

# 华宝兴业品质生活股票型证券投资基金 2015 年半年度报告（摘要）

2015 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：2015 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2015 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。  
本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 21 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

## § 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	409,859,559.04 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

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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(2015年1月21日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	331,097,266.72
本期利润	318,819,905.55
加权平均基金份额本期利润	0.2769
本期加权平均净值利润率	25.08%
本期基金份额净值增长率	18.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	59,620,175.93
期末可供分配基金份额利润	0.1455
期末基金资产净值	469,479,734.97
期末基金份额净值	1.145
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.62%

注：1、本基金成立于 2015 年 1 月 21 日。

2、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。

3、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。

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）。

5、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

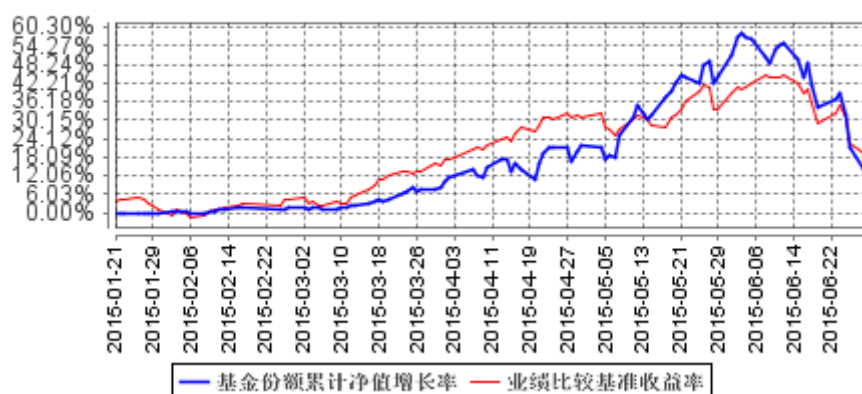
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-17.57%	3.80%	-5.84%	2.80%	-11.73%	1.00%
过去三个月	9.33%	3.07%	8.86%	2.09%	0.47%	0.98%
自基金合同生效日起至 今	18.62%	2.35%	25.69%	1.76%	-7.07%	0.59%

#### 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 2015 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：1、本基金基金合同生效于 2015 年 1 月 21 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2015 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 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业活期货币市场基金、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、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证 1000 分级基金和华宝兴业万物互联基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 110,943,781,389.61 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	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业宝康消费品基金基金经理、华宝兴业宝康配置混合基金经理	2015 年 1 月 21 日	-	10 年	硕士，拥有 CFA 资格。2005 年 2 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 月起兼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

					资基金基金经理。2015 年 3 月起任助理投资总监。
光磊	本基金基金经理	2015 年 4 月 9 日	-	8 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场整体行情先扬后抑，1-5 月市场上涨较多，6 月出现了较大幅度调整。总体看，以 TMT 为代表的新兴产业涨幅较好。

本基金在本报告期内逐步提升了仓位，配置了一些互联网相关的新兴消费行业。后期在市场调整的过程中也适度做了结构调整，增配了汽车、食品饮料、商业等传统消费领域的公司。

### 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 18.62%，同期业绩比较基准增长率为 25.69%，基金表现落后比较基准 7.07%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计中国经济依然处于探底过程，但央行总体处于降息降准的周期中，整体流动性还比较充裕，因此市场上仍存在投资机会。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；（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、文化演艺等产品或服务快速发展。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及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最



终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 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 2015 年 5 月 28 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 2015 年 6 月 1 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 0.5 元，利润分配合计为人民币 25,919,600.83 元，其中现金形式发放总额为人民币 22,992,987.45 元，再投资形式发放总额为人民币 2,926,613.38 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款		102,676,079.79
结算备付金		6,352,357.86
存出保证金		338,999.62
交易性金融资产		405,280,944.09
其中：股票投资		404,762,187.39
基金投资		-
债券投资		518,756.70
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		5,850,335.96
应收利息		20,293.72
应收股利		-
应收申购款		252,486.34
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		520,771,497.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,003,033.48
应付赎回款		44,183,987.64
应付管理人报酬		817,296.71
应付托管费		136,216.12
应付销售服务费		-
应付交易费用		4,848,874.06
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		302,354.40
负债合计		51,291,762.41
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		409,859,559.04
未分配利润		59,620,175.93
所有者权益合计		469,479,734.97
负债和所有者权益总计		520,771,497.38

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.145 元，基金份额总额 409,859,559.04 份。

2、本基金成立于 2015 年 1 月 21 日，因此无上年度末数据。

## 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：2015 年 1 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 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>		337,198,023.86
1.利息收入		7,998,270.07
其中：存款利息收入		2,739,973.93
债券利息收入		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）		334,893,470.54
其中：股票投资收益		333,300,223.28
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		1,593,247.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-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）		6,583,644.42
<b>减：二、费用</b>		18,378,118.31

1. 管理人报酬		8,415,376.10
2. 托管费		1,402,562.71
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		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		229,221.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>318,819,905.55</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>318,819,905.55</b>

注：本基金成立于 2015 年 1 月 21 日，因此无上年度可比期间数据。

### 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：2015 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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

注：本基金成立于 2015 年 1 月 21 日，因此无上年度可比期间数据。

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>黄小慧</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》、《华宝兴业品质生活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 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 1 月 21 日（基金合同生效日）起至 2015 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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



经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（3）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由

中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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), 按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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

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), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期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。

### 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》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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.1 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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 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	8,415,376.10

其中：支付销售机构的客户维护费	4,101,114.80
-----------------	--------------

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	1,402,562.71

注：支付基金托管人中国银行的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。

#### 6.4.8.3 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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2015年1月21日(基金合同生效日)至2015年6月30日
基金合同生效月持有的基金份额	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	322,758.94
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0800%

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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015 年 1 月 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
中国银行	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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 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。

#### 6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
601021	春秋航空	2015年6月26日	重大事项停牌	126.09	2015年7月21日	113.48	108,968	9,208,567.30	13,739,775.12	-
601111	中国国航	2015年6月30日	重大事项停牌	15.36	2015年7月29日	13.78	409,700	6,051,667.00	6,292,992.00	-
'002557	洽洽食品	2015年6月29日	重大事项停牌	16.38	2015年8月24日	14.74	332,501	7,153,220.87	5,446,366.38	-
300028	金亚科技	2015年6月10日	重大事项停牌	34.51	-	-	37,180	1,615,757.00	1,283,081.80	-
300012	华测检测	2015年6月15日	重大事项停牌	30.80	2015年7月27日	38.76	509,250	16,967,061.00	15,684,900.00	-
300047	天源迪科	2015年6月3日	重大事项停牌	23.99	2015年7月30日	32.29	699,800	14,676,664.81	16,788,202.00	-
300113	顺网	2015	重大	53.60	2015	51.93	198,300	12,509,725.50	10,628,880.00	-

	科技	2015年5月5日	事项停牌		2015年8月6日					
300144	宋城演艺	2015年6月18日	重大事项停牌	56.66	2015年7月20日	68.82	50,000	2,990,169.66	2,833,000.00	-
300155	安居宝	2015年6月15日	重大事项停牌	40.15	2015年7月20日	32.54	73,802	3,884,747.02	2,963,150.30	-
300188	美亚柏科	2015年5月14日	重大事项停牌	29.91	2015年8月21日	33.44	379,800	10,662,341.63	11,359,818.00	-
300418	昆仑万维	2015年5月5日	重大事项停牌	144.78	2015年8月6日	140.09	54,200	7,179,226.71	7,847,076.00	-
600869	智慧能源	2015年5月11日	重大事项停牌	32.06	2015年7月31日	26.23	442,800	10,787,508.59	14,196,168.00	-

注：本基金截至 2015 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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 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。

#### 6.4.9.3.2 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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 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 296,217,534.49 元，属于第二层次的余额为 109,063,409.60 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，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不含权固定收益品种（可转换债券、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。

## § 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	404,762,187.39	77.72
	其中：股票	404,762,187.39	77.72
2	固定收益投资	518,756.70	0.10
	其中：债券	518,756.70	0.10
	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	109,028,437.65	20.94
7	其他各项资产	6,462,115.64	1.24
8	合计	520,771,497.38	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	6,047,818.60	1.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	199,413,616.63	42.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,277,078.52	0.91
E	建筑业	5,762,684.37	1.23
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	33,706,183.12	7.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,821,274.20	14.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,240,335.00	2.18
L	租赁和商务服务业	45,977,839.91	9.79
M	科学研究和技术服务业	15,684,900.00	3.34
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	13,997,457.04	2.98
R	文化、体育和娱乐业	2,833,000.00	0.60
S	综合	-	-
	合计	404,762,187.39	86.22

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600559	老白干酒	298,460	24,927,379.20	5.31



2	600686	金龙汽车	913,302	23,508,393.48	5.01
3	300058	蓝色光标	1,282,792	20,280,941.52	4.32
4	002568	百润股份	141,620	18,627,278.60	3.97
5	300047	天源迪科	699,800	16,788,202.00	3.58
6	300012	华测检测	509,250	15,684,900.00	3.34
7	300274	阳光电源	503,245	15,384,199.65	3.28
8	002400	省广股份	593,238	14,985,191.88	3.19
9	600519	贵州茅台	56,600	14,582,990.00	3.11
10	000858	五粮液	459,700	14,572,490.00	3.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.fsfund.com](http://www.fsfund.com) 的半年度报告正文。

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600559	老白干酒	90,202,355.82	19.21
2	002400	省广股份	69,028,129.34	14.70
3	600686	金龙汽车	66,804,092.48	14.23
4	300058	蓝色光标	66,003,587.08	14.06
5	300244	迪安诊断	64,525,764.44	13.74
6	002090	金智科技	57,197,467.42	12.18
7	000858	五粮液	56,603,724.99	12.06
8	600887	伊利股份	53,869,760.74	11.47
9	601166	兴业银行	53,521,609.51	11.40
10	300178	腾邦国际	45,821,621.84	9.76
11	002594	比亚迪	44,837,947.39	9.55
12	002216	三全食品	43,841,405.45	9.34
13	600519	贵州茅台	42,336,568.65	9.02
14	002589	瑞康医药	41,791,305.16	8.90
15	002657	中科金财	37,004,552.11	7.88
16	300144	宋城演艺	36,156,114.84	7.70
17	300033	同花顺	34,930,182.78	7.44
18	600571	信雅达	33,377,022.46	7.11
19	601318	中国平安	33,366,575.95	7.11

20	002462	嘉事堂	32,685,588.83	6.96
21	300347	泰格医药	32,091,797.69	6.84
22	600446	金证股份	31,788,778.34	6.77
23	600271	航天信息	28,098,857.80	5.99
24	002695	煌上煌	27,238,955.63	5.80
25	002215	诺普信	27,039,433.43	5.76
26	603368	柳州医药	25,747,762.30	5.48
27	300043	互动娱乐	25,056,866.20	5.34
28	600872	中炬高新	25,039,264.07	5.33
29	002157	正邦科技	24,896,449.06	5.30
30	601021	春秋航空	24,456,348.44	5.21
31	600138	中青旅	24,423,749.91	5.20
32	300231	银信科技	22,724,602.58	4.84
33	300207	欣旺达	22,447,416.30	4.78
34	002236	大华股份	22,034,471.97	4.69
35	002557	洽洽食品	21,974,582.95	4.68
36	300088	长信科技	21,118,107.62	4.50
37	300017	网宿科技	20,913,960.76	4.45
38	600153	建发股份	20,032,032.67	4.27
39	600699	均胜电子	19,942,284.99	4.25
40	002539	新都化工	19,754,057.72	4.21
41	300392	腾信股份	19,704,092.71	4.20
42	300009	安科生物	19,462,539.55	4.15
43	600196	复星医药	19,296,277.69	4.11
44	300274	阳光电源	18,285,285.47	3.89
45	002085	万丰奥威	18,103,966.22	3.86
46	000848	承德露露	17,062,937.08	3.63
47	300271	华宇软件	16,991,442.20	3.62
48	300012	华测检测	16,967,061.00	3.61
49	000802	北京文化	16,724,397.08	3.56
50	600587	新华医疗	16,640,046.00	3.54
51	002517	泰亚股份	16,585,813.30	3.53
52	002568	百润股份	16,578,772.00	3.53
53	002234	民和股份	16,436,935.25	3.50
54	300188	美亚柏科	16,277,055.50	3.47
55	002701	奥瑞金	16,138,750.73	3.44

56	300170	汉得信息	15,731,141.18	3.35
57	002351	漫步者	15,626,214.44	3.33
58	300356	光一科技	15,591,341.90	3.32
59	000049	德赛电池	15,206,688.10	3.24
60	600958	东方证券	15,100,592.00	3.22
61	601788	光大证券	15,088,657.00	3.21
62	300378	鼎捷软件	15,066,265.90	3.21
63	600869	智慧能源	14,953,958.59	3.19
64	002665	首航节能	14,875,796.68	3.17
65	002563	森马服饰	14,705,411.39	3.13
66	300047	天源迪科	14,676,664.81	3.13
67	300183	东软载波	14,617,334.13	3.11
68	002117	东港股份	14,594,213.95	3.11
69	002260	德奥通航	14,570,077.69	3.10
70	300133	华策影视	14,558,518.31	3.10
71	600687	刚泰控股	14,391,901.15	3.07
72	300253	卫宁软件	14,384,504.11	3.06
73	300205	天喻信息	13,959,590.62	2.97
74	300291	华录百纳	13,946,468.57	2.97
75	002009	天奇股份	13,905,745.23	2.96
76	300130	新国都	13,885,288.00	2.96
77	002251	步步高	13,751,905.50	2.93
78	002661	克明面业	13,312,111.82	2.84
79	000963	华东医药	13,136,433.36	2.80
80	300063	天龙集团	13,058,796.00	2.78
81	300113	顺网科技	12,509,725.50	2.66
82	300418	昆仑万维	12,477,549.00	2.66
83	002339	积成电子	12,377,773.00	2.64
84	600570	恒生电子	12,162,021.70	2.59
85	000957	中通客车	12,157,255.86	2.59
86	002538	司尔特	12,078,947.49	2.57
87	300273	和佳股份	12,053,238.88	2.57
88	600029	南方航空	12,046,208.00	2.57
89	002654	万润科技	11,899,705.26	2.53
90	000861	海印股份	11,707,273.00	2.49
91	600513	联环药业	11,464,254.77	2.44

92	002350	北京科锐	11,416,839.92	2.43
93	002098	浔兴股份	11,397,269.03	2.43
94	002284	亚太股份	11,338,919.75	2.42
95	002488	金固股份	11,015,657.00	2.35
96	600074	保千里	10,934,287.98	2.33
97	002477	雏鹰农牧	10,891,074.25	2.32
98	601607	上海医药	10,746,655.76	2.29
99	600340	华夏幸福	10,606,064.03	2.26
100	300137	先河环保	10,594,670.00	2.26
101	002299	圣农发展	10,093,118.00	2.15
102	603128	华贸物流	10,050,635.12	2.14
103	002363	隆基机械	9,906,380.68	2.11
104	002518	科士达	9,734,539.90	2.07
105	603899	晨光文具	9,665,640.00	2.06

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300244	迪安诊断	120,932,992.02	25.76
2	600559	老白干酒	70,485,839.36	15.01
3	002589	瑞康医药	69,902,450.35	14.89
4	002400	省广股份	68,427,468.50	14.58
5	002090	金智科技	67,703,852.22	14.42
6	601166	兴业银行	57,394,736.52	12.23
7	002216	三全食品	56,063,033.55	11.94
8	300178	腾邦国际	50,919,628.28	10.85
9	002594	比亚迪	48,413,704.23	10.31
10	300058	蓝色光标	48,264,888.36	10.28
11	600887	伊利股份	47,494,507.29	10.12
12	000858	五粮液	42,883,060.70	9.13
13	600686	金龙汽车	42,679,702.94	9.09
14	300033	同花顺	41,868,800.49	8.92
15	300144	宋城演艺	40,522,254.52	8.63
16	600571	信雅达	40,400,494.17	8.61
17	002462	嘉事堂	39,869,579.16	8.49

18	002157	正邦科技	34,482,918.18	7.34
19	601318	中国平安	33,102,178.53	7.05
20	600446	金证股份	31,666,637.80	6.75
21	300347	泰格医药	31,512,357.52	6.71
22	600699	均胜电子	30,434,908.69	6.48
23	002657	中科金财	29,907,831.24	6.37
24	600519	贵州茅台	29,004,739.42	6.18
25	002695	煌上煌	27,385,183.36	5.83
26	002215	诺普信	27,316,235.33	5.82
27	300043	互动娱乐	26,691,087.58	5.69
28	600138	中青旅	25,530,668.65	5.44
29	603368	柳州医药	25,453,078.48	5.42
30	300207	欣旺达	24,785,619.41	5.28
31	300231	银信科技	24,621,699.58	5.24
32	601021	春秋航空	24,056,304.89	5.12
33	002236	大华股份	23,508,162.45	5.01
34	300392	腾信股份	23,131,642.62	4.93
35	600153	建发股份	23,117,211.10	4.92
36	600872	中炬高新	22,815,577.55	4.86
37	300009	安科生物	22,340,292.34	4.76
38	600587	新华医疗	22,259,512.87	4.74
39	002085	万丰奥威	21,230,013.24	4.52
40	002488	金固股份	20,728,069.01	4.42
41	002117	东港股份	20,414,771.33	4.35
42	300088	长信科技	20,312,298.57	4.33
43	002665	首航节能	19,821,624.44	4.22
44	600196	复星医药	19,543,171.64	4.16
45	600687	刚泰控股	19,537,332.98	4.16
46	002654	万润科技	19,328,414.37	4.12
47	300253	卫宁软件	19,243,529.24	4.10
48	600271	航天信息	19,041,351.00	4.06
49	000848	承德露露	18,154,906.01	3.87
50	300356	光一科技	17,937,669.28	3.82
51	300133	华策影视	17,743,107.65	3.78
52	002517	泰亚股份	17,627,705.25	3.75
53	002260	德奥通航	17,545,851.62	3.74
54	300291	华录百纳	17,153,304.78	3.65
55	000802	北京文化	16,895,493.62	3.60

56	300170	汉得信息	16,754,591.34	3.57
57	000049	德赛电池	16,654,281.13	3.55
58	002539	新都化工	16,305,879.32	3.47
59	002009	天奇股份	16,069,960.40	3.42
60	300063	天龙集团	15,530,271.59	3.31
61	002557	洽洽食品	15,489,376.46	3.30
62	000861	海印股份	15,430,860.14	3.29
63	300183	东软载波	15,214,863.00	3.24
64	300017	网宿科技	14,808,521.53	3.15
65	002251	步步高	14,727,131.55	3.14
66	002701	奥瑞金	14,664,888.99	3.12
67	601788	光大证券	14,433,968.00	3.07
68	002098	浔兴股份	14,056,725.94	2.99
69	600958	东方证券	13,839,458.00	2.95
70	300378	鼎捷软件	13,770,486.41	2.93
71	002661	克明面业	13,530,805.69	2.88
72	000963	华东医药	13,288,973.02	2.83
73	601933	永辉超市	12,745,986.71	2.71
74	002351	漫步者	12,736,712.07	2.71
75	300299	富春通信	12,677,002.80	2.70
76	002339	积成电子	12,570,346.38	2.68
77	300205	天喻信息	12,433,434.60	2.65
78	300273	和佳股份	12,412,841.39	2.64
79	002299	圣农发展	12,096,851.40	2.58
80	002477	雏鹰农牧	12,058,258.19	2.57
81	600074	保千里	11,660,651.28	2.48
82	600570	恒生电子	11,492,228.00	2.45
83	600513	联环药业	11,352,776.84	2.42
84	601607	上海医药	11,350,312.00	2.42
85	002563	森马服饰	11,134,213.56	2.37
86	300222	科大智能	10,950,209.00	2.33
87	603128	华贸物流	10,835,676.13	2.31
88	002350	北京科锐	10,483,584.01	2.23
89	002284	亚太股份	9,814,436.24	2.09
90	300130	新国都	9,505,999.76	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	2,828,067,728.91
卖出股票收入（成交）总额	2,744,166,646.93

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	518,756.70	0.11
8	其他	-	-
9	合计	518,756.70	0.11

### 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	110031	航信转债	3,570	518,756.70	0.11

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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**

金龙汽车于 2014 年 9 月 17 日收到中国证券监督管理委员会厦门监管局《关于对厦门金龙汽车集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》，因公司委托理财审批和信息披露不规范，汽车按揭贷款担保不规范，以及无形资产和固定资产信息披露不完整，责令公司进行整改，并提交整改报告同时予以披露。同时，金龙汽车于 2014 年 9 月 26 日收到上海证券交易所《关于对厦门金龙汽车集团股份有限公司和董事会秘书唐祝敏、财务总监乔红军予以监管关注的决定》，因公司 2013 年委托理财事项未经股东大会审议批准，也未及时以单独的委托理财临时公告方式进行披露，决定对厦门金龙汽车集团股份有限公司和董事会秘书唐祝敏、财务总监乔红军予以监管关注。

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	338,999.62
2	应收证券清算款	5,850,335.96
3	应收股利	-
4	应收利息	20,293.72
5	应收申购款	252,486.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,462,115.64

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300047	天源迪科	16,788,202.00	3.58	重大事项
2	300012	华测检测	15,684,900.00	3.34	重大事项

## § 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
6,122	66,948.64	322,938.61	0.08%	409,536,620.43	99.92%

### 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	377,123.02	0.0920%
------------------	------------	---------

### 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	10~50

## § 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	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	244,751,248.10
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,605,295,401.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	409,859,559.04

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

#### 1、基金管理人的重大人事变动

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事

变动已按相关规定备案、公告。

### 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

#### 1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年 11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

#### 2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

#### 3、报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 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	
安信证券	1	183,309,911.32	3.29%	162,211.24	3.26%	-
长江证券	1	29,004,872.01	0.52%	26,405.04	0.53%	-
光大证券	1	103,452,534.38	1.86%	91,544.94	1.84%	-

广发证券	1	200,270,779.39	3.60%	182,327.12	3.67%	-
国海证券	2	534,969,846.86	9.60%	474,232.73	9.54%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	270,733,679.18	4.86%	246,475.15	4.96%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	1,431,386,010.70	25.69%	1,266,634.69	25.47%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	187,467,687.89	3.37%	170,670.45	3.43%	-
申银万国	1	104,923,155.12	1.88%	95,523.05	1.92%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	527,994,649.77	9.48%	480,686.56	9.67%	-
招商证券	1	1,241,914,601.94	22.29%	1,098,969.71	22.10%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	2	526,789,611.17	9.46%	468,600.73	9.42%	-
中信建投	1	127,740,783.06	2.29%	116,294.66	2.34%	-
中信金通	1	100,812,410.78	1.81%	91,779.56	1.85%	-

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：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. 本基金本报告期券商交易单元均为新增。

### 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
安信证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	4,520,000,000.00	65.32%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	400,000,000.00	5.78%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	2,000,000,000.00	28.90%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司  
2015年8月28日