

华宝兴业创新优选股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
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.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末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.....	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业创新优选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业创新股票
基金主代码	000601
交易代码	000601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 14 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	207,958,778.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的企业，在控制风险的前提下为基金持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	<p>(1) 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；</p> <p>(2) 本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对拥有持续创新能力的企业相关股票的深入分析，积极挖掘企业的创新溢价，分享其投资机会；</p> <p>(3) 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；</p> <p>(4) 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。</p>
业绩比较基准	中证 800 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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、 021-38924558	95566
传真	021-38505777	010-66594942
注册地址	上海浦东新区世纪大道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	上海浦东新区世纪大道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	《上海证券报》、《中国证券报》、《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
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东长安街1号东方广场安永大楼16层

§ 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1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	50,917,422.68
本期利润	10,483,463.75
加权平均基金份额本期利润	0.0764
本期加权平均净值利润率	5.54%
本期基金份额净值增长率	66.32%

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	22, 197, 542. 20
期末可供分配基金份额利润	0. 1067
期末基金资产净值	267, 804, 308. 79
期末基金份额净值	1. 288
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	56. 17%

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、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、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、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	-19.50%	4.09%	-6.57%	2.82%	-12.93%	1.27%
过去三个月	26.86%	3.31%	11.65%	2.11%	15.21%	1.20%
过去六个月	66.32%	2.61%	29.74%	1.77%	36.58%	0.84%
过去一年	56.01%	2.05%	85.85%	1.41%	-29.84%	0.64%
自基金合同生效日起至 今	56.17%	1.92%	86.87%	1.34%	-30.70%	0.58%

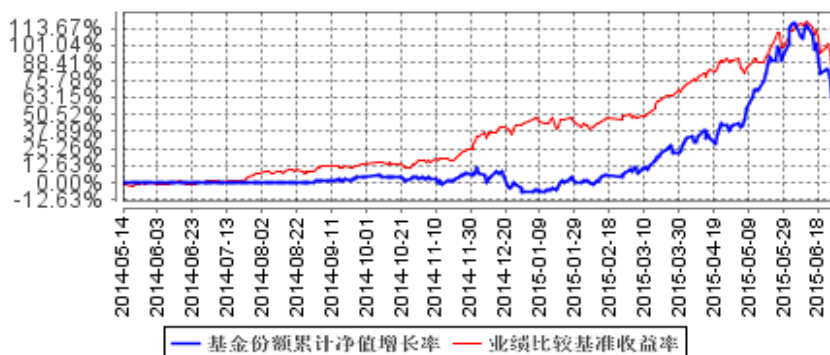
注：1、本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

(2014 年 5 月 14 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：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 2014 年 11 月 14 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（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		

朱亮	本基金基金经理，华宝兴业先进成长股票基金经理、华宝兴业新兴产业股票基金经理	2014年5月14日	2015年5月7日	9年	硕士。曾在倍多科技（中国）有限公司任产品总监，国金证券股份有限公司任研究员。2008年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任研究部高级分析师、基金经理助理的职务。2012年6月至2015年5月任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理，2013年7月至2015年5月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2014年5月至2015年5月兼任华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金经理。
陈乐华	本基金基金经理	2014年10月22日	-	9年	硕士。曾在中信建投证券有限责任公司从事行业研究工作。2010年5月加入华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理助理的职务，2014年10月起任华宝兴业创新优选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、《华宝兴业创新优选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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，创新优选股票型证券投资基金在短期内出现过股票投资占基金资产净值比低于 60%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定

和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

回顾 2015 年上半年，我国国内经济仍在低位运行，增速下滑压力依然比较大。展望下半年，随着政府各项政策的出台，我们预计宏观经济增速有望止跌企稳，但压制经济增长的各项负面因素依然没有完全消除。A 股市场上半年的波动幅度极大，先是经历了一波波澜壮阔的上涨行情，然后在 6 月中旬出现大幅下跌，其下跌速度之快让人瞠目结舌。报告期内，各大指数总体还是上涨格局，其中：上证指数上涨 32.23%，深成指上涨 30.17%，沪深 300 上涨 26.58%，中小板指数上涨 69.06%，创业板上涨 94.23%。板块表现方面，计算机、轻工制造、纺织服装、传媒等行业指数涨幅靠前，涨幅均超过 90%。

报告期间，本基金依然坚持自下而上的选股思路，主要投资于代表中国经济未来发展方向，未来发展前景较好的成长股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 66.32%，基金基准涨幅为 29.74%，基金表现超越基准 36.58%。

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 2015 年下半年，我们认为中国经济依然处在探底过程中，在总需求不足的情况下，传统产业仍需要较长时间的去产能化过程。经历了 6 月份的大幅调整，虽然以中小板和创业板为代表的成长股出现暴跌，泡沫程度有所减轻，短期风险得到释放。很多成长股已经跌到了较为合理的空间，未来依然有上涨空间。

从中长期看，我们正处在以电动车、页岩气、智能手机等代表的席卷全球的技术创新、以移

动互联网代表的商业模式创新，以及中国深化改革带来的制度创新的三曲共奏中，我们坚信在改革和创新推动下的中国经济转型必然会给 A 股带来较多的投资机会。

未来，我们将依然严格恪守投资边界，采取自下而上为主，自上而下为辅的选股策略，寻找从技术创新、商业模式创新和制度创新中受益的成长股，买入并长期持有，以分享这些公司在未来的业绩快速增长过程中带来的丰厚回报。同时，我们将以勤勉尽责的态度，不断优化我们的投资组合，努力给持有人带来较好的中长期投资回报。

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 3.4 元，利润分配合计为人民币 111,186,981.18 元，其中现金形式发放总额为人民币 105,528,375.36 元，再投资形式发放总额为人民币 5,658,605.82 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”）在对华宝兴业创新优选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：华宝兴业创新优选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	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	54,336,014.42	28,789,500.93
结算备付金		3,377,066.70	879,695.33
存出保证金		127,395.64	124,040.57
交易性金融资产	6.4.7.2	234,950,868.52	114,772,302.58
其中：股票投资		234,950,868.52	114,772,302.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		8,686,025.76	-
应收利息	6.4.7.5	13,804.25	4,654.89
应收股利		-	-
应收申购款		683,501.00	353,884.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		302,174,676.29	144,924,078.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		31,954,875.47	2,232,908.89
应付管理人报酬		534,893.16	221,158.27
应付托管费		89,148.87	36,859.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,463,863.79	623,508.83
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	327,586.21	366,427.84
负债合计		34,370,367.50	3,480,863.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	207,958,778.90	150,676,319.00
未分配利润	6.4.7.10	59,845,529.89	-9,233,104.18
所有者权益合计		267,804,308.79	141,443,214.82
负债和所有者权益总计		302,174,676.29	144,924,078.35

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.288 元，基金份额总额 207958778.90 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业创新优选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 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1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年5月14日(基 金合同生效日)至 2014年6月30日

一、收入		14,035,376.31	1,944,938.74
1.利息收入		140,376.13	1,445,011.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	140,376.13	289,612.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,155,399.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		48,884,609.99	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	48,563,542.34	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	321,067.65	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-40,433,958.93	499,927.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,444,349.12	-
减：二、费用		3,551,912.56	1,246,197.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,397,020.49	990,762.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	232,836.80	165,127.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,796,115.33	14,693.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	125,939.94	75,614.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,483,463.75	698,741.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,483,463.75	698,741.59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业创新优选股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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)	150,676,319.00	-9,233,104.18	141,443,214.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,483,463.75	10,483,463.75
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)	57,282,459.90	169,782,151.50	227,064,611.40
其中：1.基金申购款	528,296,470.03	405,094,598.81	933,391,068.84
2.基金赎回款	-471,014,010.13	-235,312,447.31	-706,326,457.44
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)	-	-111,186,981.18	-111,186,981.18
五、期末所有者权益(基金净值)	207,958,778.90	59,845,529.89	267,804,308.79
项目	上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日)至2014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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	698,741.59	698,741.59
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)	512,887,511.92	-	512,887,511.92
其中：1.基金申购款	512,887,511.92	-	512,887,511.92
2.基金赎回款	-	-	-
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)	512,887,511.92	698,741.59	513,586,253.51

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：

黄小薏
基金管理人负责人

向辉
主管会计工作负责人

张幸骏
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业创新优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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]301号文《关于核准华宝兴业创新优选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人于2014年4月8日至2014年5月9日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2014)验字第60737318_B05号后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年5月14日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币512,745,881.61元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币141,630.31元,以上实收基金(本息)合计为人民币512,887,511.92元,折合512,887,511.92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,注册登记机构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。

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、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。本基金的股票投资比例为基金资产的60%-95%,投资于创新主题类上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的80%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;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:中证800指数收益率 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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 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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	54,336,014.42
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	54,336,014.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	280,402,256.85	234,950,868.52	-45,451,388.33
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	280,402,256.85	234,950,868.52	-45,451,388.33

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	12,210.97
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	1,519.56
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	16.42
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	57.30
合计	13,804.25

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,463,863.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,463,863.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18,490.27

预提费用	309,095.94
合计	327,586.21

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	150,676,319.00	150,676,319.00
本期申购	528,296,470.03	528,296,470.03
本期赎回(以“-”号填列)	-471,014,010.13	-471,014,010.13
本期末	207,958,778.90	207,958,778.90

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	5,635,479.62	-14,868,583.80	-9,233,104.18
本期利润	50,917,422.68	-40,433,958.93	10,483,463.75
本期基金份额交易产生的变动数	76,831,621.08	92,950,530.42	169,782,151.50
其中：基金申购款	130,121,053.60	274,973,545.21	405,094,598.81
基金赎回款	-53,289,432.52	-182,023,014.79	-235,312,447.31
本期已分配利润	-111,186,981.18	0.00	-111,186,981.18
本期末	22,197,542.20	37,647,987.69	59,845,529.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
	活期存款利息收入
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	7,651.27
其他	7,856.44
合计	140,376.13

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	559,988,168.62
减：卖出股票成本总额	511,424,626.28
买卖股票差价收入	48,563,542.34

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	321,067.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	321,067.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-40,433,958.93
——股票投资	-40,433,958.93
——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	-40,433,958.93

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,045,671.28
转换费收入	398,677.84
合计	5,444,349.12

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于 30 日的投资人的赎回费全额计入基金资产，对持续持有期少于 3 个月的投资人，应将不低于赎回费总额 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，应将不低于赎回费总额 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,796,115.33
银行间市场交易费用	-
合计	1,796,115.33

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	79,343.16
其他	200.00
银行费用	7,644.00
债券帐户维护费	9,000.00
合计	125,939.94

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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,397,020.49	990,762.81
其中：支付销售机构的客户维护费	504,322.14	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日)至2014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
当期发生的基金应支付的托管费		232,836.80		165,127.15

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本期末及上年度末无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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日)至2014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	54,336,014.42	124,868.42	97,624,022.34	287,789.53

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

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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	2015 年 6 月 1 日	2015 年 6 月 1 日	3.4000	105,528,375.36	5,658,605.82	111,186,981.18	
合计	-	-	3.4000	105,528,375.36	5,658,605.82	111,186,981.18	

6.4.12 期末（2015 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
300392	腾信股份	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	133.74	2015 年 7 月 14 日	147.11	22,400	4,036,966.00	2,995,776.00	-
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	重大事项停牌	16.88	-	-	190,000	3,931,268.00	3,207,200.00	-
002589	瑞康医药	2015 年 5 月 21 日	重大事项停牌	93.85	-	-	12,451	704,378.21	1,168,526.35	-

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。

6.4.12.3 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

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。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，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

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证券外，本基金持有的证券均能及时变现。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。

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 2015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	54,336,014.42	-	-	-	54,336,014.42
结算备付金	3,377,066.70	-	-	-	3,377,066.70
存出保证金	127,395.64	-	-	-	127,395.64
交易性金融资产	-	-	-	234,950,868.52	234,950,868.52
应收证券清算款	-	-	-	8,686,025.76	8,686,025.76
应收利息	-	-	-	13,804.25	13,804.25
应收申购款	28,237.42	-	-	655,263.58	683,501.00
资产总计	57,868,714.18	-	-	244,305,962.11	302,174,676.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,954,875.47	31,954,875.47
应付管理人报酬	-	-	-	534,893.16	534,893.16
应付托管费	-	-	-	89,148.87	89,148.87
应付交易费用	-	-	-	1,463,863.79	1,463,863.79
其他负债	-	-	-	327,586.21	327,586.21
负债总计	-	-	-	34,370,367.50	34,370,367.50

利率敏感度缺口	57,868,714.18	-	-	-209,935,594.61	267,804,308.79
上年度末 2014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	28,789,500.93	-	-	-	28,789,500.93
结算备付金	879,695.33	-	-	-	879,695.33
存出保证金	124,040.57	-	-	-	124,040.57
交易性金融资产	-	-	-	-114,772,302.58	114,772,302.58
应收利息	-	-	-	4,654.89	4,654.89
应收申购款	62,564.35	-	-	291,319.70	353,884.05
资产总计	29,855,801.18	-	-	-115,068,277.17	144,924,078.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,232,908.89	2,232,908.89
应付管理人报酬	-	-	-	221,158.27	221,158.27
应付托管费	-	-	-	36,859.70	36,859.70
应付交易费用	-	-	-	623,508.83	623,508.83
其他负债	-	-	-	366,427.84	366,427.84
负债总计	-	-	-	3,480,863.53	3,480,863.53
利率敏感度缺口	29,855,801.18	-	-	-111,587,413.64	141,443,214.82

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2015 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(2014 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。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 2015年6月30日		上年度末 2014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	234,950,868.52	87.73	114,772,302.58	81.14
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	234,950,868.52	87.73	114,772,302.58	81.14

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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	比较基准上涨 5%	13,127,301.24	-
比较基准下降 5%	-13,127,301.24	-	

注：于上年度末(2014年12月31日)，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 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

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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

以公允价值计量的金融工具

金融工具公允价值计量的方法

以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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人民币 227,579,366.17 元，属于第二层次的余额为人民币 7,371,502.35 元，无属于第三层次余额。(2014 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人民币 101,474,759.88 元，属于第二层次的余额为人民币 13,297,542.70 元，无属于第三层次余额。)

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，本基金分别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不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或第三层次。

第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

其他事项

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	234,950,868.52	77.75
	其中：股票	234,950,868.52	77.75
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	57,713,081.12	19.10
7	其他各项资产	9,510,726.65	3.15
8	合计	302,174,676.29	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	-	-
B	采矿业	374.10	0.00
C	制造业	146,285,179.11	54.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,944,317.44	2.59
F	批发和零售业	1,168,526.35	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,726,252.48	2.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,058,450.83	26.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	550,087.00	0.21

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	10,218.68	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,207,462.53	1.20
S	综合	-	-
	合计	234,950,868.52	87.73

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	300020	银江股份	722,986	19,882,115.00	7.42
2	002551	尚荣医疗	310,424	13,469,297.36	5.03
3	300307	慈星股份	774,824	12,606,386.48	4.71
4	300253	卫宁软件	211,226	10,983,752.00	4.10
5	002467	二六三	496,535	9,657,605.75	3.61
6	300128	锦富新材	401,062	9,064,001.20	3.38
7	300147	香雪制药	264,321	8,141,086.80	3.04
8	600290	华仪电气	599,339	8,055,116.16	3.01
9	300358	楚天科技	186,651	7,983,063.27	2.98
10	300182	捷成股份	152,234	7,840,051.00	2.93
11	300045	华力创通	416,800	7,660,784.00	2.86
12	300109	新开源	104,754	7,435,438.92	2.78
13	600463	空港股份	350,016	6,944,317.44	2.59
14	000428	华天酒店	609,262	6,726,252.48	2.51
15	002405	四维图新	144,389	6,324,238.20	2.36
16	300053	欧比特	128,985	6,010,701.00	2.24
17	300088	长信科技	218,414	6,006,385.00	2.24
18	300285	国瓷材料	168,006	5,997,814.20	2.24
19	300451	创业软件	30,100	5,718,398.00	2.14
20	300063	天龙集团	164,587	5,661,792.80	2.11
21	300263	隆华节能	245,710	5,479,333.00	2.05
22	002583	海能达	304,400	5,378,748.00	2.01
23	600143	金发科技	441,415	5,261,666.80	1.96
24	300254	仟源医药	139,540	4,793,199.00	1.79
25	601126	四方股份	150,700	4,596,350.00	1.72

26	300016	北陆药业	100,000	4,271,000.00	1.59
27	300166	东方国信	116,599	4,188,236.08	1.56
28	300049	福瑞股份	43,500	3,914,565.00	1.46
29	300151	昌红科技	182,400	3,294,144.00	1.23
30	000793	华闻传媒	190,000	3,207,200.00	1.20
31	300026	红日药业	136,225	3,056,889.00	1.14
32	300392	腾信股份	22,400	2,995,776.00	1.12
33	300378	鼎捷软件	30,420	2,468,278.80	0.92
34	300252	金信诺	60,150	2,386,150.50	0.89
35	603222	济民制药	49,400	1,624,766.00	0.61
36	300154	瑞凌股份	59,174	1,589,413.64	0.59
37	002363	隆基机械	45,300	1,531,593.00	0.57
38	002589	瑞康医药	12,451	1,168,526.35	0.44
39	002022	科华生物	23,623	1,007,757.18	0.38
40	300404	博济医药	5,300	550,087.00	0.21
41	300244	迪安诊断	88	7,386.72	0.00
42	300101	振芯科技	71	3,947.60	0.00
43	300347	泰格医药	83	2,831.96	0.00
44	600060	海信电器	74	1,819.66	0.00
45	002037	久联发展	47	1,582.02	0.00
46	300207	欣旺达	16	387.52	0.00
47	000603	盛达矿业	15	374.10	0.00
48	601801	皖新传媒	9	262.53	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	300020	银江股份	25,921,555.19	18.33
2	002551	尚荣医疗	24,897,860.10	17.60
3	300307	慈星股份	21,792,458.84	15.41
4	300253	卫宁软件	18,114,216.00	12.81
5	600290	华仪电气	16,347,239.50	11.56
6	300128	锦富新材	16,283,587.99	11.51
7	002467	二六三	15,398,157.00	10.89
8	600682	南京新百	14,136,355.68	9.99

9	600143	金发科技	14,025,909.40	9.92
10	300358	楚天科技	13,860,398.25	9.80
11	300147	香雪制药	13,459,321.60	9.52
12	300182	捷成股份	13,084,007.52	9.25
13	300049	福瑞股份	12,777,418.40	9.03
14	300263	隆华节能	12,572,953.38	8.89
15	300207	欣旺达	12,520,143.95	8.85
16	300045	华力创通	12,148,098.47	8.59
17	002215	诺普信	12,055,586.78	8.52
18	000428	华天酒店	11,918,003.56	8.43
19	000603	盛达矿业	11,801,396.33	8.34
20	300053	欧比特	11,637,207.82	8.23
21	002327	富安娜	11,342,724.00	8.02
22	002293	罗莱家纺	11,308,608.62	8.00
23	300109	新开源	10,323,804.14	7.30
24	600358	国旅联合	10,185,871.97	7.20
25	600463	空港股份	10,158,811.78	7.18
26	002436	兴森科技	10,048,189.51	7.10
27	300088	长信科技	9,152,921.00	6.47
28	300154	瑞凌股份	9,023,481.00	6.38
29	300254	仟源医药	8,441,593.16	5.97
30	600060	海信电器	7,980,451.93	5.64
31	300133	华策影视	7,946,122.00	5.62
32	300016	北陆药业	7,389,317.00	5.22
33	300451	创业软件	7,069,679.31	5.00
34	300347	泰格医药	6,942,587.21	4.91
35	300250	初灵信息	6,408,151.00	4.53
36	000657	中钨高新	6,377,595.00	4.51
37	600397	安源煤业	6,374,946.00	4.51
38	603222	济民制药	6,259,632.00	4.43
39	002583	海能达	6,242,654.00	4.41
40	601126	四方股份	6,077,955.00	4.30
41	300285	国瓷材料	5,965,379.44	4.22
42	002405	四维图新	5,887,462.40	4.16
43	300026	红日药业	5,838,811.73	4.13
44	000333	美的集团	5,668,145.99	4.01

45	300244	迪安诊断	5,269,984.00	3.73
46	000100	TCL 集团	5,183,725.20	3.66
47	300352	北信源	4,539,943.00	3.21
48	300252	金信诺	4,446,197.00	3.14
49	300151	昌红科技	4,384,435.78	3.10
50	600805	悦达投资	4,382,069.00	3.10
51	300166	东方国信	4,198,690.25	2.97
52	600446	金证股份	4,126,647.00	2.92
53	300392	腾信股份	4,036,966.00	2.85
54	300101	振芯科技	3,940,309.49	2.79
55	000793	华闻传媒	3,931,268.00	2.78
56	002022	科华生物	3,911,630.16	2.77
57	002256	彩虹精化	3,414,011.00	2.41
58	300209	天泽信息	3,330,711.00	2.35
59	002707	众信旅游	3,062,962.60	2.17
60	300165	天瑞仪器	2,933,325.60	2.07
61	600588	用友网络	2,886,938.08	2.04
62	002438	江苏神通	2,879,995.00	2.04
63	300271	华宇软件	2,856,436.00	2.02
64	601908	京运通	2,829,318.66	2.00

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	600682	南京新百	17,882,004.56	12.64
2	300263	隆华节能	17,707,769.43	12.52
3	300207	欣旺达	16,735,558.58	11.83
4	000603	盛达矿业	12,965,618.10	9.17
5	002327	富安娜	12,265,847.71	8.67
6	600358	国旅联合	11,192,195.37	7.91
7	002293	罗莱家纺	11,130,121.45	7.87
8	300182	捷成股份	10,469,767.34	7.40
9	002215	诺普信	10,369,837.25	7.33
10	002551	尚荣医疗	9,965,306.48	7.05
11	300347	泰格医药	9,546,157.21	6.75

12	300133	华策影视	9,323,120.81	6.59
13	600143	金发科技	9,313,992.47	6.58
14	300049	福瑞股份	9,301,498.64	6.58
15	002366	丹甫股份	9,245,976.69	6.54
16	002318	久立特材	9,005,888.79	6.37
17	601801	皖新传媒	8,988,519.91	6.35
18	002436	兴森科技	8,965,907.31	6.34
19	600060	海信电器	8,741,954.28	6.18
20	300032	金龙机电	8,497,682.27	6.01
21	002707	众信旅游	7,236,672.00	5.12
22	300063	天龙集团	7,222,224.70	5.11
23	300244	迪安诊断	7,184,230.50	5.08
24	300250	初灵信息	7,182,546.99	5.08
25	600290	华仪电气	6,946,417.00	4.91
26	002331	皖通科技	6,394,665.28	4.52
27	600397	安源煤业	6,174,604.01	4.37
28	300101	振芯科技	6,153,248.50	4.35
29	300154	瑞凌股份	5,933,183.45	4.19
30	000657	中钨高新	5,915,230.96	4.18
31	000100	TCL 集团	5,914,634.20	4.18
32	000333	美的集团	5,696,424.25	4.03
33	300231	银信科技	5,490,167.83	3.88
34	002117	东港股份	5,465,135.63	3.86
35	300307	慈星股份	5,367,098.13	3.79
36	002167	东方锆业	5,344,536.41	3.78
37	603222	济民制药	5,259,836.59	3.72
38	300352	北信源	4,780,461.66	3.38
39	000777	中核科技	4,760,236.36	3.37
40	000939	凯迪电力	4,582,699.04	3.24
41	300147	香雪制药	4,349,140.20	3.07
42	002657	中科金财	4,212,110.82	2.98
43	300128	锦富新材	4,184,079.38	2.96
44	002022	科华生物	4,144,518.56	2.93
45	600875	东方电气	4,098,524.73	2.90
46	002256	彩虹精化	4,018,852.67	2.84
47	002712	思美传媒	3,946,812.84	2.79
48	002214	大立科技	3,878,538.61	2.74
49	300358	楚天科技	3,831,922.77	2.71

50	600805	悦达投资	3,774,215.17	2.67
51	300254	仟源医药	3,422,038.48	2.42
52	000428	华天酒店	3,418,510.87	2.42
53	600588	用友网络	3,368,205.23	2.38
54	300380	安硕信息	3,367,366.62	2.38
55	600446	金证股份	3,364,367.66	2.38
56	300165	天瑞仪器	3,320,010.97	2.35
57	300269	联建光电	3,300,914.49	2.33
58	300271	华宇软件	3,279,650.51	2.32
59	600055	华润万东	3,231,897.59	2.28
60	000524	岭南控股	3,226,487.86	2.28
61	300209	天泽信息	3,221,338.04	2.28
62	601908	京运通	3,170,614.14	2.24
63	600858	银座股份	3,157,391.15	2.23
64	002438	江苏神通	3,046,069.54	2.15
65	002364	中恒电气	2,981,540.45	2.11
66	300242	明家科技	2,961,116.76	2.09
67	300020	银江股份	2,955,755.02	2.09
68	300252	金信诺	2,862,092.00	2.02
69	300053	欧比特	2,856,925.79	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	671,399,122.53
卖出股票收入（成交）总额	559,988,168.62

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

华仪电气于 2015 年 2 月 10 日收到《关于对华仪电气股份有限公司和董事会秘书张传晕予以监管关注的决定》，因公司未在暂缓披露期限届满后及时履行信息披露义务，上海证券交易所决定对华仪电气股份有限公司和董事会秘书张传晕予以监管关注。

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	127,395.64
2	应收证券清算款	8,686,025.76
3	应收股利	-
4	应收利息	13,804.25
5	应收申购款	683,501.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,510,726.65

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
11,018	18,874.46	18,771,413.62	9.03%	189,187,365.28	90.97%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	454,566.27	0.2186%

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（2014年5月14日）基金份额总额	512,887,511.92
本报告期期初基金份额总额	150,676,319.00
本报告期基金总申购份额	528,296,470.03
减：本报告期基金总赎回份额	471,014,010.13
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	207,958,778.90

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

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

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起(2014年5月14日)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	
海通证券	1	466,663,232.17	37.90%	412,950.39	37.63%	-
招商证券	1	151,972,416.05	12.34%	134,480.29	12.25%	-
兴业证券	2	135,724,127.29	11.02%	123,563.25	11.26%	-
中金国际	2	105,339,643.84	8.55%	93,312.80	8.50%	-

国海证券	2	94,006,654.54	7.63%	83,284.65	7.59%	-
光大证券	1	81,439,457.62	6.61%	72,066.03	6.57%	-
国泰君安	1	40,025,230.35	3.25%	36,439.12	3.32%	-
安信证券	1	37,075,412.31	3.01%	32,807.90	2.99%	-
申银万国	1	35,008,730.08	2.84%	31,871.75	2.90%	-
齐鲁证券	1	32,597,966.92	2.65%	29,677.13	2.70%	-
中信建投	1	24,425,040.24	1.98%	22,236.76	2.03%	-
广发证券	1	23,467,550.36	1.91%	21,364.82	1.95%	-
长江证券	1	2,089,921.58	0.17%	1,902.68	0.17%	-
中信金通	1	1,551,907.80	0.13%	1,412.86	0.13%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

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新增：兴业证券、安信证券、浙商证券、华创证券。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2015 年 6 月 30 日

	行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	报》以及基金管理人网站	
2	华宝兴业创新优选股票型证券投资基金第一次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金经理变更的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 7 日
4	关于调降华宝兴业网上交易汇款交易方式申购基金优惠费率至一折的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 4 月 9 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增加上海好买基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 3 月 13 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参加申万宏源证券申购费率优惠活动及开通定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 3 月 3 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 3 月 2 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费率优惠活动的公	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人	2015 年 2 月 14 日

	告	网站	
9	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	2015 年 1 月 1 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2015 年 7 月 22 日发布了《华宝兴业基金管理有限公司关于修改华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金名称及基金合同的公告》，基金名称变更为“华宝兴业创新优选混合型证券投资基金”，基金简称变更为“华宝创新优选混合”并相应修改了《基金合同》中的相关内容。本次变更事项自公告之日起生效，变更事项对本基金投资及投资者无不利影响，本公司已履行相关程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金合同；
 华宝兴业创新优选股票型证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业创新优选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。

12.2 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。

12.3 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
2015 年 8 月 28 日