.12	0.46%	9,535.23	0.47%	-
招商证券	1	5,583,050.23	0.25%	5,087.67	0.25%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：财力雄厚，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，并能为本基金提供全面的信息服；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；适当的区域分散化。

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

2. 本基金本报告期券商交易单元无新增。

### 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	
	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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	507,269.04	100.00%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-

### 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在上海联泰资产管理有限公司开通转换、定	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2016年5月3日

	投业务并参加定投费率优惠活动的公告		
5	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诺亚正行（上海）基金投资顾问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	2016 年 4 月 25 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 7 日
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因指数熔断调整公司旗下部分基	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日

	金开放时间的公告		
13	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；  
 华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金合同；  
 华宝兴业品质生活股票型证券投资基金招募说明书；  
 华宝兴业品质生活股票型证券投资基金托管协议；  
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

### 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