

# 华宝兴业大盘精选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.....	5
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.....	9
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.....	10
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.....	11
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>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
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.....	38

<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.....	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
<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.....	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.....	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	华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金
基金简称	华宝大盘精选混合
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,480,227.48 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。
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混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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	xpxl@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	-18,827,327.15
本期利润	-22,211,653.37
加权平均基金份额本期利润	-0.3576
本期加权平均净值利润率	-21.06%
本期基金份额净值增长率	-16.21%
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	44,762,469.31
期末可供分配基金份额利润	0.7281
期末基金资产净值	106,242,696.79
期末基金份额净值	1.7281
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	100.46%

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	2.63%	1.47%	-0.32%	0.78%	2.95%	0.69%
过去三个月	-1.70%	1.50%	-1.42%	0.81%	-0.28%	0.69%
过去六个月	-16.21%	2.39%	-11.93%	1.47%	-4.28%	0.92%
过去一年	-17.39%	2.86%	-22.77%	1.84%	5.38%	1.02%
过去三年	44.94%	2.11%	39.74%	1.47%	5.20%	0.64%
自基金合同生效日起至 今	100.46%	1.69%	52.51%	1.40%	47.95%	0.29%

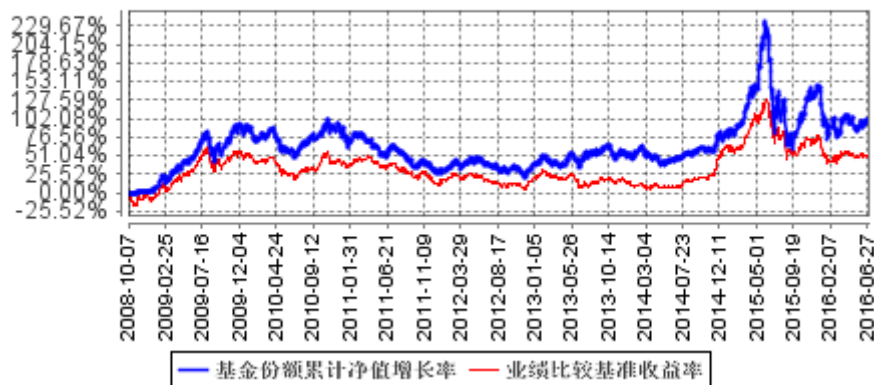
注：1、本基金比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

（2008 年 10 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，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2009 年 4 月 7 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（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		
夏林锋	本基金基金经理、华宝生态中国混合、华宝新价值混合基金经理	2014 年 10 月 22 日	-	6 年	硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任分析师，2012 年 10 月至 2014 年 10 月担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理助理，2014 年 10 月起担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 2 月兼任华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起兼任华宝兴业新价值灵活配置混合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、《华宝兴业大盘精选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。

## 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 年上半年，市场呈现宽幅震荡态势，2016 年新年之后因人民币汇率波动、熔断措施实施等冲击导致市场大跌，随后 1-2 月信贷大幅超预期使得市场企稳修复，市场热点在于传统经济需求侧及供给侧改革，但 5 月初权威人士发表的《开局首季问大势》对市场预期形成较大影响，市场风格也出现较大转变。政策方面，改革转型仍是主基调，同时 1-2 月信贷投放较快对市场偏好有所修复，而权威人士的表态成为重要分水岭，需求侧有所弱化，再次强调经济 L 型、强调改革创新。流动性方面，整体仍较宽松，但自 1 月 2.5 万亿巨量信贷之后，流动性持续宽松的空间有

所收窄，同时降息、降准节奏明显趋缓，央行更多通过 SLF、MLF、PLS 等工具进行调节。经济形势方面，随着流动性持续宽松，整体经济景气有所好转，尤其 3、4 月旺季表现尚可，但持续性一般，且民间投资热情呈现逐月走低的迹象，后续情况还需跟踪。海外市场方面，美元加息节奏趋缓，虽然石油重回 50 美元附近降低了地缘政治风险，但英国脱欧、恐怖袭击增多等因素加大了市场波动，整体形势仍然面临较大的不确定性。

在上述背景下，2016 年上半年行情较为震荡，同时风格变化较为明显。本基金在上半年维持中性仓位，并持续进行结构调整、优化，持续重视大盘价值与大盘成长之间的轮换。

#### 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-16.21%，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 4.28%。

#### 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，政策方面，结合中央经济工作会议、政府工作报告及权威人士相关讲话所提及的思路，预计整体思路仍是经济工作会议定调的“稳增长、调结构、惠民生、防风险”；流动性方面，预期整体仍将宽松，只是宽松的斜率可能趋缓，降息降准节奏明显趋缓且本身操作空间也在收窄，同时央行逐步采取利率走廊模式，更加重视利率水平（价格）而非投放规模的管控；经济形势方面，从目前公布数据及草根的情况来看，弱势企稳的概率较大，但向上的动能也不太足，整体可能还是 L 型；企业盈利方面，结合目前的流动性及经济景气来看，预计向上向下超预期的概率都不太大，维持区间振荡将是大概率事件；海外市场方面，美联储的加息节奏仍是影响新兴市场的重要变量，另外英国脱欧进程、恐怖袭击增多等因素仍会加大市场波动，整体而言不确定性因素仍然存在。

综上判断，预估 2016 年下半年仍将维持振荡态势。一方面，前期大跌释放风险之后，市场预期较低、估值尚可，而且出现超预期下跌的风险较小；另一方面，高额信贷支持下的景气复苏的可持续性、美元加息节奏、人民币汇率走势等仍存在较大不确定性。本基金计划在 2016 年下半年采取谨慎乐观的操作思路，维持中性略高仓位，持续重视结构调整，并在契约规定的范围内进一步优化大盘价值与大盘成长之间的配置，持续挖掘低估值蓝筹个股及能够穿越周期的优质成长股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

(二)、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

(三)、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性 & 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

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于 2016 年 1 月 8 日发布了分红公告，本次分红为 2015 年度的第 1 次分红。本基金向 2016 年 1 月 13 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 1.88 元，利润分配合计为人民币 11,330,676.83 元，其中现金形式发放总额为人民币 6,802,057.95 元，再投资形式发放总额为人民币 4,528,618.88 元。

#### 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”）在对华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金（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：华宝兴业大盘精选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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	25,295,814.70	32,580,979.38
结算备付金		504,393.67	1,170,229.44
存出保证金		70,105.94	170,831.07
交易性金融资产	6.4.7.2	82,463,161.72	110,202,255.22
其中：股票投资		82,463,161.72	110,137,455.22
基金投资		-	-
债券投资		-	64,800.00
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		13,270.19	1,302,717.24
应收利息	6.4.7.5	4,808.23	6,548.01
应收股利		-	-
应收申购款		11,074.33	236,861.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		108,362,628.78	145,670,421.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<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		-	5,562,878.23
应付赎回款		364,166.56	87,239.73
应付管理人报酬		129,002.87	176,875.76
应付托管费		21,500.47	29,479.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,340,644.73	1,988,829.19
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	264,617.36	320,148.87
负债合计		2,119,931.99	8,165,451.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	61,480,227.48	60,069,045.59
未分配利润	6.4.7.10	44,762,469.31	77,435,924.76
所有者权益合计		106,242,696.79	137,504,970.35
负债和所有者权益总计		108,362,628.78	145,670,421.42

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7281 元，基金份额总额 61,480,227.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选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
<b>一、收入</b>		-20,305,224.93	108,890,352.43
1.利息收入		80,904.51	171,767.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,664.08	157,940.32
债券利息收入		12.78	21.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,227.65	13,805.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,010,587.33	141,067,942.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-17,394,200.50	139,949,534.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,120.56	-
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	374,492.61	1,118,408.41

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,384,326.22	-32,506,460.81
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	8,784.11	157,103.12
<b>减：二、费用</b>		1,906,428.44	6,185,635.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	788,164.35	2,111,443.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,360.75	351,907.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	891,009.94	3,540,761.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	95,893.40	181,524.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-22,211,653.37	102,704,716.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-22,211,653.37	102,704,716.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选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）	60,069,045.59	77,435,924.76	137,504,970.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,211,653.37	-22,211,653.37
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）	1,411,181.89	868,874.75	2,280,056.64
其中：1.基金申购款	7,825,508.81	5,342,735.02	13,168,243.83
2.基金赎回款	-6,414,326.92	-4,473,860.27	-10,888,187.19
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）	-	-11,330,676.83	-11,330,676.83

五、期末所有者权益(基金净值)	61,480,227.48	44,762,469.31	106,242,696.79
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)	152,529,167.37	111,188,091.70	263,717,259.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	102,704,716.55	102,704,716.55
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)	-80,430,632.11	-118,589,154.02	-199,019,786.13
其中：1.基金申购款	47,809,723.90	54,377,927.66	102,187,651.56
2.基金赎回款	-128,240,356.01	-172,967,081.68	-301,207,437.69
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)	72,098,535.26	95,303,654.23	167,402,189.49

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业大盘精选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[2008]第956号《关于核准华宝兴业大盘精选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《华宝兴业大盘精选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489,953,207.92元,业经安永华明会计师事务所有限公司安永明(2008)验字第60469025\_B01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业大盘精选股票型证

券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 490,050,880.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 97,672.19 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 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》，华宝兴业大盘精选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大盘精选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《华宝兴业大盘精选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具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%，债券及现金投资比例为基金资产净值的 5%-40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：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（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》、《华宝兴业大盘精选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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 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，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，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	25,295,814.70
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	25,295,814.70

#### 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	81,234,939.75	82,463,161.72	1,228,221.97
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	81,234,939.75	82,463,161.72	1,228,221.97

#### 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	4,549.38
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	227.13
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.12
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	31.60
合计	4,808.23

#### 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	1,340,644.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,340,644.73

#### 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	953.52
预提费用	263,663.84
预提审计费用	-
预提信息披露费	-
合计	264,617.36

#### 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	60,069,045.59	60,069,045.59
本期申购	7,825,508.81	7,825,508.81

本期赎回(以“-”号填列)	-6,414,326.92	-6,414,326.92
本期末	61,480,227.48	61,480,227.48

注：申购含转换入份额；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	80,076,587.16	-2,640,662.40	77,435,924.76
本期利润	-18,827,327.15	-3,384,326.22	-22,211,653.37
本期基金份额交易产生的变动数	1,802,461.22	-933,586.47	868,874.75
其中：基金申购款	8,107,868.74	-2,765,133.72	5,342,735.02
基金赎回款	-6,305,407.52	1,831,547.25	-4,473,860.27
本期已分配利润	-11,330,676.83	-	-11,330,676.83
本期末	51,721,044.40	-6,958,575.09	44,762,469.31

#### 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	70,603.03
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	4,270.52
其他	790.53
合计	75,664.08

#### 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	298,390,978.04
减：卖出股票成本总额	315,785,178.54
买卖股票差价收入	-17,394,200.50

#### 6.4.7.13 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	73,943.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	64,800.00
减：应收利息总额	22.72
买卖债券差价收入	9,120.56

#### 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

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

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	374,492.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	374,492.61

#### 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	-3,384,326.22
——股票投资	-3,384,326.22
——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	-3,384,326.22

### 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	7,011.02
转换费收入	1,773.09
其他	-
合计	8,784.11

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

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

### 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	891,009.94
银行间市场交易费用	-
合计	891,009.94

### 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	53,828.58
银行汇划费用	3,229.56
债券帐户维护费	9,000.00
合计	95,893.40

## 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

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。

#### 6.4.10.1 关联方报酬

##### 6.4.10.1.1 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	788,164.35	2,111,443.13
其中：支付销售机构的客户维护费	139,802.05	320,122.50

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.1.2 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	131,360.75	351,907.25

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 6.4.10.2 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。

### 6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用自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1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	207,455.83	266,740.28
期间申购/买入总份额	-	-
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	207,455.83	266,740.28
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.34%	0.37%

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。

#### 6.4.10.3.2 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。

### 6.4.10.4 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



中国银行	25,295,814.70	70,603.03	29,844,356.67	139,458.83
------	---------------	-----------	---------------	------------

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。

#### 6.4.10.5 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。

#### 6.4.10.6 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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2016 年 1 月 13 日	2016 年 1 月 13 日	1.8800	6,802,057.95	4,528,618.88	11,330,676.83	
合计	-	-	1.8800	6,802,057.95	4,528,618.88	11,330,676.83	

#### 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
600576	万家文化	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	22.35	2016 年 8 月 22 日	21.86	100,900	2,183,721.00	2,255,115.00	-
000802	北京文化	2016 年 6 月 1 日	重大事项停牌	23.52	-	-	44,300	1,037,798.50	1,041,936.00	-
002452	长高集团	2016 年 6 月 14 日	重大事项停牌	12.02	2016 年 7 月 12 日	10.82	84,401	1,037,908.21	1,014,500.02	-
002127	南极电商	2016 年 5 月 16 日	重大事项停牌	9.63	-	-	67,252	597,685.42	647,636.76	-

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**

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，  
高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金  
在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。  
本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对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“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制  
委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业  
务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的  
控制制度。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况  
履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行  
监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察  
稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失  
控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。  
第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自  
控和互控；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的  
监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监  
督、控制，并对风险管理部和监察稽核部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是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，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，本基金未持有债券投资（2015 年 12 月 31 日：本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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	25,295,814.70	-	-	-	25,295,814.70
结算备付金	504,393.67	-	-	-	504,393.67
存出保证金	70,105.94	-	-	-	70,105.94
交易性金融资产	-	-	-	82,463,161.72	82,463,161.72
应收证券清算款	-	-	-	13,270.19	13,270.19
应收利息	-	-	-	4,808.23	4,808.23
应收申购款	-	-	-	11,074.33	11,074.33
资产总计	25,870,314.31	-	-	82,492,314.47	108,362,628.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	364,166.56	364,166.56
应付管理人报酬	-	-	-	129,002.87	129,002.87
应付托管费	-	-	-	21,500.47	21,500.47
应付交易费用	-	-	-	1,340,644.73	1,340,644.73
其他负债	-	-	-	264,617.36	264,617.36
负债总计	-	-	-	2,119,931.99	2,119,931.99
利率敏感度缺口	25,870,314.31	-	-	80,372,382.48	106,242,696.79
上年度末 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	32,580,979.38	-	-	-	32,580,979.38
结算备付金	1,170,229.44	-	-	-	1,170,229.44
存出保证金	170,831.07	-	-	-	170,831.07
交易性金融资产	-	-	64,800.00	110,137,455.22	110,202,255.22
应收证券清算款	-	-	-	1,302,717.24	1,302,717.24
应收利息	-	-	-	6,548.01	6,548.01
应收申购款	-	-	-	236,861.06	236,861.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	33,922,039.89	-	64,800.00	111,683,581.53	145,670,421.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,562,878.23	5,562,878.23
应付赎回款	-	-	-	87,239.73	87,239.73
应付管理人报酬	-	-	-	176,875.76	176,875.76
应付托管费	-	-	-	29,479.29	29,479.29

应付交易费用	-	-	-	1,988,829.19	1,988,829.19
其他负债	-	-	-	320,148.87	320,148.87
负债总计	-	-	-	8,165,451.07	8,165,451.07
利率敏感度缺口	33,922,039.89	-	64,800.00	103,518,130.46	137,504,970.35

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，本基金未持有的交易性债券投资 (2015 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.05%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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投资比例为基金总资产的 60%-95%，债券及现金投资比例为基金资产的 5%-40%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 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，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	82,463,161.72	77.62	110,137,455.22	80.10
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	82,463,161.72	77.62	110,137,455.22	80.10

### 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%	6,886,842.31	7,981,526.19
2. 业绩比较基准下降 5%	-6,886,842.31	-7,981,526.19	

### 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 77,503,973.94 元，属于第二层次的余额为 4,959,187.78 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 88,908,004.84 元，第二层次 21,294,250.38 元，无第三层次)。

(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	82,463,161.72	76.10
	其中：股票	82,463,161.72	76.10
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	25,800,208.37	23.81
7	其他各项资产	99,258.69	0.09
8	合计	108,362,628.78	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	3,157,805.70	2.97
B	采矿业	642,928.00	0.61
C	制造业	62,855,978.31	59.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,376,111.26	2.24
F	批发和零售业	4,238,972.40	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	1,108,870.18	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,247,248.00	3.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	647,636.76	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	4,187,611.11	3.94
S	综合	-	-
	合计	82,463,161.72	77.62

## 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	600271	航天信息	172,754	4,111,545.20	3.87
2	002583	海能达	325,400	3,917,816.00	3.69
3	600584	长电科技	169,509	3,439,337.61	3.24
4	002299	圣农发展	121,923	3,157,805.70	2.97
5	002436	兴森科技	138,500	3,156,415.00	2.97
6	002665	首航节能	359,100	2,833,299.00	2.67
7	000050	深天马 A	125,700	2,623,359.00	2.47
8	002048	宁波华翔	105,700	2,417,359.00	2.28
9	002325	洪涛股份	258,554	2,376,111.26	2.24
10	002156	通富微电	164,300	2,316,630.00	2.18
11	300375	鹏翎股份	83,900	2,267,817.00	2.13
12	601799	星宇股份	49,300	2,258,926.00	2.13
13	600576	万家文化	100,900	2,255,115.00	2.12
14	002410	广联达	156,600	2,239,380.00	2.11
15	600006	东风汽车	252,400	2,238,788.00	2.11
16	002456	欧菲光	74,900	2,209,550.00	2.08
17	002185	华天科技	173,000	2,202,290.00	2.07
18	000063	中兴通讯	152,100	2,181,114.00	2.05
19	002612	朗姿股份	86,655	2,160,309.15	2.03
20	300219	鸿利光电	136,300	2,123,554.00	2.00
21	600703	三安光电	106,000	2,116,820.00	1.99
22	600160	巨化股份	198,800	2,113,244.00	1.99
23	600855	航天长峰	67,300	2,106,490.00	1.98
24	300144	宋城演艺	80,921	2,015,742.11	1.90
25	000028	国药一致	30,474	1,983,857.40	1.87
26	600741	华域汽车	139,210	1,950,332.10	1.84
27	300390	天华超净	69,700	1,203,022.00	1.13
28	600699	均胜电子	31,400	1,202,620.00	1.13
29	002643	万润股份	22,532	1,146,428.16	1.08
30	002624	完美环球	29,932	1,129,933.00	1.06

31	002245	澳洋顺昌	86,834	1,108,870.18	1.04
32	603020	爱普股份	47,200	1,080,408.00	1.02
33	600552	凯盛科技	52,445	1,061,486.80	1.00
34	000969	安泰科技	75,500	1,059,265.00	1.00
35	002534	杭锅股份	99,450	1,059,142.50	1.00
36	002488	金固股份	50,300	1,057,306.00	1.00
37	600885	宏发股份	34,200	1,050,282.00	0.99
38	000802	北京文化	44,300	1,041,936.00	0.98
39	002452	长高集团	84,401	1,014,500.02	0.95
40	002268	卫士通	28,200	1,007,868.00	0.95
41	002341	新纶科技	32,359	696,689.27	0.66
42	002127	南极电商	67,252	647,636.76	0.61
43	600489	中金黄金	57,200	642,928.00	0.61
44	002235	安妮股份	26,350	479,833.50	0.45

## 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	300144	宋城演艺	5,543,250.57	4.03
2	300058	蓝色光标	5,276,388.79	3.84
3	000937	冀中能源	4,683,365.14	3.41
4	002488	金固股份	4,555,508.45	3.31
5	002042	华孚色纺	4,467,180.25	3.25
6	600958	东方证券	4,254,717.00	3.09
7	300322	硕贝德	4,236,027.93	3.08
8	002241	歌尔股份	4,159,875.52	3.03
9	002456	欧菲光	4,117,190.00	2.99
10	002458	益生股份	4,103,387.68	2.98
11	002624	完美环球	3,634,320.01	2.64
12	601898	中煤能源	3,594,735.00	2.61
13	002245	澳洋顺昌	3,482,156.00	2.53
14	300207	欣旺达	3,357,115.00	2.44
15	300136	信维通信	3,273,595.00	2.38
16	601699	潞安环能	3,257,714.00	2.37

17	002436	兴森科技	3,172,906.70	2.31
18	601021	春秋航空	3,159,448.00	2.30
19	300390	天华超净	3,122,657.00	2.27
20	300494	盛天网络	3,098,149.08	2.25
21	002280	联络互动	3,066,832.00	2.23
22	002583	海能达	3,065,702.40	2.23
23	600369	西南证券	3,042,583.50	2.21
24	002024	苏宁云商	2,980,727.00	2.17
25	002236	大华股份	2,821,356.00	2.05
26	002146	荣盛发展	2,778,161.00	2.02
27	002643	万润股份	2,768,882.78	2.01

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	002241	歌尔股份	7,900,202.88	5.75
2	002236	大华股份	6,292,165.54	4.58
3	300058	蓝色光标	6,154,073.55	4.48
4	002488	金固股份	6,006,957.77	4.37
5	002594	比亚迪	4,269,060.68	3.10
6	000937	冀中能源	4,246,063.69	3.09
7	002458	益生股份	4,211,514.08	3.06
8	600958	东方证券	4,175,726.17	3.04
9	002746	仙坛股份	4,127,369.18	3.00
10	002042	华孚色纺	4,098,599.30	2.98
11	002146	荣盛发展	4,027,133.02	2.93
12	300144	宋城演艺	3,949,822.26	2.87
13	002299	圣农发展	3,887,455.62	2.83
14	300322	硕贝德	3,856,343.41	2.80
15	002280	联络互动	3,685,695.02	2.68
16	300494	盛天网络	3,611,918.48	2.63
17	002273	水晶光电	3,481,620.50	2.53
18	300295	三六五网	3,338,907.06	2.43
19	300136	信维通信	3,304,570.20	2.40
20	601021	春秋航空	3,140,180.26	2.28

21	002462	嘉事堂	3,102,250.47	2.26
22	601898	中煤能源	3,100,486.16	2.25
23	300207	欣旺达	3,081,251.88	2.24
24	600369	西南证券	3,060,541.00	2.23
25	002026	山东威达	3,002,337.90	2.18
26	002024	苏宁云商	2,954,257.66	2.15
27	002467	二六三	2,933,733.33	2.13
28	000802	北京文化	2,926,180.24	2.13
29	300178	腾邦国际	2,911,969.45	2.12
30	002044	美年健康	2,778,147.07	2.02

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	291,495,211.26
卖出股票收入（成交）总额	298,390,978.04

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.5 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

首航节能于 2016 年 1 月 5 日收到北京证监局《关于对北京首航艾启威节能技术股份有限公司采取监管谈话行政监管措施的决定书》，因公司在财务核算、信息披露、内部控制等方面存在问题，予以监管谈话；于 2016 年 2 月 25 日收到深圳证券交易所中小板管理部出具的监管关注函（中小板关注函【2016】第 34 号），因公司在利润分配预案的具体理由、合理性，利润分配预案与公司业绩匹配的具体理由等方面披露不全，给予关注。

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，因此本基金管理人对上述股票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九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。

### 7.12.2

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	70,105.94
2	应收证券清算款	13,270.19
3	应收股利	-
4	应收利息	4,808.23

5	应收申购款	11,074.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,258.69

### 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
6,881	8,934.78	318,992.99	0.52%	61,161,234.49	99.48%

### 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	119,667.56	0.1946%

### 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	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年10月7日）基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	60,069,045.59
本报告期基金总申购份额	7,825,508.81
减：本报告期基金总赎回份额	6,414,326.92
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	61,480,227.48

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

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	
广发证券	2	116,478,180.71	19.75%	106,146.52	19.65%	-
中泰证券	1	109,810,103.58	18.62%	102,265.78	18.93%	-
国金证券	2	92,975,586.98	15.76%	84,870.14	15.71%	-
华创证券	2	53,438,190.84	9.06%	48,698.49	9.01%	-
海通证券	1	52,822,193.89	8.95%	48,136.86	8.91%	-
兴业证券	2	45,483,713.93	7.71%	41,449.41	7.67%	-
安信证券	1	44,824,678.39	7.60%	40,848.72	7.56%	-
光大证券	1	33,689,234.98	5.71%	30,700.96	5.68%	-
长江证券	1	16,221,625.70	2.75%	15,107.29	2.80%	-
招商证券	1	10,069,376.87	1.71%	9,176.34	1.70%	-
国海证券	2	9,252,285.22	1.57%	8,431.65	1.56%	-
中信金通	1	2,577,244.94	0.44%	2,400.18	0.44%	-
浙商证券	2	1,713,330.27	0.29%	1,561.32	0.29%	-
国泰君安	1	530,443.00	0.09%	493.99	0.09%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
国信证券	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：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、本基金本报告期新增券商交易单元信息如下：

浙商证券

**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
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	73,943.28	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

## 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

	告	人网站	
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	华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金第二次分红公告	上证报、中证报、证券时报及基金管理人网站	2016 年 1 月 8 日
10	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
11	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
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
13	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、证券时报及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
14	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
15	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；  
华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金合同；  
华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝兴业大盘精选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