

# 华宝兴业增强收益债券型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业增强收益债券型证券投资基金	
基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	90,507,747.99份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
下属分级基金的交易代码:	240012	240013
报告期末下属分级基金的份额总额	39,191,090.23份	51,316,657.76份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	华宝兴业基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	刘月华	蒋松云
	联系电话	021-38505888	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-700-5588 021-38924558	95588	
传真	021-38505777	010-66105798	

注册地址	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55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55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	郑安国	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

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

基金级别	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	1,424,952.65	3,317,152.68
本期利润	1,869,023.32	3,567,817.64
加权平均基金份额本期利润	0.0881	0.0772
本期加权平均净值利润率	6.63%	5.91%
本期基金份额净值增长率	7.26%	7.04%
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	12,868,474.30	15,114,559.96
期末可供分配基金份额利润	0.3284	0.2945
期末基金资产净值	53,524,500.92	68,306,342.55
期末基金份额净值	1.3657	1.3311

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	39.20%	35.68%

注： 1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业增强收益债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.26%	0.17%	-0.05%	0.08%	0.31%	0.09%
过去三个月	4.05%	0.22%	1.34%	0.14%	2.71%	0.08%
过去六个月	7.26%	0.19%	0.77%	0.13%	6.49%	0.06%
过去一年	18.14%	0.23%	3.89%	0.15%	14.25%	0.08%
过去三年	30.18%	0.23%	1.10%	0.12%	29.08%	0.11%
自基金合同生效日起至 今	39.20%	0.24%	0.93%	0.11%	38.27%	0.13%

华宝兴业增强收益债券 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.23%	0.17%	-0.05%	0.08%	0.28%	0.09%
过去三个月	3.95%	0.22%	1.34%	0.14%	2.61%	0.08%
过去六个月	7.04%	0.19%	0.77%	0.13%	6.27%	0.06%
过去一年	17.67%	0.23%	3.89%	0.15%	13.78%	0.08%
过去三年	28.61%	0.23%	1.10%	0.12%	27.51%	0.11%
自基金合同生效日起至 今	35.68%	0.24%	0.93%	0.11%	34.75%	0.13%

注： 1、本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

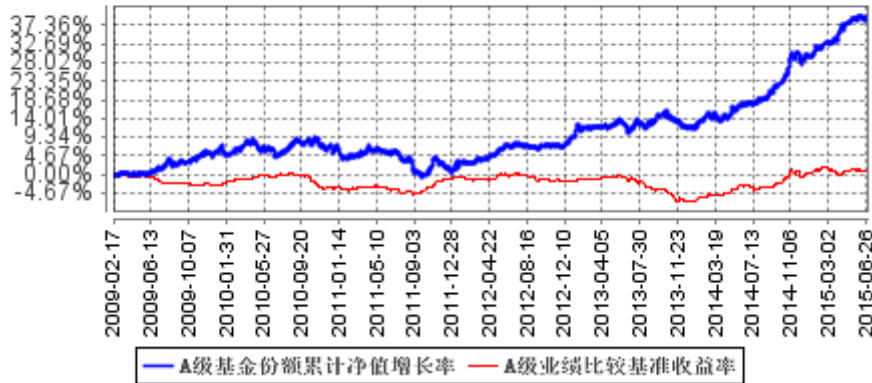
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非

交易日)。

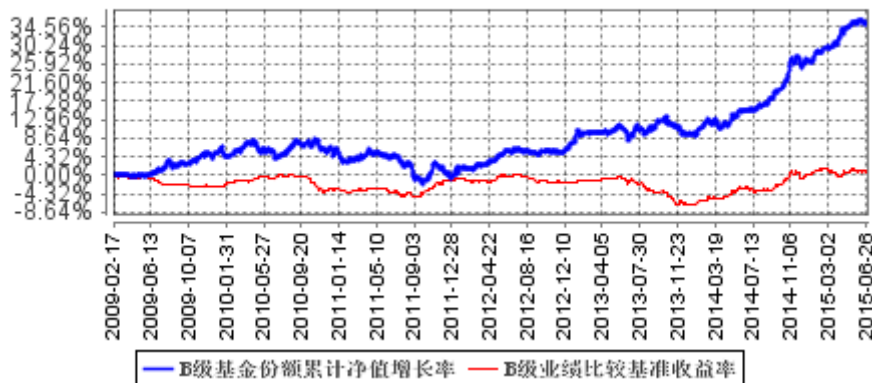
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2009年2月17日至2015年6月30日)

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人于2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（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		
李栋梁	本基金基金经理，华宝兴业宝康债券证券投资基金基金经理	2014 年 10 月 11 日	-	12 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资，2010 年 9 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师，2010 年 12 月至 2011 年 6 月任华宝兴业宝康债券基金经理助理，2011 年 6 月起担任华宝兴业宝康债券基金经理，2014 年 10 月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理。
梅峻玺	本基金基金经理助理	2015 年 3 月 5 日	-	5 年	硕士。曾在长江证券研究部从事研究工作。2011 年 2 月加入华宝兴业基金管理有

					限公司担任研究部高级分析师。2015年3月起担任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

2015年1-6月份，固定资产投资完成额同比增长11.4%，1-5月份固定资产投资增速持续下滑，但是下滑幅度不断收窄。分行业来看，制造业投资完成额同比增速下降至9.7%，房地产开发投资完成额同比增速下降至4.6%；制造业投资增速降幅收窄，房地产投资增速降幅也在收窄，基建投资增速总体较为稳定。1-6月份出口金额同比上升1.0%，出口增速在2季度小幅改善；1-6月份进口金额同比下降15.5%，进口增速较低表明内需很不乐观。1-6月份社会消费品零售总额同比增长10.6%，名义和实际消费增速相对稳定。物价水平低于市场预期，6月份CPI为1.4%，1-6月份CPI为1.3%。上半年GDP同比增长7%，1季度和2季度GDP增速均为7%，其中第三产业尤其是金融行业对GDP增速的贡献加大。今年以来央行采取了宽松的货币政策，央行先后在2月底、5月份中旬以及6月底3次降低金融机构存贷款基准利率，央行先后在2月份和4月份两次降低存款准备金率，并在6月底针对部分符合条件的金融机构定向降低存款准备金率。虽然央行采取了宽松的货币政策，但是新增信贷以及新增社会融资总量数据并没有出现改善，表外融资持续处于压缩状态。上半年利率债收益率走势波动较大，1-2月份利率债收益率整体平行下移，3月份收益率陡峭化上行，2季度收益率曲线出现陡峭化下行走势；上半年利率债短端收益率大幅度下降，而长端收益率和年初水平几乎持平，后期即便是降息也没有刺激长端收益率下行。上半年信用债收益率走势方向和形态和利率债基本一致，信用债短端收益率大幅度下降，中长端收益率小幅度下降，收益率曲线整体呈现陡峭化下行态势。上半年转债波动较大，1季度转债整体小幅度调整，4-5月份转债受益于正股的持续上涨以及供求失衡而大幅上涨，6月中下旬转债整体大幅度下跌。股票市场1-5月份几乎是单边上涨态势，中间少有调整，尤其是中小板和创业板上涨幅度惊人，但是6月份股票市场出现大幅快速的调整，转债整体的走势和股票走势较为一致。

2015年上半年增强收益债券基金降低了利率债的投资比例，提高了信用债的投资比例，提高了股票的配置比例。1-5月份权益类资产配置比例偏低导致基金表现一般，后期随着股市的调整，基金的业绩不断改善。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内增强收益A基金份额净值增长率为7.26%，同期业绩比较基准收益率为0.77%；增强收益B基金份额净值增长率为7.04%，同期业绩比较基准收益率为0.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5-6 月份经济数据出现改善，地产销售持续改善导致房地产固定资产投资增速降幅继续收窄，制造业投资增速趋于稳定，基建投资增速出现下滑。消费增速保持稳定，出口增速出现改善。6 月份的金融数据因季节性因素较 5 月份改善明显，但是随着季节性因素的消失，7 月份的金融数据可能再度走弱。上半年第三产业尤其是金融行业对 GDP 的贡献加大，随着股票市场的下跌，下半年金融行业可能对 GDP 构成拖累，因此下半年稳增长的压力依然较大。从政策来看，银行间市场资金较为宽裕，1 天质押式回购利率下降至 1%左右，而且半年末仅微幅上行，显示银行体系资金较为充裕，进一步全面大幅降低存款准备金率的必要性下降；从存贷款基准利率来看，1 年期定存基准利率已经降低至 2%，1 年期贷款基准利率已经降低至 4.85%，央行进一步大幅降低存贷款基准利率的可能性也较小。下半年稳增长更多的依赖财政政策。总体上来看，今年经济增速继续下降，物价维持在较低水平。

上半年债券市场收益率以下降为主，只有长端利率债的收益率和年初持平。7 月份新股暂停和股市的持续调整推动大量资金转战债券市场，利率债中短端和信用债收益率持续下行。由于货币市场收益率已经处在很低的水平，未来货币市场收益率进一步下降的空间极小，这样无论是利率债还是信用债，短端收益率在目前水平上继续下降的可能性很小。上半年央行多次降息，但是降息之后利率债和信用债中长端收益率都出现上行。下半年经济增速可能低位企稳，因此债券收益率继续下行的可能性也较小，稳妥的策略是持有信用风险较小的中短期信用债，信用债需要做好个券甄别，回避信用状况恶化的个券。城投债的不确定性降低，地方政府债务置换降低了部分存量城投类债券的风险，其配置价值不仅较年初上升，也高于同信用等级、同期限的产业债的配置价值。可转债依然是一个非常重要的高波动品种，转债的稀缺以及股市波动的加大导致转债的波动加大，可转债交易需要做好择时和择券。总的来说市场依然存在不确定性，我们会高度关注经济和政策的变化，分析其对大类资产配置的影响，以改善业绩。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

(三)、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性  
及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政  
策和程序的适用性。

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

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对华宝兴业增强收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格  
遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有  
人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

本托管人依法对华宝兴业基金管理有限公司编制和披露的华宝兴业基金管理有限公司在华宝  
兴业增强收益债券型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财  
务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,012,631.98	1,196,074.43
结算备付金		281,550.20	726,020.39
存出保证金		31,981.47	26,438.17
交易性金融资产	6.4.7.2	118,791,470.72	46,393,325.60
其中：股票投资		7,041,960.00	227,240.00
基金投资		-	-
债券投资		111,749,510.72	46,166,085.60
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		454,474.80	-
应收利息	6.4.7.5	2,374,542.34	1,081,519.19
应收股利		-	-
应收申购款		8,427,619.95	710,298.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		147,374,271.46	50,133,676.51
<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>上年度末 2014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		16,999,865.00	9,000,000.00
应付证券清算款		6,052,941.91	152,426.10
应付赎回款		2,017,916.86	126,972.31
应付管理人报酬		61,801.44	24,165.58
应付托管费		20,600.44	8,055.21
应付销售服务费		30,161.80	8,187.99
应付交易费用	6.4.7.7	201,686.96	92,989.18
应交税费		-	-
应付利息		6,847.33	1,247.75

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	151,606.25	212,655.27
负债合计		25,543,427.99	9,626,699.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	90,507,747.99	32,126,547.48
未分配利润	6.4.7.10	31,323,095.48	8,380,429.64
所有者权益合计		121,830,843.47	40,506,977.12
负债和所有者权益总计		147,374,271.46	50,133,676.51

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 A 类：1.3657 元，B 类：1.3311 元，基金份额总额 A 类：39,191,090.23 份，B 类：51,316,657.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

本报告期：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 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,423,158.83	2,646,925.88
1.利息收入		2,249,045.51	1,052,642.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,359.74	5,080.98
债券利息收入		2,215,396.31	1,006,425.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,289.46	41,135.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,449,381.51	481,686.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,144,103.69	-260,163.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	299,976.54	741,850.37
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	5,301.28	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	694,735.63	1,107,257.32
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	29,996.18	5,339.07
<b>减：二、费用</b>		986,317.87	498,207.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	260,960.81	122,365.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,986.84	40,788.38

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	118,019.74	36,785.79
4. 交易费用	6.4.7.19	182,292.55	47,965.26
5. 利息支出		255,520.12	147,019.71
其中：卖出回购金融资产支出		255,520.12	147,019.71
6. 其他费用	6.4.7.20	82,537.81	103,282.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,436,840.96	2,148,718.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,436,840.96	2,148,718.68

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

本报告期：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）	32,126,547.48	8,380,429.64	40,506,977.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,436,840.96	5,436,840.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	58,381,200.51	17,505,824.88	75,887,025.39
其中：1.基金申购款	132,672,182.52	41,922,217.35	174,594,399.87
2.基金赎回款	-74,290,982.01	-24,416,392.47	-98,707,374.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	90,507,747.99	31,323,095.48	121,830,843.47
项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	39,965,224.84	3,434,276.67	43,399,501.51
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	2,148,718.68	2,148,718.68
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)	-6,000,680.59	-662,253.06	-6,662,933.65
其中：1.基金申购款	11,520,884.66	1,426,495.40	12,947,380.06
2.基金赎回款	-17,521,565.25	-2,088,748.46	-19,610,313.71
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)	33,964,544.25	4,920,742.29	38,885,286.54

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	_____ 向辉	_____ 张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金（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[2008]1294号文《关于核准华宝兴业增强收益债券型证券投资基金募集申请的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人于2009年1月5日至2009年2月13日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所有限公司验证并出具安永华明（2009）验字第60737318\_B01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2009年2月17日正式生效，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币2,257,644,988.35元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币563,394.90元，以上实收基金（本息）合计为人民币2,258,208,383.25元，折合2,258,208,383.25份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可通过投资首次发行股票、增发新股、可转换债券转股票以及权证行权等方式获得股票，也可直接从二级市场买入股票。本基金可通过参与可分离转债申购而获得权证，也可直接从二级市场买入权证。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金整体的业绩比较基准为中国债券总指数收益率×100%。

#### **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 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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，也参考了中国证券业协会制定的《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〉》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》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。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本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于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### **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。

### 6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 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。

### 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。

### 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	17,012,631.98
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	17,012,631.98

### 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	6,907,251.80	7,041,960.00	134,708.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	66,309,574.19	66,539,710.72	230,136.53

	银行间市场	43,873,831.09	45,209,800.00	1,335,968.91
	合计	110,183,405.28	111,749,510.72	1,566,105.44
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	117,090,657.08	118,791,470.72	1,700,813.64

### 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	2,119.55
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	126.70
应收债券利息	2,372,281.69
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.40
合计	2,374,542.34

### 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	201,281.96
银行间市场应付交易费用	405.00
合计	201,686.96

#### 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	7,181.89
预提费用	144,424.36
合计	151,606.25

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 A		
项目	本期 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	18,675,111.52	18,675,111.52
本期申购	55,414,554.66	55,414,554.66
本期赎回(以“-”号填列)	-34,898,575.95	-34,898,575.95
本期末	39,191,090.23	39,191,090.23

金额单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 B		
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	13,451,435.96	13,451,435.96
本期申购	77,257,627.86	77,257,627.86
本期赎回(以“-”号填列)	-39,392,406.06	-39,392,406.06
本期末	51,316,657.76	51,316,657.76

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

华宝兴业增强收益债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,688,283.80	415,571.36	5,103,855.16
本期利润	1,424,952.65	444,070.67	1,869,023.32
本期基金份额交易产生的变动数	6,755,237.85	605,294.36	7,360,532.21
其中：基金申购款	17,337,397.08	1,826,986.60	19,164,383.68

基金赎回款	-10,582,159.23	-1,221,692.24	-11,803,851.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,868,474.30	1,464,936.39	14,333,410.69

单位：人民币元

华宝兴业增强收益债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,983,693.78	292,880.70	3,276,574.48
本期利润	3,317,152.68	250,664.96	3,567,817.64
本期基金份额交易产生的变动数	8,813,713.50	1,331,579.17	10,145,292.67
其中：基金申购款	20,221,098.78	2,536,734.89	22,757,833.67
基金赎回款	-11,407,385.28	-1,205,155.72	-12,612,541.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,114,559.96	1,875,124.83	16,989,684.79

#### 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	18,572.78
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	5,699.29
其他	3,087.67
合计	27,359.74

#### 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	58,554,900.58
减：卖出股票成本总额	55,410,796.89
买卖股票差价收入	3,144,103.69

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	299,976.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	299,976.54

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	69,031,761.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	67,011,644.97
减：应收利息总额	1,720,140.43
买卖债券差价收入	299,976.54

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

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	5,301.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,301.28

#### 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	694,735.63
——股票投资	154,152.20
——债券投资	540,583.43
——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	694,735.63

#### 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	7,484.06
转换费收入 240012	22,512.12
合计	29,996.18

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

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

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	181,942.55
银行间市场交易费用	350.00
合计	182,292.55

#### 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	24,795.19
信息披露费	44,629.17
银行汇划费用	2,413.45
清算所 CFCA 证书服务费	200.00
帐户维护费	10,500.00
合计	82,537.81

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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	上年度可比期间
----	----	---------

	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	260,960.81	122,365.15
其中：支付销售机构的客户维护费	31,519.22	33,904.62

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

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,986.84	40,788.38

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B	合计
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	13,347.57	13,347.57
华宝兴业基金管理有限公司	-	89,298.48	89,298.48
合计	-	102,646.05	102,646.05

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B	合计
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	-	19,884.33	19,884.33
华宝兴业基金管理有限公司	-	1,927.31	1,927.31
合计	-	21,811.64	21,811.64

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

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的 B 类基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
期初持有的基金份额	86,597.54	63,497.82
期间申购/买入总份额	538,431.12	54,491.67
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	625,028.66	117,989.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.59%	0.23%

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
期初持有的基金份额	86,597.54	63,497.82

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	86,597.54	63,497.82
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.46%	0.42%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1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
中国工商银行	17,012,631.98	18,572.78	150,124.01	3,141.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300489	中飞股份	2015年6月24日	2015年7月1日	新股流通受限	17.56	17.56	500	8,780.00	8,780.00	-

##### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注
----	----	----	----	-----	----	-----	----	----	-----	----

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:张)	成本总额	值总额	
132002	15天集EB	2015年6月10日	2015年7月2日	新债未上市	100.00	100.00	700	70,000.00	70,000.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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 9,999,865.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140350	14 进出 50	2015 年 7 月 1 日	105.54	100,000	10,554,000.00
合计				100,000	10,554,000.00

##### 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人民币 7,000,000.00 元，将于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。本基金投资的金融工具主要包括债券、股票等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求较高的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	20,203,000.00	-
A-1 以下	-	-

未评级	4,010,800.00	4,005,600.00
合计	24,213,800.00	4,005,600.00

注：未评级债券均为政策性金融债券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	10,925,327.50	1,432,590.00
AAA 以下	55,614,383.22	17,737,000.60
未评级	20,996,000.00	22,990,895.00
合计	87,535,710.72	42,160,485.60

注：未评级债券均为政策性金融债券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，因此除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。本报告期末，本基金持有的债券投资公允价值占基金资产净值比例为 91.73%。

##### 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	17,012,631.98	-	-	-	17,012,631.98
结算备付金	281,550.20	-	-	-	281,550.20
存出保证金	31,981.47	-	-	-	31,981.47
交易性金融资产	32,675,430.00	53,207,164.32	25,866,916.40	7,041,960.00	118,791,470.72
应收证券清算款	-	-	-	454,474.80	454,474.80
应收利息	-	-	-	2,374,542.34	2,374,542.34
应收申购款	1,292.85	-	-	8,426,327.10	8,427,619.95
资产总计	50,002,886.50	53,207,164.32	25,866,916.40	18,297,304.24	147,374,271.46
负债					
卖出回购金融资产款	16,999,865.00	-	-	-	16,999,865.00
应付证券清算款	-	-	-	6,052,941.91	6,052,941.91
应付赎回款	-	-	-	2,017,916.86	2,017,916.86
应付管理人报酬	-	-	-	61,801.44	61,801.44
应付托管费	-	-	-	20,600.44	20,600.44
应付销售服务费	-	-	-	30,161.80	30,161.80
应付交易费用	-	-	-	201,686.96	201,686.96
应付利息	-	-	-	6,847.33	6,847.33
其他负债	-	-	-	151,606.25	151,606.25
负债总计	16,999,865.00	-	-	8,543,562.99	25,543,427.99
利率敏感度缺口	33,003,021.50	53,207,164.32	25,866,916.40	9,753,741.25	121,830,843.47
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	1,196,074.43	-	-	-	1,196,074.43
结算备付金	726,020.39	-	-	-	726,020.39
存出保证金	26,438.17	-	-	-	26,438.17
交易性金融资产	5,254,568.50	16,185,577.10	24,725,940.00	227,240.00	46,393,325.60
应收利息	-	-	-	1,081,519.19	1,081,519.19
应收申购款	-	-	-	710,298.73	710,298.73
资产总计	7,203,101.49	16,185,577.10	24,725,940.00	2,019,057.92	50,133,676.51
负债					
卖出回购金融资产款	9,000,000.00	-	-	-	9,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	152,426.10	152,426.10
应付赎回款	-	-	-	126,972.31	126,972.31
应付管理人报酬	-	-	-	24,165.58	24,165.58
应付托管费	-	-	-	8,055.21	8,055.21
应付销售服务费	-	-	-	8,187.99	8,187.99
应付交易费用	-	-	-	92,989.18	92,989.18

应付利息	-	-	-	1,247.75	1,247.75
其他负债	-	-	-	212,655.27	212,655.27
负债总计	9,000,000.00	-	-	626,699.39	9,626,699.39
利率敏感度缺口	-1,796,898.51	16,185,577.10	24,725,940.00	1,392,358.53	40,506,977.12

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个百分点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25%	-662,042.89	-511,511.33
	市场利率下降 25%	672,806.00	521,544.24

#### 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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

##### 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	7,041,960.00	5.78	-	-
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	7,041,960.00	5.78	-	-

#### 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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	5,117,549.05	-
	2. 业绩比较基准下降 5%	-5,117,549.05	-

#### 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 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级的余额为 7,033,180.00 元，属于第二层级的余额为 111,758,290.72 元，无属于第三层级的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 17,634,010.60 元，属于第二层级的余额为 28,759,315.00 元，无属于第三层级的余额)。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负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

(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(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。

(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	7,041,960.00	4.78
	其中：股票	7,041,960.00	4.78
2	固定收益投资	111,749,510.72	75.83
	其中：债券	111,749,510.72	75.83
	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	17,294,182.18	11.73
7	其他各项资产	11,288,618.56	7.66
8	合计	147,374,271.46	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	-	-
C	制造业	3,984,460.00	3.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	491,200.00	0.40
J	金融业	2,566,300.00	2.11
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,041,960.00	5.78

### 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	601318	中国平安	20,000	1,638,800.00	1.35
2	002236	大华股份	50,000	1,596,000.00	1.31
3	600309	万华化学	50,000	1,209,000.00	0.99
4	002250	联化科技	50,000	1,120,000.00	0.92
5	601288	农业银行	250,000	927,500.00	0.76
6	300168	万达信息	10,000	491,200.00	0.40
7	603589	口子窖	2,000	50,680.00	0.04
8	300489	中飞股份	500	8,780.00	0.01

## 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	600309	万华化学	2,858,280.93	7.06
2	002236	大华股份	2,793,515.26	6.90
3	000422	湖北宜化	2,577,053.13	6.36
4	002538	司尔特	2,547,438.45	6.29
5	600251	冠农股份	2,484,205.00	6.13
6	002657	中科金财	2,261,000.00	5.58
7	600728	佳都科技	1,772,789.00	4.38
8	600810	神马股份	1,753,976.05	4.33
9	600138	中青旅	1,747,145.12	4.31
10	300255	常山药业	1,737,036.40	4.29
11	600682	南京新百	1,718,382.00	4.24
12	002098	浔兴股份	1,703,918.98	4.21
13	600513	联环药业	1,653,867.00	4.08
14	000902	新洋丰	1,578,812.00	3.90
15	601318	中国平安	1,578,280.00	3.90
16	002206	海利得	1,549,128.38	3.82
17	000004	国农科技	1,415,228.00	3.49
18	300144	宋城演艺	1,404,685.00	3.47
19	002570	贝因美	1,359,200.00	3.36
20	601788	光大证券	1,254,754.00	3.10
21	601377	兴业证券	1,233,000.00	3.04
22	002250	联化科技	1,108,934.00	2.74
23	002035	华帝股份	1,077,580.52	2.66
24	002563	森马服饰	1,015,166.00	2.51
25	002531	天顺风能	1,006,506.00	2.48
26	002508	老板电器	986,400.00	2.44
27	002115	三维通信	979,608.00	2.42
28	601288	农业银行	967,500.00	2.39
29	300244	迪安诊断	913,572.00	2.26
30	603368	柳州医药	856,640.00	2.11
31	300136	信维通信	845,497.00	2.09

32	600637	东方明珠	824,000.00	2.03
----	--------	------	------------	------

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	002538	司尔特	2,694,252.86	6.65
2	600513	联环药业	2,589,126.80	6.39
3	600251	冠农股份	2,484,569.52	6.13
4	600728	佳都科技	2,140,815.40	5.29
5	002657	中科金财	2,031,053.56	5.01
6	000902	新洋丰	1,994,749.00	4.92
7	300255	常山药业	1,974,579.44	4.87
8	000422	湖北宜化	1,971,354.00	4.87
9	600138	中青旅	1,864,390.86	4.60
10	600309	万华化学	1,851,048.00	4.57
11	600810	神马股份	1,832,659.36	4.52
12	002098	浔兴股份	1,809,737.30	4.47
13	002236	大华股份	1,655,555.00	4.09
14	600682	南京新百	1,644,170.00	4.06
15	002206	海利得	1,618,954.00	4.00
16	002570	贝因美	1,404,782.60	3.47
17	300144	宋城演艺	1,268,865.00	3.13
18	000004	国农科技	1,224,886.00	3.02
19	601377	兴业证券	1,217,423.32	3.01
20	601788	光大证券	1,210,014.00	2.99
21	002035	华帝股份	1,205,914.72	2.98
22	002563	森马服饰	1,157,685.49	2.86
23	600804	鹏博士	1,113,690.68	2.75
24	002531	天顺风能	1,066,348.00	2.63
25	002508	老板电器	1,037,325.00	2.56
26	002115	三维通信	1,020,861.40	2.52
27	300244	迪安诊断	993,600.00	2.45
28	300136	信维通信	894,124.10	2.21
29	600637	东方明珠	871,601.00	2.15
30	002381	双箭股份	850,005.00	2.10
31	603368	柳州医药	832,303.00	2.05

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	62,071,364.69
卖出股票收入（成交）总额	58,554,900.58

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	27,568,550.00	22.63
	其中：政策性金融债	27,568,550.00	22.63
4	企业债券	63,907,960.72	52.46
5	企业短期融资券	20,203,000.00	16.58
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	70,000.00	0.06
9	合计	111,749,510.72	91.73

### 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	140350	14 进出 50	100,000	10,554,000.00	8.66
2	140215	14 国开 15	100,000	10,442,000.00	8.57
3	041468006	14 阳泉 CP003	100,000	10,104,000.00	8.29
4	041564007	15 营口港 CP002	100,000	10,099,000.00	8.29
5	111051	09 怀化债	80,046	8,546,511.42	7.02

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,981.47
2	应收证券清算款	454,474.80
3	应收股利	-
4	应收利息	2,374,542.34
5	应收申购款	8,427,619.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,288,618.56

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300489	中飞股份	8,780.00	0.01	新股锁定

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华宝兴业增强收益债券 A	803	48,805.84	625,028.66	1.59%	38,566,061.57	98.41%
华宝兴业增强收益债券 B	515	99,644.00	39,850,759.27	77.66%	11,465,898.49	22.34%
合计	1,318	68,670.52	40,475,787.93	44.72%	50,031,960.06	55.28%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝兴业增强收益债券 A	1,709,054.52	4.3608%
	华宝兴业增强收益	250,976.25	0.4891%

	债券 B		
	合计	1,960,030.77	2.1656%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝兴业增强收益债券 A	>100
	华宝兴业增强收益债券 B	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业增强收益债券 A	10~50
	华宝兴业增强收益债券 B	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
基金合同生效日（2009年2月17日）基金份额总额	615,728,987.54	1,642,479,395.71
本报告期期初基金份额总额	18,675,111.52	13,451,435.96
本报告期基金总申购份额	55,414,554.66	77,257,627.86
减：本报告期基金总赎回份额	34,898,575.95	39,392,406.06
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	39,191,090.23	51,316,657.76

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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(2009年2月17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	
申银万国	1	71,112,461.23	59.04%	64,740.95	59.04%	-
国泰君安	1	49,333,169.04	40.96%	44,912.69	40.96%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2、本期交易单元无变动。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	39,058,770.80	22.02%	-	-	-	-
国泰君安	138,321,410.86	77.98%	600,300,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《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参加中国农业银行网上银行、手机银行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5月30日
3	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
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申万宏源证券申购费率优惠活动及开通定投业务的公	《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

	告		
5	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
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渤海银行申购及定投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2月14日
7	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 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同；  
华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书；  
华宝兴业增强收益债券型证券投资基金托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 11.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司  
2015年8月28日