

华宝兴业服务优选混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
8.6 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.....	73
8.7 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.....	74

8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 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	76
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	79
§12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业服务优选混合型证券投资基金
基金简称	华宝服务优选混合
基金主代码	000124
交易代码	000124
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月27日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,869,347,722.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握服务相关行业的稳步成长，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
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，通过对服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享服务业快速发展所带来的行业高回报。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。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。
业绩比较基准	中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑安国	王洪章

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道100号环球金融中心58楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年	2013年6月27日(基金合同生效)

			日)-2013年12月31日
本期已实现收益	930,028,333.18	103,509,596.52	1,318,254.41
本期利润	1,058,424,004.28	80,673,733.16	47,890,493.14
加权平均基金份额本期利润	1.0339	0.1714	0.0391
本期加权平均净值利润率	46.16%	16.18%	3.82%
本期基金份额净值增长率	123.34%	11.02%	5.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	1,728,750,610.08	40,052,011.66	6,931,683.10
期末可供分配基金份额利润	0.9248	0.1692	0.0062
期末基金资产净值	4,459,468,807.81	276,789,181.37	1,172,925,342.59
期末基金份额净值	2.386	1.169	1.053
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	161.09%	16.90%	5.30%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	39.13%	2.63%	14.48%	1.39%	24.65%	1.24%
过去六个月	0.72%	3.30%	-11.83%	2.20%	12.55%	1.10%
过去一年	123.34%	3.22%	19.70%	2.04%	103.64%	1.18%
自基金合同生效日起至 今	161.09%	2.32%	92.88%	1.49%	68.21%	0.83%

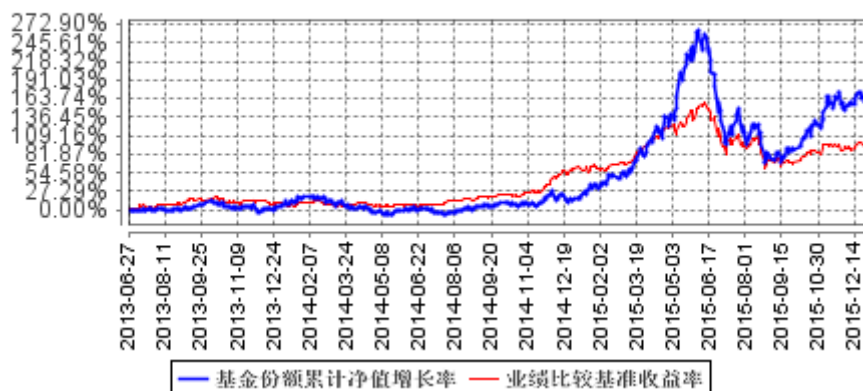
注：1、本基金业绩比较基准为：中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

(2013 年 6 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日)

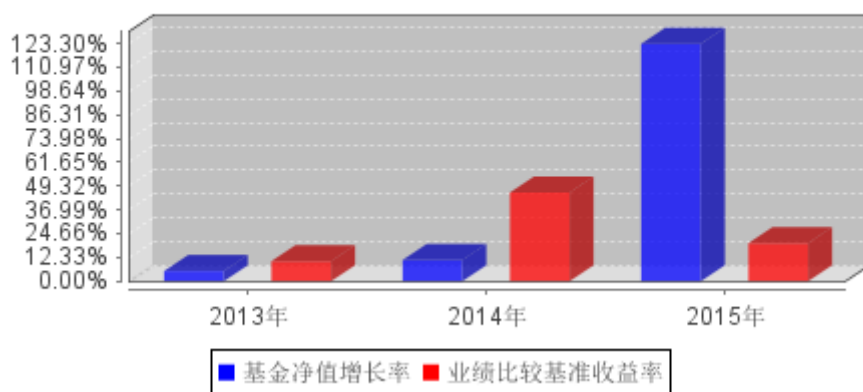
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2013 年 12 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效于 2013 年 6 月 27 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	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	年度利润分配合 计	备注
2015	3.0000	291,237,956.55	101,271,763.88	392,509,720.43	
2014	-	-	-	-	

2013	-	-	-	-	
合计	3.0000	291,237,956.55	101,271,763.88	392,509,720.43	

§ 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 12 月 31 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、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、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业中国互联网和华宝兴业转型升级基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 182,703,481,955.16 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		
楼鸿强	本基金基金经理、华宝万物互联混合基金经理	2014 年 10 月 22 日	-	6 年	硕士。曾在兴业证券研究所从事行业分析工作。2011 年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理的职务。2014 年 10 月起担任华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金经理，2015

					年 6 月兼任华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
邵喆阳	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业收益增长混合、华宝生态中国混合基金经理	2013 年 6 月 27 日	2015 年 2 月 17 日	9 年	硕士，拥有 CFA 资格。曾任安永会计师事务所审计员。2006 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任行业分析师、基金经理助理、国内投资部副总经理的职务。2010 年 6 月至 2015 年 2 月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理，2013 年 6 月至 2015 年 2 月任华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金经理，2014 年 6 月至 2015 年 2 月任助理投资总监，兼任华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金经理。
代云锋	本基金基金经理助理、华宝稳健回报混合基金经理助理	2015 年 7 月 1 日	-	3 年	硕士。2012 年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任研究部分析师、分析师的职务。2015 年 7 月起担任华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金经理助理，兼任华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券

					投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	-------------

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、《华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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，服务优选混合型证券投资基金出现过持有单个股票占基金资产净值比超过 10%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。

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，服务优选混合型证券投资基金出现过持有单个股票占基金资产净值比超过 10%的情况，且由于该股票停牌原因不能及时卖出。发生此类情况后，基金管理人持续关注该股票复牌情况，已在股票复牌后的合理期限内调整，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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，

由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2015 年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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，分析了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；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

4.3.3 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 年市场历经一轮波澜壮阔的牛市和相对剧烈的调整，对大部分市场参与者而言，既是收益较好的年份，也是风险教育的真实一课。

本基金上半年始终保持较高的仓位和弹性，积极布局互联网、精准医疗、高端装备、国企改革等板块，获得较好的收益。3 季度配置较为均衡，防御等待机会，并在 3 季度末较为迅速地高仓位参与反弹，4 季度也获得了较好的收益。整体上，本基金 2015 年采取了相对积极的策略，整体收益较好。

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 123.34%，同期业绩比较基准收益率为 19.70%，基金表现领先业绩比较基准 103.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，我们认为国内宏观经济较大幅度改善的难度较大，经济增长率仍在下台阶过程中，全社会经济要素和杠杆率并未实现较为健康的调整，经济转型和效率提升仍是一个中长期过程。此外，随着全球化进程的基本完成，全球经济金融的联动程度正不断提高，较为复杂的国内外经济形势和人民币汇率波动等问题，有可能制约国内经济转型的进程和相关政策的空间。

2015 年 A 股市场整体表现较好，大部分新兴行业个股的股价和估值仍处于相对较高的位置，需要时间消化。传统行业的机会仍受制于宏观改善的程度，有待观察。如前所述，全球经济及相关政策的联动性在加大，这也增加了市场运行的复杂度。此外，注册制等市场新政策仍需关注。

但是，挑战总是伴随着机遇。相信在全社会的共同努力下，中国经济转型的前景值得看好，也必将诞生一批优秀的公司。整体上，行情结构分化仍是市场趋势，真正优质的行业和公司将为投资者创造中长期的投资价值。

2016 年我们会继续以如履薄冰、如临深渊的谨慎态度和勤勉尽职的工作来回报投资者的支持与信任。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2015 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，不断加强了防控内幕交易等行为的稽核力度；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根

据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

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

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

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

4.8 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 2 日在本基金注册登记机关登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 3.00 元，利润分配合计为人民币 392,509,720.43 元，其中现金形式发放总额为人民币 291,237,956.55 元，再投资形式发放总额为人民币 101,271,763.88 元。

4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 392,509,720.43 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20996 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝兴业服务优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的华宝兴业服务优选混合型证券投资基金(原华宝兴业服务优选股票型证券投资基金，以下简称“华宝兴业服务优选基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华宝兴业服务优选基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括

	<p>对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述华宝兴业服务优选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华宝兴业服务优选基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 张勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 邮政编码 200120
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业服务优选混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	485,441,184.86	43,686,958.46
结算备付金		60,824,977.42	3,611,801.86
存出保证金		7,081,616.89	216,491.85
交易性金融资产	7.4.7.2	3,879,828,277.93	249,023,145.04
其中：股票投资		3,879,828,277.93	249,023,145.04
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收证券清算款		91,174,476.26	-
应收利息	7.4.7.5	144,888.31	9,993.03
应收股利		-	-
应收申购款		33,395,046.75	424,283.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,557,890,468.42	296,972,673.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,016,282.01	14,060,564.97
应付赎回款		34,345,601.12	2,051,058.67
应付管理人报酬		5,471,162.60	362,266.76
应付托管费		911,860.41	60,377.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	52,236,834.49	3,065,525.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	439,919.98	583,698.96
负债合计		98,421,660.61	20,183,492.35
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,869,347,722.30	236,737,169.71
未分配利润	7.4.7.10	2,590,121,085.51	40,052,011.66
所有者权益合计		4,459,468,807.81	276,789,181.37
负债和所有者权益总计		4,557,890,468.42	296,972,673.72

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.386 元，基金份额总额 1,869,347,722.30 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业服务优选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日

一、收入		1,246,354,774.92	96,676,227.38
1. 利息收入		2,931,875.82	640,422.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,931,875.82	607,429.90
债券利息收入		-	42.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	32,950.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,083,088,031.13	115,466,715.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,078,027,432.40	113,872,551.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	160,865.96
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	5,060,598.73	1,433,298.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	128,395,671.10	-22,835,863.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	31,939,196.87	3,404,952.24
减：二、费用		187,930,770.64	16,002,494.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	33,513,204.23	7,575,663.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,585,533.92	1,262,610.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	148,429,341.56	6,729,942.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	402,690.93	434,277.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,058,424,004.28	80,673,733.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,058,424,004.28	80,673,733.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业服务优选混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年12月31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）	236,737,169.71	40,052,011.66	276,789,181.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,058,424,004.28	1,058,424,004.28
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）	1,632,610,552.59	1,884,154,790.00	3,516,765,342.59
其中：1. 基金申购款	4,347,635,361.83	5,373,090,227.51	9,720,725,589.34
2. 基金赎回款	-2,715,024,809.24	-3,488,935,437.51	-6,203,960,246.75
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）	-	-392,509,720.43	-392,509,720.43
五、期末所有者权益（基金净值）	1,869,347,722.30	2,590,121,085.51	4,459,468,807.81
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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）	1,114,290,971.15	58,634,371.44	1,172,925,342.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	80,673,733.16	80,673,733.16
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）	-877,553,801.44	-99,256,092.94	-976,809,894.38
其中：1. 基金申购款	619,619,302.48	68,368,693.65	687,987,996.13
2. 基金赎回款	-1,497,173,103.92	-167,624,786.59	-1,664,797,890.51
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）	236,737,169.71	40,052,011.66	276,789,181.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄小蕙</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业服务优选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业服务优选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 306 号《关于核准华宝兴业服务优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,448,794,551.05 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 395 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,449,066,584.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 272,033.66 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华宝兴业服务优选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业服务优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于服务相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金资产支持证券投资市值不得超过基金资产净值的 20%;本基金权证投资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:80%×中证服务业指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2016 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 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其他相关规定(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(简称中国基金业协会)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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按分红除权日的基金份额净值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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入，及

其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	485,441,184.86	43,686,958.46
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	485,441,184.86	43,686,958.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,727,696,231.46	3,879,828,277.93	152,132,046.47
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	3,727,696,231.46	3,879,828,277.93	152,132,046.47
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,286,769.67	249,023,145.04	23,736,375.37
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	225,286,769.67	249,023,145.04	23,736,375.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	111,097.93	8,097.41
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	30,108.43	1,788.07
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	176.58	0.41
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	3,505.37	107.14
合计	144,888.31	9,993.03

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	52,236,834.49	3,065,525.20
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	52,236,834.49	3,065,525.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	79,919.98	3,698.96
预提费用	360,000.00	580,000.00
合计	439,919.98	583,698.96

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	236,737,169.71	236,737,169.71
本期申购	4,347,635,361.83	4,347,635,361.83
本期赎回（以“-”号填列）	-2,715,024,809.24	-2,715,024,809.24
本期末	1,869,347,722.30	1,869,347,722.30

注：申购含红利再投资和转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	64,652,461.87	-24,600,450.21	40,052,011.66
本期利润	930,028,333.18	128,395,671.10	1,058,424,004.28
本期基金份额交易	1,126,579,535.46	757,575,254.54	1,884,154,790.00

产生的变动数			
其中：基金申购款	3,647,891,167.95	1,725,199,059.56	5,373,090,227.51
基金赎回款	-2,521,311,632.49	-967,623,805.02	-3,488,935,437.51
本期已分配利润	-392,509,720.43	-	-392,509,720.43
本期末	1,728,750,610.08	861,370,475.43	2,590,121,085.51

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	2,281,920.26	575,751.98
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	572,471.41	17,259.67
其他	77,484.15	14,418.25
合计	2,931,875.82	607,429.90

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	48,217,000,564.55	2,472,668,123.95
减：卖出股票成本总额	47,138,973,132.15	2,358,795,572.32
买卖股票差价收入	1,078,027,432.40	113,872,551.63

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	595,665.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	434,000.00
减：应收利息总额	-	799.04
买卖债券差价收入	-	160,865.96

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,060,598.73	1,433,298.19
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,060,598.73	1,433,298.19

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	128,395,671.10	-22,835,863.36
——股票投资	128,395,671.10	-22,660,414.52
——债券投资	-	-175,448.84
——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	128,395,671.10	-22,835,863.36

7.4.7.18 其他收入

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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	27,973,370.80	3,153,854.09
转换费收入	3,965,826.07	251,098.15
合计	31,939,196.87	3,404,952.24

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，对于持续持有期大于等于 30 日的投资人的赎回费总额的 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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	148,429,341.56	6,729,942.28
银行间市场交易费用	-	-
合计	148,429,341.56	6,729,942.28

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	260,000.00	320,000.00
其他	200.00	-
债券帐户维护费	18,000.00	7,500.00
银行费用	24,490.93	6,777.82
合计	402,690.93	434,277.82

7.4.7.21 分部报告

-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	33,513,204.23	7,575,663.50
其中：支付销售机构的客户维护费	9,058,641.23	2,023,791.57

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,585,533.92	1,262,610.62

注：支付基金托管人 中国建设银行 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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	250,156.90	250,156.90
期间申购/买入总份额	195,261.51	-
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	445,418.41	250,156.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%	0.11%

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。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华宝投	14,064,228.78	0.75%	16,050,561.79	6.78%

资有限 公司				
-----------	--	--	--	--

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	485,441,184.86	2,281,920.26	43,686,958.46	575,751.98

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国建设银行 保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比较期均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 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。

7.4.11 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 2 日	2015 年 6 月 2 日	3.0000	291,237,956.55	101,271,763.88	392,509,720.43	
合计	-	-	3.0000	291,237,956.55	101,271,763.88	392,509,720.43	

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发、增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
002612	朗姿 股份	2015 年 12 月 22 日	重大事 项停牌	75.46			2,571,342	147,296,781.20	194,033,467.32	-
300038	梅泰	2015 年 12 月 16 日	重大事	56.68			3,051,728	139,117,706.59	172,971,943.04	-

	诺		项停牌							
300222	科大智能	2015年8月21日	重大事项停牌	20.84	2016年1月7日	21.16	2,675,605	55,081,633.48	55,759,608.20	-
002502	骅威股份	2015年8月20日	重大事项停牌	32.02	2016年1月14日	23.35	1,446,560	41,232,503.41	46,318,851.20	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大事项停牌	49.25	2016年3月10日	44.33	886,625	39,292,305.82	43,666,281.25	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将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经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	485,441,184.86	-	-	-	485,441,184.86
结算备付金	60,824,977.42	-	-	-	60,824,977.42
存出保证金	7,081,616.89	-	-	-	7,081,616.89
交易性金融资产	-	-	-	3,879,828,277.93	3,879,828,277.93
应收证券清算款	-	-	-	91,174,476.26	91,174,476.26
应收利息	-	-	-	144,888.31	144,888.31
应收申购款	737,523.32	-	-	32,657,523.43	33,395,046.75
资产总计	554,085,302.49	-	-	4,003,805,165.93	4,557,890,468.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,016,282.01	5,016,282.01
应付赎回款	-	-	-	34,345,601.12	34,345,601.12
应付管理人报酬	-	-	-	5,471,162.60	5,471,162.60
应付托管费	-	-	-	911,860.41	911,860.41
应付交易费用	-	-	-	52,236,834.49	52,236,834.49
其他负债	-	-	-	439,919.98	439,919.98
负债总计	-	-	-	98,421,660.61	98,421,660.61
利率敏感度缺口	554,085,302.49	-	-	3,905,383,505.32	4,459,468,807.81
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	43,686,958.46	-	-	-	43,686,958.46
结算备付金	3,611,801.86	-	-	-	3,611,801.86
存出保证金	216,491.85	-	-	-	216,491.85
交易性金融资产	-	-	-	249,023,145.04	249,023,145.04
应收利息	-	-	-	9,993.03	9,993.03
应收申购款	2,186.73	-	-	422,096.75	424,283.48
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	47,517,438.90	-	-	249,455,234.82	296,972,673.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,060,564.97	14,060,564.97
应付赎回款	-	-	-	2,051,058.67	2,051,058.67
应付管理人报酬	-	-	-	362,266.76	362,266.76
应付托管费	-	-	-	60,377.79	60,377.79
应付交易费用	-	-	-	3,065,525.20	3,065,525.20
其他负债	-	-	-	583,698.96	583,698.96
负债总计	-	-	-	20,183,492.35	20,183,492.35
利率敏感度缺口	47,517,438.90	-	-	229,271,742.47	276,789,181.37

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：同），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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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，通过对服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享服务业快速发展所带来的行业高回报。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于服务相关行业股票的比例不低于非现金资产的 80%。本基金资产支持证券投资市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金权证投资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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	3,879,828,277.93	87.00	249,023,145.04	89.97
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	3,879,828,277.93	87.00	249,023,145.04	89.97

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日)	上年度末(2014年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	271,878,963.18	14,110,719.39
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-271,878,963.18	-14,110,719.39	

7.4.14 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 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 3,367,078,126.92 元, 属于第二层次的余额为 512,750,151.01 元, 无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日: 第一层次 191,100,122.80 元, 第二层次 57,923,022.24 元, 无第三层次)。

(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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,879,828,277.93	85.12
	其中：股票	3,879,828,277.93	85.12
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	546,266,162.28	11.99
7	其他各项资产	131,796,028.21	2.89
8	合计	4,557,890,468.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	46,382,591.19	1.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,302,967,300.30	51.64
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	97,634,604.00	2.19
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	932,919,587.50	20.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	143,888,744.71	3.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	112,634,591.70	2.53
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,431.28	0.03
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	242,084,427.25	5.43
S	综合	-	-
	合计	3,879,828,277.93	87.00

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 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	002188	新嘉联	6,250,326	277,826,990.70	6.23
2	300248	新开普	5,781,221	214,772,360.15	4.82
3	002612	朗姿股份	2,571,342	194,033,467.32	4.35
4	300230	永利带业	5,136,963	191,968,307.31	4.30
5	300038	梅泰诺	3,051,728	172,971,943.04	3.88
6	000802	北京文化	3,568,116	120,887,770.08	2.71
7	002260	德奥通航	2,401,126	108,530,895.20	2.43
8	000078	海王生物	4,074,900	97,634,604.00	2.19
9	300352	北信源	1,491,645	93,078,648.00	2.09
10	300384	三联虹普	1,075,061	90,520,136.20	2.03
11	002072	凯瑞德	3,729,154	90,320,109.88	2.03
12	603019	中科曙光	975,058	88,896,037.86	1.99
13	300440	运达科技	1,017,110	87,593,513.20	1.96
14	300089	文化长城	2,203,002	87,084,669.06	1.95
15	600622	嘉宝集团	5,012,704	85,165,840.96	1.91
16	300308	中际装备	3,746,921	84,905,229.86	1.90
17	600293	三峡新材	5,642,168	82,770,604.56	1.86
18	300231	银信科技	2,998,981	80,612,609.28	1.81
19	300369	绿盟科技	1,640,384	79,788,277.76	1.79
20	300270	中威电子	3,265,802	77,856,719.68	1.75
21	002656	卡奴迪路	2,623,281	75,052,069.41	1.68
22	300246	宝莱特	1,705,461	70,435,539.30	1.58
23	300051	三五互联	2,493,163	66,068,819.50	1.48
24	002133	广宇集团	6,085,275	58,722,903.75	1.32

25	002467	二六三	2,674,579	56,139,413.21	1.26
26	000681	视觉中国	1,472,959	55,987,171.59	1.26
27	300222	科大智能	2,675,605	55,759,608.20	1.25
28	300486	东杰智能	1,017,871	50,751,048.06	1.14
29	603766	隆鑫通用	1,962,226	46,563,622.98	1.04
30	002477	雏鹰农牧	2,742,909	46,382,591.19	1.04
31	002502	骅威股份	1,446,560	46,318,851.20	1.04
32	300398	飞凯材料	568,284	45,224,040.72	1.01
33	300409	道氏技术	770,050	44,478,088.00	1.00
34	300324	旋极信息	886,625	43,666,281.25	0.98
35	000793	华闻传媒	2,821,986	42,414,449.58	0.95
36	002279	久其软件	600,772	40,672,264.40	0.91
37	300339	润和软件	821,219	39,434,936.38	0.88
38	002381	双箭股份	2,307,279	39,408,325.32	0.88
39	600556	慧球科技	1,455,493	39,400,195.51	0.88
40	300468	四方精创	446,384	37,085,582.72	0.83
41	300448	浩云科技	354,344	35,785,200.56	0.80
42	300241	瑞丰光电	1,977,500	35,595,000.00	0.80
43	002655	共达电声	1,243,700	30,669,642.00	0.69
44	300166	东方国信	915,719	29,330,479.57	0.66
45	002205	国统股份	668,121	26,310,604.98	0.59
46	002446	盛路通信	708,318	26,278,597.80	0.59
47	300309	吉艾科技	1,187,004	26,220,918.36	0.59
48	300458	全志科技	211,800	25,204,200.00	0.57
49	000920	南方汇通	1,027,267	24,685,226.01	0.55
50	002329	皇氏集团	862,647	24,067,851.30	0.54
51	603636	南威软件	243,936	23,861,819.52	0.54
52	300364	中文在线	128,062	22,795,036.00	0.51
53	300125	易世达	660,133	22,114,455.50	0.50
54	002026	山东威达	1,230,743	21,685,691.66	0.49
55	000835	长城动漫	805,000	17,975,650.00	0.40
56	603023	威帝股份	337,140	17,291,910.60	0.39
57	002494	华斯股份	639,860	16,956,290.00	0.38
58	002766	索菱股份	321,804	15,945,388.20	0.36
59	300234	开尔新材	578,569	14,290,654.30	0.32
60	300009	安科生物	213,339	9,233,311.92	0.21
61	300188	美亚柏科	75,286	3,817,000.20	0.09
62	000888	峨眉山 A	88,888	1,316,431.28	0.03
63	300379	东方通	5,230	641,668.70	0.01

64	300113	顺网科技	5,630	570,713.10	0.01
----	--------	------	-------	------------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002657	中科金财	994,161,239.83	359.18
2	300244	迪安诊断	852,912,937.14	308.15
3	300347	泰格医药	828,814,463.55	299.44
4	300075	数字政通	789,618,461.86	285.28
5	300248	新开普	707,297,795.92	255.54
6	300253	卫宁软件	608,660,588.38	219.90
7	300222	科大智能	589,157,696.75	212.85
8	600446	金证股份	512,186,070.36	185.05
9	300033	同花顺	500,370,904.36	180.78
10	000547	航天发展	497,276,031.33	179.66
11	300018	中元华电	444,453,257.61	160.57
12	300049	福瑞股份	439,951,474.36	158.95
13	002642	荣之联	437,473,802.86	158.05
14	300295	三六五网	432,689,436.96	156.32
15	300231	银信科技	427,153,440.10	154.32
16	300364	中文在线	425,544,997.15	153.74
17	002373	千方科技	393,030,272.99	142.00
18	300252	金信诺	392,079,421.88	141.65
19	600570	恒生电子	385,380,224.33	139.23
20	300016	北陆药业	374,112,573.11	135.16
21	002308	威创股份	351,408,786.58	126.96
22	300400	劲拓股份	343,412,138.38	124.07
23	603766	隆鑫通用	341,072,561.63	123.22
24	002462	嘉事堂	334,895,516.28	120.99
25	300130	新国都	321,943,315.03	116.31
26	000858	五粮液	306,564,015.82	110.76
27	600820	隧道股份	305,352,765.91	110.32
28	300165	天瑞仪器	287,742,825.96	103.96

29	603636	南威软件	283,624,285.80	102.47
30	600571	信雅达	282,755,627.91	102.16
31	300178	腾邦国际	277,592,959.84	100.29
32	300254	仟源医药	272,306,377.82	98.38
33	300059	东方财富	271,076,057.78	97.94
34	300409	道氏技术	263,885,213.09	95.34
35	300010	立思辰	255,676,293.70	92.37
36	002074	国轩高科	254,667,741.73	92.01
37	600587	新华医疗	253,491,868.16	91.58
38	300038	梅泰诺	250,476,312.54	90.49
39	300226	上海钢联	249,276,748.83	90.06
40	002022	科华生物	248,248,067.05	89.69
41	000802	北京文化	245,583,074.03	88.73
42	002188	新嘉联	243,430,044.47	87.95
43	002381	双箭股份	240,414,377.98	86.86
44	300377	赢时胜	238,353,107.07	86.11
45	600391	成发科技	233,211,690.59	84.26
46	300140	启源装备	231,356,272.32	83.59
47	300352	北信源	230,557,304.61	83.30
48	600834	申通地铁	228,897,741.08	82.70
49	002260	德奥通航	226,280,261.34	81.75
50	600655	豫园商城	220,556,628.22	79.68
51	000158	常山股份	217,208,252.96	78.47
52	300439	美康生物	216,999,167.20	78.40
53	300468	四方精创	216,488,230.80	78.21
54	600827	百联股份	215,600,705.28	77.89
55	300022	吉峰农机	213,008,075.25	76.96
56	300440	运达科技	211,676,720.68	76.48
57	300144	宋城演艺	209,134,175.64	75.56
58	002466	天齐锂业	207,846,461.16	75.09
59	002472	双环传动	207,016,536.16	74.79
60	002747	埃斯顿	206,900,329.70	74.75
61	601021	春秋航空	205,565,139.88	74.27
62	002460	赣锋锂业	199,923,979.05	72.23
63	600677	航天通信	199,327,698.54	72.01
64	300378	鼎捷软件	196,144,027.53	70.86

65	002060	粤水电	194,311,266.88	70.20
66	601555	东吴证券	193,233,562.65	69.81
67	300166	东方国信	192,620,795.79	69.59
68	300447	全信股份	192,090,514.50	69.40
69	300151	昌红科技	191,087,632.72	69.04
70	601166	兴业银行	190,465,049.14	68.81
71	300230	永利股份	187,614,221.13	67.78
72	002714	牧原股份	187,404,194.93	67.71
73	300398	飞凯材料	186,504,118.62	67.38
74	300404	博济医药	186,480,890.48	67.37
75	300113	顺网科技	184,709,505.74	66.73
76	600895	张江高科	183,159,650.86	66.17
77	300380	安硕信息	179,434,867.54	64.83
78	002589	瑞康医药	177,879,354.65	64.27
79	300379	东方通	175,903,011.23	63.55
80	600663	陆家嘴	174,636,855.29	63.09
81	300413	快乐购	174,284,618.26	62.97
82	300012	华测检测	168,284,832.54	60.80
83	600990	四创电子	165,584,159.00	59.82
84	600410	华胜天成	165,031,099.44	59.62
85	002551	尚荣医疗	163,200,083.82	58.96
86	300155	安居宝	163,122,884.79	58.93
87	600029	南方航空	160,584,805.60	58.02
88	300009	安科生物	159,581,444.05	57.65
89	002477	雏鹰农牧	157,833,726.98	57.02
90	002205	国统股份	157,270,648.68	56.82
91	300392	腾信股份	153,971,797.49	55.63
92	601988	中国银行	151,934,263.14	54.89
93	300147	香雪制药	150,434,869.86	54.35
94	601288	农业银行	149,751,297.28	54.10
95	300442	普丽盛	148,675,508.09	53.71
96	601377	兴业证券	148,300,083.07	53.58
97	002612	朗姿股份	147,296,781.20	53.22
98	600009	上海机场	147,224,765.73	53.19
99	600172	黄河旋风	146,917,416.22	53.08
100	002594	比亚迪	145,420,741.68	52.54

101	300356	光一科技	142,964,743.14	51.65
102	600138	中青旅	141,345,894.71	51.07
103	000568	泸州老窖	140,747,081.63	50.85
104	300251	光线传媒	140,314,931.40	50.69
105	600038	中直股份	139,353,265.03	50.35
106	300186	大华农	138,778,202.16	50.14
107	300171	东富龙	136,723,747.02	49.40
108	300003	乐普医疗	135,974,046.83	49.13
109	002279	久其软件	134,358,279.39	48.54
110	002363	隆基机械	134,121,959.58	48.46
111	600749	西藏旅游	133,954,995.40	48.40
112	600109	国金证券	133,506,523.61	48.23
113	002332	仙琚制药	131,119,576.08	47.37
114	300367	东方网力	131,075,649.62	47.36
115	300397	天和防务	130,948,213.22	47.31
116	002184	海得控制	130,229,321.13	47.05
117	300238	冠昊生物	129,895,215.64	46.93
118	300131	英唐智控	128,230,050.04	46.33
119	300336	新文化	125,347,768.84	45.29
120	300399	京天利	125,115,847.27	45.20
121	002609	捷顺科技	124,025,366.14	44.81
122	002344	海宁皮城	123,883,589.51	44.76
123	300223	北京君正	122,136,762.08	44.13
124	002436	兴森科技	121,842,528.71	44.02
125	600115	东方航空	121,427,129.33	43.87
126	002108	沧州明珠	120,468,408.75	43.52
127	601318	中国平安	116,036,877.41	41.92
128	600292	中电远达	115,767,347.84	41.83
129	601211	国泰君安	113,433,315.90	40.98
130	002425	凯撒股份	112,619,241.50	40.69
131	600513	联环药业	112,171,483.44	40.53
132	002372	伟星新材	110,883,132.66	40.06
133	002445	中南重工	110,663,763.17	39.98
134	002518	科士达	110,600,525.23	39.96
135	300219	鸿利光电	110,320,150.35	39.86
136	600879	航天电子	106,643,330.61	38.53

137	600701	工大高新	106,009,480.18	38.30
138	603019	中科曙光	105,154,023.07	37.99
139	002026	山东威达	104,427,489.61	37.73
140	600645	中源协和	103,926,322.17	37.55
141	002715	登云股份	103,469,486.08	37.38
142	601398	工商银行	103,359,931.69	37.34
143	002329	皇氏集团	102,842,326.61	37.16
144	600276	恒瑞医药	101,946,098.17	36.83
145	002290	禾盛新材	101,338,467.89	36.61
146	000906	物产中拓	100,879,004.43	36.45
147	300133	华策影视	100,775,893.91	36.41
148	300198	纳川股份	99,601,445.78	35.98
149	300051	三五互联	99,225,937.08	35.85
150	600343	航天动力	98,603,220.72	35.62
151	300384	三联虹普	98,103,364.11	35.44
152	300250	初灵信息	97,311,623.01	35.16
153	600622	嘉宝集团	97,191,749.26	35.11
154	002664	信质电机	97,156,116.97	35.10
155	002072	凯瑞德	96,712,014.98	34.94
156	002025	航天电器	96,150,141.17	34.74
157	002746	仙坛股份	95,847,006.66	34.63
158	300213	佳讯飞鸿	93,241,850.37	33.69
159	300369	绿盟科技	93,170,368.49	33.66
160	002457	青龙管业	92,896,242.10	33.56
161	002711	欧浦智网	92,571,395.36	33.44
162	002299	圣农发展	92,481,506.91	33.41
163	000673	当代东方	91,801,526.46	33.17
164	300145	南方泵业	91,285,036.45	32.98
165	300416	苏试试验	91,210,419.14	32.95
166	600596	新安股份	90,883,226.12	32.83
167	000948	南天信息	90,492,191.46	32.69
168	601898	中煤能源	89,722,616.59	32.42
169	002400	省广股份	89,681,305.54	32.40
170	002133	广宇集团	89,657,680.14	32.39
171	000800	一汽轿车	89,468,708.00	32.32
172	002693	双成药业	89,418,601.02	32.31

173	600016	民生银行	89,067,396.32	32.18
174	300089	文化长城	88,862,551.01	32.10
175	600576	万家文化	88,245,453.04	31.88
176	600077	宋都股份	88,115,977.44	31.84
177	002271	东方雨虹	87,925,798.44	31.77
178	300246	宝莱特	87,596,561.23	31.65
179	600986	科达股份	87,295,011.39	31.54
180	600530	交大昂立	87,290,608.38	31.54
181	000516	国际医学	86,611,168.16	31.29
182	300168	万达信息	86,556,464.26	31.27
183	002262	恩华药业	86,429,149.61	31.23
184	000998	隆平高科	86,032,424.23	31.08
185	600556	慧球科技	85,769,257.74	30.99
186	000633	合金投资	85,460,430.01	30.88
187	002405	四维图新	85,188,521.58	30.78
188	000078	海王生物	84,975,222.26	30.70
189	600293	三峡新材	84,969,091.18	30.70
190	002261	拓维信息	84,940,495.94	30.69
191	601007	金陵饭店	84,553,182.15	30.55
192	300335	迪森股份	84,344,871.71	30.47
193	300271	华宇软件	84,329,484.15	30.47
194	002615	哈尔斯	84,141,820.73	30.40
195	000509	华塑控股	84,135,739.30	30.40
196	300043	互动娱乐	83,967,435.07	30.34
197	300308	中际装备	83,345,532.68	30.11
198	600449	宁夏建材	83,201,026.58	30.06
199	600837	海通证券	82,170,103.62	29.69
200	300114	中航电测	82,112,923.44	29.67
201	300068	南都电源	82,097,993.21	29.66
202	300031	宝通科技	81,650,889.18	29.50
203	002055	得润电子	81,432,782.92	29.42
204	300270	中威电子	81,397,659.67	29.41
205	600118	中国卫星	81,184,838.19	29.33
206	002284	亚太股份	81,174,044.78	29.33
207	600590	泰豪科技	80,683,842.65	29.15
208	002447	壹桥海参	80,152,149.35	28.96

209	002443	金洲管道	80,052,242.91	28.92
210	002568	百润股份	79,967,531.83	28.89
211	300287	飞利信	79,959,462.94	28.89
212	601328	交通银行	79,763,017.36	28.82
213	300079	数码视讯	79,109,846.11	28.58
214	002256	彩虹精化	79,063,747.83	28.56
215	002494	华斯股份	78,501,320.45	28.36
216	000722	湖南发展	78,357,518.23	28.31
217	300304	云意电气	78,031,996.50	28.19
218	002162	悦心健康	77,069,072.44	27.84
219	600716	凤凰股份	76,937,265.39	27.80
220	600612	老凤祥	76,672,040.09	27.70
221	300125	易世达	76,589,819.65	27.67
222	300419	浩丰科技	76,543,190.34	27.65
223	002338	奥普光电	75,824,155.47	27.39
224	600483	福能股份	75,736,811.78	27.36
225	002385	大北农	75,608,975.10	27.32
226	300119	瑞普生物	74,508,005.24	26.92
227	300457	赢合科技	74,413,663.19	26.88
228	300396	迪瑞医疗	74,358,825.00	26.86
229	300448	浩云科技	74,003,054.49	26.74
230	600501	航天晨光	73,887,297.78	26.69
231	002520	日发精机	73,864,064.58	26.69
232	000728	国元证券	73,812,324.07	26.67
233	600969	郴电国际	73,317,990.27	26.49
234	002343	禾欣股份	73,186,670.01	26.44
235	002656	卡奴迪路	73,014,429.14	26.38
236	300098	高新兴	72,019,136.42	26.02
237	600559	老白干酒	71,771,237.82	25.93
238	002351	漫步者	71,686,046.67	25.90
239	002766	索菱股份	71,585,620.79	25.86
240	000681	视觉中国	71,578,018.44	25.86
241	002668	奥马电器	71,449,755.36	25.81
242	600651	飞乐音响	71,357,890.53	25.78
243	600855	航天长峰	70,690,994.38	25.54
244	601599	鹿港科技	70,475,823.67	25.46

245	600654	中安消	70,447,864.67	25.45
246	002045	国光电器	70,217,263.37	25.37
247	300205	天喻信息	69,791,623.65	25.21
248	300426	唐德影视	69,554,633.68	25.13
249	000955	欣龙控股	69,529,686.00	25.12
250	002707	众信旅游	69,500,963.96	25.11
251	002516	旷达科技	69,350,865.02	25.06
252	300389	艾比森	69,146,912.82	24.98
253	000831	五矿稀土	69,146,409.92	24.98
254	002502	骅威股份	68,791,614.18	24.85
255	300450	先导智能	68,516,399.22	24.75
256	300045	华力创通	68,428,013.69	24.72
257	300273	和佳股份	68,187,711.13	24.64
258	603939	益丰药房	67,660,730.07	24.44
259	002538	司尔特	67,453,239.18	24.37
260	300058	蓝色光标	67,441,982.09	24.37
261	600552	方兴科技	67,411,441.11	24.35
262	300339	润和软件	67,269,985.87	24.30
263	002467	二六三	66,885,166.63	24.16
264	601628	中国人寿	66,491,940.68	24.02
265	300463	迈克生物	65,523,679.44	23.67
266	600108	亚盛集团	64,240,865.39	23.21
267	300167	迪威视讯	63,335,758.53	22.88
268	600598	北大荒	63,282,343.94	22.86
269	300019	硅宝科技	63,276,023.92	22.86
270	600351	亚宝药业	63,070,859.74	22.79
271	600814	杭州解百	62,760,947.58	22.67
272	002157	正邦科技	62,715,846.73	22.66
273	002273	水晶光电	61,877,633.86	22.36
274	002124	天邦股份	61,382,641.50	22.18
275	000793	华闻传媒	60,776,114.33	21.96
276	600685	中船防务	60,491,257.08	21.85
277	300006	莱美药业	60,385,765.50	21.82
278	600177	雅戈尔	59,930,473.37	21.65
279	600594	益佰制药	59,746,583.82	21.59
280	002576	通达动力	59,641,878.23	21.55

281	002153	石基信息	59,393,353.63	21.46
282	300030	阳普医疗	59,020,260.34	21.32
283	600028	中国石化	59,002,803.03	21.32
284	300291	华录百纳	58,825,103.29	21.25
285	300274	阳光电源	58,614,378.92	21.18
286	002030	达安基因	58,061,057.17	20.98
287	300036	超图软件	58,011,199.63	20.96
288	002303	美盈森	56,629,970.33	20.46
289	600531	豫光金铅	56,547,000.17	20.43
290	300027	华谊兄弟	56,144,779.98	20.28
291	002182	云海金属	56,071,089.02	20.26
292	002070	众和股份	55,739,344.66	20.14
293	300470	日机密封	54,999,917.66	19.87
294	603918	金桥信息	54,580,251.56	19.72
295	300486	东杰智能	54,567,016.49	19.71
296	600282	南钢股份	54,505,227.93	19.69
297	300358	楚天科技	54,211,700.45	19.59
298	300085	银之杰	53,834,725.55	19.45
299	603718	海利生物	53,746,115.50	19.42
300	601688	华泰证券	52,579,084.00	19.00
301	002296	辉煌科技	51,951,834.88	18.77
302	300109	新开源	51,582,721.57	18.64
303	300005	探路者	50,657,213.86	18.30
304	002095	生意宝	50,562,037.79	18.27
305	300455	康拓红外	50,456,179.16	18.23
306	002020	京新药业	50,230,495.71	18.15
307	002312	三泰控股	49,389,413.98	17.84
308	300299	富春通信	49,323,366.90	17.82
309	002302	西部建设	49,104,322.50	17.74
310	300211	亿通科技	48,980,204.75	17.70
311	002321	华英农业	48,837,461.35	17.64
312	601169	北京银行	48,757,940.94	17.62
313	000538	云南白药	48,210,711.41	17.42
314	002234	民和股份	47,959,745.69	17.33
315	600637	东方明珠	47,938,012.53	17.32
316	600958	东方证券	47,799,603.40	17.27

317	000732	泰禾集团	47,644,164.38	17.21
318	002318	久立特材	47,370,153.08	17.11
319	300418	昆仑万维	47,104,673.50	17.02
320	600491	龙元建设	46,813,085.75	16.91
321	002172	澳洋科技	46,294,407.26	16.73
322	600305	恒顺醋业	46,251,975.78	16.71
323	002439	启明星辰	46,026,691.26	16.63
324	002390	信邦制药	45,851,955.31	16.57
325	300078	思创医惠	45,583,608.75	16.47
326	600547	山东黄金	45,268,715.58	16.35
327	300237	美晨科技	44,355,169.38	16.02
328	002565	上海绿新	43,914,386.77	15.87
329	600079	人福医药	43,895,197.63	15.86
330	600489	中金黄金	43,883,052.28	15.85
331	601899	紫金矿业	43,608,114.32	15.75
332	002141	蓉胜超微	43,568,583.30	15.74
333	002566	益盛药业	43,221,458.10	15.62
334	601126	四方股份	43,166,010.04	15.60
335	300188	美亚柏科	42,625,735.50	15.40
336	002224	三力士	42,394,504.50	15.32
337	002276	万马股份	41,845,890.25	15.12
338	300004	南风股份	41,193,286.76	14.88
339	002446	盛路通信	41,168,894.24	14.87
340	000963	华东医药	41,146,290.93	14.87
341	002727	一心堂	40,902,329.74	14.78
342	002142	宁波银行	39,878,754.23	14.41
343	000783	长江证券	39,599,228.59	14.31
344	300146	汤臣倍健	39,534,960.21	14.28
345	300324	旋极信息	39,292,305.82	14.20
346	603368	柳州医药	39,120,863.77	14.13
347	002317	众生药业	39,095,996.25	14.12
348	002488	金固股份	39,000,147.75	14.09
349	002771	真视通	38,674,426.06	13.97
350	300096	易联众	38,387,085.26	13.87
351	000920	南方汇通	37,888,847.62	13.69
352	300348	长亮科技	37,719,031.50	13.63

353	600519	贵州茅台	36,763,303.48	13.28
354	600185	格力地产	36,082,845.16	13.04
355	300241	瑞丰光电	35,881,469.10	12.96
356	600517	置信电气	35,664,490.36	12.89
357	002023	海特高新	35,179,237.25	12.71
358	300314	戴维医疗	34,828,953.79	12.58
359	600030	中信证券	34,024,696.00	12.29
360	002155	湖南黄金	33,383,111.11	12.06
361	601918	国投新集	33,276,494.53	12.02
362	000018	神州长城	33,022,328.27	11.93
363	000423	东阿阿胶	33,014,843.02	11.93
364	002197	证通电子	32,072,038.68	11.59
365	000638	万方发展	32,033,120.24	11.57
366	002100	天康生物	32,017,169.97	11.57
367	000797	中国武夷	32,013,505.07	11.57
368	002048	宁波华翔	31,215,328.50	11.28
369	300086	康芝药业	31,167,212.14	11.26
370	002407	多氟多	31,162,931.64	11.26
371	002655	共达电声	30,908,887.18	11.17
372	002496	辉丰股份	30,906,252.20	11.17
373	600055	华润万东	30,858,547.77	11.15
374	000561	烽火电子	30,751,733.93	11.11
375	300414	中光防雷	30,252,416.72	10.93
376	600251	冠农股份	29,964,296.53	10.83
377	300451	创业软件	29,661,923.92	10.72
378	300128	锦富新材	29,561,301.78	10.68
379	002123	荣信股份	29,275,918.55	10.58
380	002137	麦达数字	28,951,981.40	10.46
381	300170	汉得信息	28,194,971.85	10.19
382	300212	易华录	28,167,100.15	10.18
383	300465	高伟达	27,511,219.00	9.94
384	300309	吉艾科技	26,992,341.87	9.75
385	002159	三特索道	26,840,811.70	9.70
386	601800	中国交建	26,389,561.84	9.53
387	600284	浦东建设	26,336,377.40	9.51
388	600674	川投能源	26,264,476.17	9.49

389	002673	西部证券	25,741,941.18	9.30
390	002665	首航节能	25,710,627.83	9.29
391	601669	中国电建	25,249,204.99	9.12
392	600850	华东电脑	24,966,707.49	9.02
393	002215	诺普信	24,667,788.03	8.91
394	300458	全志科技	24,396,518.61	8.81
395	002375	亚厦股份	24,280,207.38	8.77
396	601901	方正证券	23,661,152.97	8.55
397	000807	云铝股份	23,602,104.62	8.53
398	600699	均胜电子	23,245,184.87	8.40
399	002151	北斗星通	23,231,901.81	8.39
400	601788	光大证券	23,210,667.20	8.39
401	600153	建发股份	23,164,877.13	8.37
402	600502	安徽水利	23,138,208.72	8.36
403	600739	辽宁成大	22,882,728.51	8.27
404	000776	广发证券	22,769,184.98	8.23
405	603168	莎普爱思	22,585,945.96	8.16
406	002513	蓝丰生化	22,421,349.03	8.10
407	000721	西安饮食	21,781,938.60	7.87
408	300063	天龙集团	21,669,712.54	7.83
409	603883	老百姓	21,603,095.20	7.80
410	600780	通宝能源	20,978,438.28	7.58
411	000603	盛达矿业	20,852,177.61	7.53
412	600648	外高桥	20,701,944.33	7.48
413	000513	丽珠集团	20,463,425.04	7.39
414	300467	迅游科技	20,416,273.50	7.38
415	600572	康恩贝	20,344,956.81	7.35
416	002611	东方精工	20,095,728.74	7.26
417	002051	中工国际	19,497,601.79	7.04
418	600376	首开股份	19,318,361.88	6.98
419	300390	天华超净	19,079,871.56	6.89
420	002717	岭南园林	18,874,467.00	6.82
421	600728	佳都科技	18,518,634.02	6.69
422	603555	贵人鸟	18,228,211.14	6.59
423	000835	长城动漫	18,008,779.09	6.51
424	603023	威帝股份	17,942,008.50	6.48

425	002152	广电运通	17,808,323.34	6.43
426	000166	申万宏源	17,391,223.19	6.28
427	300284	苏交科	17,188,197.39	6.21
428	601009	南京银行	17,133,572.56	6.19
429	600358	国旅联合	17,078,061.40	6.17
430	603222	济民制药	16,817,626.10	6.08
431	002699	美盛文化	16,261,638.00	5.88
432	600761	安徽合力	16,059,434.38	5.80
433	002316	键桥通讯	16,009,296.47	5.78
434	300359	全通教育	16,005,413.00	5.78
435	600893	中航动力	15,998,578.89	5.78
436	000710	天兴仪表	15,894,725.83	5.74
437	600266	北京城建	15,516,257.64	5.61
438	002285	世联行	15,377,436.65	5.56
439	002004	华邦健康	15,349,399.36	5.55
440	002415	海康威视	15,302,719.20	5.53
441	600518	康美药业	15,174,311.39	5.48
442	002587	奥拓电子	14,981,238.45	5.41
443	002183	怡亚通	14,979,915.00	5.41
444	600270	外运发展	14,545,302.49	5.26
445	002175	东方网络	14,291,822.40	5.16
446	300234	开尔新材	13,658,010.43	4.93
447	600885	宏发股份	13,583,294.35	4.91
448	002366	台海核电	13,556,125.00	4.90
449	600308	华泰股份	13,440,018.69	4.86
450	002138	顺络电子	13,331,433.55	4.82
451	000061	农产品	13,315,535.00	4.81
452	600257	大湖股份	13,195,358.44	4.77
453	002146	荣盛发展	13,151,585.50	4.75
454	300341	麦迪电气	12,921,155.00	4.67
455	600970	中材国际	12,885,639.15	4.66
456	300255	常山药业	12,646,719.72	4.57
457	300101	振芯科技	12,642,640.20	4.57
458	300162	雷曼股份	12,574,873.00	4.54
459	600588	用友网络	12,437,282.00	4.49
460	300142	沃森生物	12,344,522.49	4.46

461	600420	现代制药	12,228,439.30	4.42
462	000024	招商地产	11,925,213.52	4.31
463	002236	大华股份	11,895,687.62	4.30
464	002139	拓邦股份	11,681,375.08	4.22
465	600126	杭钢股份	11,630,667.40	4.20
466	002280	联络互动	11,262,352.10	4.07
467	600048	保利地产	11,218,230.77	4.05
468	002465	海格通信	11,069,095.01	4.00
469	300206	理邦仪器	10,760,342.64	3.89
470	300232	洲明科技	10,038,282.95	3.63
471	300242	明家科技	9,931,345.33	3.59
472	600584	长电科技	9,878,451.14	3.57
473	002309	中利科技	9,614,721.38	3.47
474	002433	太安堂	9,107,151.33	3.29
475	300446	乐凯新材	9,058,718.00	3.27
476	600826	兰生股份	8,684,336.00	3.14
477	300331	苏大维格	8,312,201.88	3.00
478	600208	新湖中宝	7,816,717.30	2.82
479	002063	远光软件	7,760,993.30	2.80
480	600741	华域汽车	7,734,219.05	2.79
481	601607	上海医药	7,691,349.00	2.78
482	300037	新宙邦	7,686,268.44	2.78
483	002364	中恒电气	7,667,059.71	2.77
484	600005	武钢股份	7,510,722.00	2.71
485	600060	海信电器	7,443,024.00	2.69
486	002586	围海股份	7,434,114.32	2.69
487	002018	华信国际	7,318,602.00	2.64
488	300298	三诺生物	7,317,676.12	2.64
489	300199	翰宇药业	7,290,632.85	2.63
490	000961	中南建设	7,263,899.87	2.62
491	300408	三环集团	7,155,160.00	2.59
492	300376	易事特	7,099,823.95	2.57
493	600809	山西汾酒	7,082,092.95	2.56
494	000911	南宁糖业	7,062,735.11	2.55
495	000100	TCL 集团	6,973,753.00	2.52
496	300334	津膜科技	6,961,326.70	2.52

497	300070	碧水源	6,953,896.63	2.51
498	600135	乐凯胶片	6,942,489.62	2.51
499	000400	许继电气	6,884,492.00	2.49
500	601668	中国建筑	6,877,853.00	2.48
501	601186	中国铁建	6,874,022.00	2.48
502	300227	光韵达	6,817,544.00	2.46
503	300449	汉邦高科	6,788,251.50	2.45
504	300290	荣科科技	6,564,001.50	2.37
505	600418	江淮汽车	6,507,513.23	2.35
506	600008	首创股份	6,174,687.00	2.23
507	002084	海鸥卫浴	6,104,888.19	2.21
508	002358	森源电气	6,077,548.55	2.20
509	600406	国电南瑞	5,744,637.00	2.08

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002657	中科金财	1,054,271,243.41	380.89
2	300244	迪安诊断	883,119,623.48	319.06
3	300347	泰格医药	837,135,249.11	302.45
4	300075	数字政通	836,574,901.64	302.24
5	300253	卫宁软件	635,991,338.66	229.77
6	600446	金证股份	576,973,515.58	208.45
7	300222	科大智能	548,542,706.65	198.18
8	300033	同花顺	500,660,113.57	180.88
9	300295	三六五网	492,302,158.72	177.86
10	000547	航天发展	486,954,834.32	175.93
11	300248	新开普	465,598,115.70	168.21
12	300016	北陆药业	450,469,088.90	162.75
13	002642	荣之联	446,352,001.32	161.26
14	300018	中元华电	440,666,075.84	159.21
15	300231	银信科技	435,079,225.48	157.19
16	300364	中文在线	428,854,372.77	154.94
17	300049	福瑞股份	426,244,188.42	154.00
18	002373	千方科技	396,858,402.27	143.38

19	600570	恒生电子	378,991,440.66	136.92
20	300252	金信诺	365,660,560.96	132.11
21	300130	新国都	334,983,990.29	121.02
22	300400	劲拓股份	328,646,402.51	118.74
23	002308	威创股份	327,250,480.53	118.23
24	002462	嘉事堂	326,079,002.49	117.81
25	300178	腾邦国际	319,510,224.08	115.43
26	300010	立思辰	310,378,536.55	112.14
27	603766	隆鑫通用	308,213,880.36	111.35
28	600571	信雅达	305,222,112.27	110.27
29	600820	隧道股份	295,516,872.74	106.77
30	603636	南威软件	286,417,570.31	103.48
31	000858	五粮液	283,053,275.84	102.26
32	300226	上海钢联	281,613,609.83	101.74
33	300140	启源装备	272,359,197.36	98.40
34	300059	东方财富	272,188,063.31	98.34
35	002466	天齐锂业	266,890,743.07	96.42
36	300377	赢时胜	266,208,023.49	96.18
37	002074	国轩高科	266,156,446.92	96.16
38	300254	仟源医药	265,071,584.25	95.77
39	300151	昌红科技	252,531,137.38	91.24
40	600587	新华医疗	252,340,577.25	91.17
41	300380	安硕信息	247,649,337.88	89.47
42	002022	科华生物	247,298,373.69	89.35
43	300165	天瑞仪器	243,596,994.09	88.01
44	002460	赣锋锂业	237,507,316.20	85.81
45	601021	春秋航空	232,483,160.58	83.99
46	300439	美康生物	225,794,593.25	81.58
47	002381	双箭股份	220,532,765.20	79.68
48	300409	道氏技术	219,946,115.17	79.46
49	600834	申通地铁	218,285,748.82	78.86
50	600655	豫园商城	215,981,776.85	78.03
51	600827	百联股份	215,604,288.14	77.89
52	300447	全信股份	215,433,588.28	77.83
53	600391	成发科技	214,898,451.85	77.64
54	601555	东吴证券	212,354,476.04	76.72
55	000158	常山股份	211,699,840.89	76.48
56	300378	鼎捷软件	204,951,271.97	74.05

57	002747	埃斯顿	200,042,797.87	72.27
58	300113	顺网科技	199,858,913.14	72.21
59	300144	宋城演艺	199,175,741.97	71.96
60	600677	航天通信	197,277,048.03	71.27
61	601166	兴业银行	195,664,941.67	70.69
62	300012	华测检测	194,780,688.30	70.37
63	300392	腾信股份	194,386,049.34	70.23
64	002472	双环传动	194,225,135.50	70.17
65	300022	吉峰农机	191,606,781.90	69.22
66	300468	四方精创	189,533,338.73	68.48
67	002589	瑞康医药	189,144,545.81	68.34
68	300379	东方通	185,624,474.37	67.06
69	002060	粤水电	182,467,510.11	65.92
70	300413	快乐购	179,496,171.61	64.85
71	600895	张江高科	173,030,645.40	62.51
72	002714	牧原股份	171,237,891.85	61.87
73	300404	博济医药	170,926,162.82	61.75
74	600410	华胜天成	169,426,361.80	61.21
75	600663	陆家嘴	167,709,505.36	60.59
76	300166	东方国信	167,381,707.29	60.47
77	300009	安科生物	165,131,276.52	59.66
78	300147	香雪制药	163,579,637.50	59.10
79	601377	兴业证券	161,408,562.06	58.31
80	300442	普丽盛	159,072,895.32	57.47
81	300155	安居宝	158,759,682.79	57.36
82	600038	中直股份	157,852,505.74	57.03
83	601988	中国银行	157,036,731.91	56.74
84	600029	南方航空	155,249,712.25	56.09
85	300251	光线传媒	154,862,526.30	55.95
86	601288	农业银行	153,514,689.36	55.46
87	002551	尚荣医疗	152,919,951.47	55.25
88	600990	四创电子	149,933,676.11	54.17
89	300223	北京君正	148,033,365.29	53.48
90	300352	北信源	147,186,613.55	53.18
91	002594	比亚迪	145,955,344.61	52.73
92	002363	隆基机械	144,013,720.36	52.03
93	300238	冠昊生物	142,984,553.13	51.66
94	600172	黄河旋风	142,319,001.33	51.42

95	600009	上海机场	140,891,617.46	50.90
96	300398	飞凯材料	138,672,254.58	50.10
97	300356	光一科技	138,300,176.33	49.97
98	300397	天和防务	137,619,743.99	49.72
99	002332	仙琚制药	137,386,422.46	49.64
100	002108	沧州明珠	137,019,999.41	49.50
101	300171	东富龙	136,900,822.04	49.46
102	600138	中青旅	136,679,870.68	49.38
103	000802	北京文化	135,793,774.93	49.06
104	002205	国统股份	135,088,896.43	48.81
105	300131	英唐智控	134,825,623.10	48.71
106	300003	乐普医疗	133,972,419.33	48.40
107	600513	联环药业	133,801,810.45	48.34
108	300038	梅泰诺	133,576,758.55	48.26
109	600749	西藏旅游	133,116,282.02	48.09
110	600109	国金证券	132,279,566.90	47.79
111	300186	大华农	127,511,410.46	46.07
112	300367	东方网力	126,321,273.04	45.64
113	300399	京天利	126,227,842.55	45.60
114	300440	运达科技	125,533,593.62	45.35
115	002260	德奥通航	125,522,202.88	45.35
116	600292	中电远达	123,011,540.70	44.44
117	002436	兴森科技	122,389,699.74	44.22
118	002184	海得控制	121,658,010.10	43.95
119	000568	泸州老窖	120,221,084.59	43.43
120	600115	东方航空	119,282,013.67	43.09
121	002372	伟星新材	116,045,978.57	41.93
122	002344	海宁皮城	115,652,164.76	41.78
123	601318	中国平安	114,694,101.18	41.44
124	300336	新文化	114,652,746.93	41.42
125	300250	初灵信息	112,713,142.93	40.72
126	002715	登云股份	112,280,465.32	40.57
127	300219	鸿利光电	111,450,242.04	40.27
128	002664	信质电机	110,706,870.15	40.00
129	600879	航天电子	109,289,915.98	39.48
130	002343	禾欣股份	108,615,192.83	39.24
131	002445	中南重工	108,168,351.90	39.08
132	600701	工大高新	107,926,477.31	38.99

133	002425	凯撒股份	106,925,040.66	38.63
134	002609	捷顺科技	104,993,784.95	37.93
135	601211	国泰君安	104,527,833.83	37.76
136	600276	恒瑞医药	104,290,481.07	37.68
137	002477	雏鹰农牧	103,130,562.05	37.26
138	002279	久其软件	103,096,570.75	37.25
139	601398	工商银行	102,480,659.51	37.02
140	002271	东方雨虹	100,880,294.19	36.45
141	300198	纳川股份	100,751,977.39	36.40
142	002518	科士达	100,635,218.68	36.36
143	002070	众和股份	100,054,607.47	36.15
144	000906	物产中拓	99,449,889.30	35.93
145	300133	华策影视	99,291,782.74	35.87
146	300043	互动娱乐	98,183,916.16	35.47
147	002025	航天电器	97,005,037.68	35.05
148	300304	云意电气	96,607,440.89	34.90
149	600986	科达股份	96,273,024.53	34.78
150	002329	皇氏集团	96,027,650.77	34.69
151	002290	禾盛新材	94,874,239.13	34.28
152	000673	当代东方	94,819,340.60	34.26
153	002457	青龙管业	94,756,748.02	34.23
154	300145	南方泵业	94,169,418.21	34.02
155	300416	苏试试验	93,955,283.38	33.94
156	002707	众信旅游	93,751,817.17	33.87
157	601007	金陵饭店	93,121,967.76	33.64
158	300213	佳讯飞鸿	93,062,996.67	33.62
159	002284	亚太股份	92,348,820.37	33.36
160	002262	恩华药业	92,260,630.40	33.33
161	600501	航天晨光	91,760,367.17	33.15
162	300168	万达信息	90,964,282.32	32.86
163	600837	海通证券	90,211,523.55	32.59
164	600343	航天动力	90,048,500.19	32.53
165	002405	四维图新	89,861,495.31	32.47
166	000722	湖南发展	89,524,632.52	32.34
167	600016	民生银行	89,405,603.65	32.30
168	600576	万家文化	88,001,585.72	31.79
169	002026	山东威达	87,894,468.03	31.76
170	601898	中煤能源	87,796,362.39	31.72

171	002261	拓维信息	87,136,579.26	31.48
172	002746	仙坛股份	87,132,814.67	31.48
173	300114	中航电测	87,042,810.63	31.45
174	002299	圣农发展	86,971,010.23	31.42
175	600118	中国卫星	86,254,218.86	31.16
176	600716	凤凰股份	86,177,610.67	31.13
177	002338	奥普光电	85,776,197.70	30.99
178	300068	南都电源	85,503,045.54	30.89
179	300287	飞利信	84,999,416.11	30.71
180	002711	欧浦智网	84,101,092.08	30.38
181	600077	宋都股份	83,981,788.65	30.34
182	600596	新安股份	83,923,530.81	30.32
183	600855	航天长峰	83,853,249.50	30.29
184	000948	南天信息	83,428,603.54	30.14
185	000800	一汽轿车	83,237,293.81	30.07
186	002256	彩虹精化	83,198,557.54	30.06
187	600645	中源协和	83,130,453.54	30.03
188	000633	合金投资	83,080,429.03	30.02
189	002693	双成药业	83,075,802.36	30.01
190	000998	隆平高科	83,005,714.64	29.99
191	002443	金洲管道	82,995,251.80	29.99
192	600530	交大昂立	82,882,371.78	29.94
193	000516	国际医学	82,187,368.64	29.69
194	300271	华宇软件	81,547,301.73	29.46
195	000728	国元证券	81,275,234.73	29.36
196	002055	得润电子	80,409,523.29	29.05
197	300045	华力创通	80,261,444.10	29.00
198	002447	壹桥海参	79,877,062.67	28.86
199	300031	宝通科技	79,606,839.71	28.76
200	300463	迈克生物	79,125,947.48	28.59
201	600449	宁夏建材	79,017,112.36	28.55
202	002400	省广股份	78,527,217.05	28.37
203	002615	哈尔斯	77,795,936.20	28.11
204	000509	华塑控股	77,748,492.95	28.09
205	300335	迪森股份	76,115,394.67	27.50
206	002520	日发精机	75,504,426.13	27.28
207	002568	百润股份	75,353,364.34	27.22
208	300396	迪瑞医疗	74,545,918.32	26.93

209	600612	老凤祥	74,320,647.02	26.85
210	300205	天喻信息	74,277,430.66	26.84
211	601328	交通银行	74,157,060.71	26.79
212	300098	高新兴	73,913,234.78	26.70
213	600590	泰豪科技	73,754,374.86	26.65
214	300450	先导智能	73,241,985.28	26.46
215	600651	飞乐音响	73,068,222.05	26.40
216	002385	大北农	72,981,688.14	26.37
217	603939	益丰药房	72,319,962.98	26.13
218	300079	数码视讯	72,168,514.01	26.07
219	601628	中国人寿	71,982,426.29	26.01
220	000955	欣龙控股	71,883,129.51	25.97
221	300419	浩丰科技	71,167,072.05	25.71
222	002668	奥马电器	71,160,909.73	25.71
223	002494	华斯股份	70,908,993.25	25.62
224	002351	漫步者	70,530,654.09	25.48
225	300119	瑞普生物	69,749,491.90	25.20
226	002516	旷达科技	69,398,595.58	25.07
227	300457	赢合科技	69,098,027.62	24.96
228	002162	悦心健康	68,309,264.30	24.68
229	300167	迪威视讯	67,909,322.91	24.53
230	002095	生意宝	67,267,536.17	24.30
231	300058	蓝色光标	67,128,836.01	24.25
232	300273	和佳股份	66,956,020.65	24.19
233	002045	国光电器	66,831,184.56	24.15
234	603918	金桥信息	65,962,173.34	23.83
235	300036	超图软件	65,905,072.19	23.81
236	600351	亚宝药业	65,882,704.82	23.80
237	601688	华泰证券	65,617,010.59	23.71
238	300426	唐德影视	64,896,032.95	23.45
239	000831	五矿稀土	64,842,333.29	23.43
240	600814	杭州解百	64,687,080.42	23.37
241	300389	艾比森	64,530,331.78	23.31
242	600177	雅戈尔	64,242,117.51	23.21
243	601599	鹿港科技	64,041,852.14	23.14
244	600552	方兴科技	64,013,800.85	23.13
245	600654	中安消	63,373,274.97	22.90
246	600483	福能股份	63,202,664.63	22.83

247	002538	司尔特	62,891,641.20	22.72
248	600598	北大荒	62,208,738.85	22.48
249	002172	澳洋科技	61,611,301.32	22.26
250	002030	达安基因	61,517,782.30	22.23
251	002273	水晶光电	61,317,789.74	22.15
252	300125	易世达	61,155,685.93	22.09
253	600969	郴电国际	60,821,855.77	21.97
254	300274	阳光电源	60,319,109.71	21.79
255	600108	亚盛集团	58,546,013.14	21.15
256	002576	通达动力	58,467,220.81	21.12
257	300019	硅宝科技	58,347,225.48	21.08
258	600594	益佰制药	58,253,308.53	21.05
259	600559	老白干酒	57,220,590.61	20.67
260	600028	中国石化	57,068,938.74	20.62
261	600531	豫光金铅	57,055,458.57	20.61
262	002157	正邦科技	57,020,584.79	20.60
263	002303	美盈森	56,614,701.96	20.45
264	002439	启明星辰	56,526,182.08	20.42
265	600685	中船防务	56,059,022.60	20.25
266	300470	日机密封	55,524,044.40	20.06
267	300109	新开源	55,180,047.81	19.94
268	002020	京新药业	54,852,214.02	19.82
269	002153	石基信息	54,490,744.91	19.69
270	600958	东方证券	54,180,007.19	19.57
271	002124	天邦股份	54,160,485.22	19.57
272	300006	莱美药业	54,011,042.85	19.51
273	002766	索菱股份	53,946,947.98	19.49
274	300030	阳普医疗	53,618,902.67	19.37
275	002182	云海金属	53,315,393.15	19.26
276	300358	楚天科技	52,542,834.06	18.98
277	002312	三泰控股	52,054,902.82	18.81
278	603718	海利生物	52,048,448.40	18.80
279	300291	华录百纳	51,460,079.22	18.59
280	300418	昆仑万维	50,785,802.38	18.35
281	300211	亿通科技	50,693,669.88	18.31
282	300027	华谊兄弟	50,663,564.72	18.30
283	600282	南钢股份	50,621,921.75	18.29
284	002318	久立特材	50,435,964.89	18.22

285	600637	东方明珠	49,969,280.18	18.05
286	300455	康拓红外	49,563,561.61	17.91
287	000538	云南白药	49,542,319.43	17.90
288	600305	恒顺醋业	49,394,169.50	17.85
289	000732	泰禾集团	49,372,539.33	17.84
290	002276	万马股份	48,825,012.51	17.64
291	300085	银之杰	48,711,442.07	17.60
292	601169	北京银行	48,261,123.59	17.44
293	002234	民和股份	47,878,019.11	17.30
294	300005	探路者	47,780,329.92	17.26
295	300299	富春通信	47,585,677.79	17.19
296	300078	思创医惠	46,680,449.87	16.86
297	601126	四方股份	46,214,323.98	16.70
298	600079	人福医药	46,131,762.71	16.67
299	002390	信邦制药	46,111,140.28	16.66
300	600491	龙元建设	45,636,809.87	16.49
301	300051	三五互联	44,755,946.81	16.17
302	002302	西部建设	44,733,731.09	16.16
303	000783	长江证券	44,684,828.81	16.14
304	002566	益盛药业	44,642,851.18	16.13
305	002321	华英农业	43,994,392.60	15.89
306	300146	汤臣倍健	43,988,392.39	15.89
307	002565	上海绿新	43,404,888.13	15.68
308	300004	南风股份	43,116,688.02	15.58
309	600556	慧球科技	42,699,583.32	15.43
310	002317	众生药业	42,277,190.81	15.27
311	002296	辉煌科技	42,232,117.04	15.26
312	002771	真视通	41,476,773.29	14.98
313	002488	金固股份	40,475,387.70	14.62
314	300096	易联众	39,952,557.00	14.43
315	000963	华东医药	39,880,235.16	14.41
316	002141	睿胜超微	39,045,558.06	14.11
317	603368	柳州医药	38,940,256.06	14.07
318	002142	宁波银行	38,415,507.41	13.88
319	000018	神州长城	38,035,484.38	13.74
320	002727	一心堂	37,683,902.45	13.61
321	600030	中信证券	37,402,571.84	13.51
322	600519	贵州茅台	37,220,273.55	13.45

323	002224	三力士	37,214,592.82	13.45
324	300188	美亚柏科	37,034,727.76	13.38
325	601899	紫金矿业	36,508,887.08	13.19
326	300237	美晨科技	36,508,053.97	13.19
327	600517	置信电气	36,135,749.18	13.06
328	600547	山东黄金	36,021,437.62	13.01
329	300339	润和软件	35,649,567.70	12.88
330	300086	康芝药业	35,378,395.69	12.78
331	002407	多氟多	35,169,765.88	12.71
332	300314	戴维医疗	35,130,340.78	12.69
333	600489	中金黄金	35,127,810.12	12.69
334	600185	格力地产	34,915,950.30	12.61
335	300348	长亮科技	34,357,072.75	12.41
336	002023	海特高新	33,918,929.45	12.25
337	000423	东阿阿胶	33,412,609.92	12.07
338	000561	烽火电子	32,205,935.18	11.64
339	300465	高伟达	31,879,527.80	11.52
340	002137	麦达数字	31,718,914.24	11.46
341	002197	证通电子	31,330,121.12	11.32
342	600055	华润万东	31,222,050.98	11.28
343	000638	万方发展	31,192,642.99	11.27
344	300448	浩云科技	31,055,954.24	11.22
345	002496	辉丰股份	31,051,135.69	11.22
346	002048	宁波华翔	30,810,209.20	11.13
347	300315	掌趣科技	30,446,183.14	11.00
348	600251	冠农股份	30,425,889.29	10.99
349	300170	汉得信息	30,020,702.18	10.85
350	300128	锦富新材	29,959,053.97	10.82
351	002100	天康生物	29,943,603.59	10.82
352	601918	国投新集	29,678,512.43	10.72
353	002123	荣信股份	28,969,643.51	10.47
354	603168	莎普爱思	28,666,047.50	10.36
355	300414	中光防雷	28,004,927.92	10.12
356	600674	川投能源	27,997,034.68	10.11
357	002133	广宇集团	27,047,813.36	9.77
358	002665	首航节能	26,783,038.83	9.68
359	600284	浦东建设	26,672,187.52	9.64
360	300451	创业软件	26,322,075.07	9.51

361	300212	易华录	26,254,231.57	9.49
362	002502	骅威股份	26,102,380.09	9.43
363	600699	均胜电子	26,058,714.24	9.41
364	601800	中国交建	25,984,498.32	9.39
365	000797	中国武夷	25,428,873.83	9.19
366	002155	湖南黄金	25,421,003.76	9.18
367	601669	中国电建	25,264,231.00	9.13
368	000807	云铝股份	24,575,562.58	8.88
369	002375	亚厦股份	24,312,353.43	8.78
370	600850	华东电脑	24,299,955.72	8.78
371	002215	诺普信	24,285,017.99	8.77
372	601901	方正证券	24,131,441.61	8.72
373	000721	西安饮食	23,720,382.16	8.57
374	002673	西部证券	23,554,940.20	8.51
375	601788	光大证券	23,472,217.86	8.48
376	000513	丽珠集团	23,307,282.09	8.42
377	600502	安徽水利	23,218,496.60	8.39
378	600739	辽宁成大	23,068,314.37	8.33
379	000776	广发证券	22,979,307.00	8.30
380	300467	迅游科技	22,709,275.66	8.20
381	600780	通宝能源	22,704,753.47	8.20
382	300063	天龙集团	22,644,013.89	8.18
383	002159	三特索道	22,010,257.84	7.95
384	600153	建发股份	21,786,060.15	7.87
385	000603	盛达矿业	21,732,411.15	7.85
386	002513	蓝丰生化	21,315,979.22	7.70
387	002151	北斗星通	21,225,996.10	7.67
388	601009	南京银行	21,009,482.28	7.59
389	600572	康恩贝	20,820,200.86	7.52
390	600622	嘉宝集团	20,294,172.21	7.33
391	603883	老百姓	19,997,522.92	7.22
392	002611	东方精工	19,823,342.10	7.16
393	600728	佳都科技	19,546,072.41	7.06
394	300246	宝莱特	19,482,353.49	7.04
395	603555	贵人鸟	19,414,324.66	7.01
396	600376	首开股份	19,000,326.15	6.86
397	000024	招商地产	18,998,202.15	6.86
398	002004	华邦健康	18,798,067.05	6.79

399	600358	国旅联合	18,789,199.30	6.79
400	600648	外高桥	18,744,723.48	6.77
401	002146	荣盛发展	18,630,941.62	6.73
402	002717	岭南园林	18,468,275.60	6.67
403	600048	保利地产	18,315,530.43	6.62
404	300284	苏交科	18,211,528.19	6.58
405	002051	中工国际	18,001,937.91	6.50
406	603222	济民制药	17,544,994.98	6.34
407	300390	天华超净	17,428,456.34	6.30
408	600518	康美药业	17,092,630.69	6.18
409	300101	振芯科技	16,971,735.47	6.13
410	000166	申万宏源	16,970,500.00	6.13
411	002152	广电运通	16,485,292.00	5.96
412	002316	键桥通讯	16,135,918.25	5.83
413	002699	美盛文化	16,122,960.21	5.82
414	002446	盛路通信	15,835,304.14	5.72
415	300359	全通教育	15,767,427.60	5.70
416	000710	天兴仪表	15,740,816.02	5.69
417	000793	华闻传媒	15,722,992.30	5.68
418	600266	北京城建	15,671,229.57	5.66
419	600761	安徽合力	15,668,690.47	5.66
420	600893	中航动力	15,648,584.65	5.65
421	002183	怡亚通	15,443,035.72	5.58
422	002587	奥拓电子	15,363,697.83	5.55
423	002415	海康威视	15,345,379.70	5.54
424	300341	麦迪电气	15,116,376.92	5.46
425	300255	常山药业	15,092,890.82	5.45
426	600270	外运发展	14,272,169.72	5.16
427	002138	顺络电子	14,150,443.14	5.11
428	600970	中材国际	14,044,910.22	5.07
429	002188	新嘉联	13,885,615.13	5.02
430	002285	世联行	13,764,935.88	4.97
431	600885	宏发股份	13,760,675.69	4.97
432	000961	中南建设	13,442,847.20	4.86
433	000681	视觉中国	13,410,092.86	4.84
434	300142	沃森生物	13,313,825.28	4.81
435	600308	华泰股份	13,263,331.77	4.79
436	600257	大湖股份	13,222,464.00	4.78

437	000920	南方汇通	13,147,022.00	4.75
438	000061	农产品	12,957,003.57	4.68
439	002467	二六三	12,615,181.58	4.56
440	300162	雷曼股份	12,456,463.50	4.50
441	002366	台海核电	12,435,868.24	4.49
442	002280	联络互动	12,370,134.23	4.47
443	600208	新湖中宝	12,367,908.86	4.47
444	002236	大华股份	12,073,323.55	4.36
445	600126	杭钢股份	11,662,972.93	4.21
446	300242	明家科技	11,633,908.22	4.20
447	002175	东方网络	11,571,726.80	4.18
448	600420	现代制药	11,396,015.08	4.12
449	600588	用友网络	11,391,910.00	4.12
450	002139	拓邦股份	11,100,762.22	4.01
451	002465	海格通信	11,078,008.66	4.00
452	300206	理邦仪器	10,864,908.26	3.93
453	600584	长电科技	10,043,036.00	3.63
454	600741	华域汽车	9,982,170.30	3.61
455	002433	太安堂	9,315,616.93	3.37
456	002309	中利科技	9,296,531.93	3.36
457	300296	利亚德	9,235,003.99	3.34
458	002586	围海股份	8,933,196.64	3.23
459	300270	中威电子	8,914,929.94	3.22
460	603019	中科曙光	8,855,735.00	3.20
461	600826	兰生股份	8,687,941.94	3.14
462	000939	凯迪生态	8,660,222.54	3.13
463	300446	乐凯新材	8,640,639.30	3.12
464	300331	苏大维格	8,227,391.00	2.97
465	601607	上海医药	8,000,052.43	2.89
466	002063	远光软件	7,804,363.80	2.82
467	300298	三诺生物	7,735,089.17	2.79
468	300369	绿盟科技	7,655,940.78	2.77
469	300037	新宙邦	7,548,588.28	2.73
470	300290	荣科科技	7,505,424.86	2.71
471	600005	武钢股份	7,481,479.24	2.70
472	600060	海信电器	7,477,389.58	2.70
473	600135	乐凯胶片	7,475,671.09	2.70
474	300232	洲明科技	7,437,484.27	2.69

475	300199	翰宇药业	7,436,834.35	2.69
476	002364	中恒电气	7,340,351.68	2.65
477	300334	津膜科技	7,272,093.50	2.63
478	601186	中国铁建	7,250,507.00	2.62
479	000002	万科 A	7,228,655.86	2.61
480	000100	TCL 集团	7,212,245.42	2.61
481	600809	山西汾酒	7,160,645.83	2.59
482	601668	中国建筑	7,159,805.00	2.59
483	000911	南宁糖业	7,109,403.65	2.57
484	300408	三环集团	7,050,352.46	2.55
485	300376	易事特	7,025,094.09	2.54
486	002018	华信国际	6,977,234.61	2.52
487	000400	许继电气	6,866,968.48	2.48
488	300227	光韵达	6,690,885.06	2.42
489	300070	碧水源	6,656,642.93	2.40
490	600418	江淮汽车	6,640,650.94	2.40
491	300089	文化长城	6,588,993.64	2.38
492	002084	海鸥卫浴	6,159,283.78	2.23
493	600008	首创股份	6,137,857.09	2.22
494	300449	汉邦高科	6,089,238.54	2.20
495	002358	森源电气	6,047,806.13	2.18
496	000069	华侨城 A	5,877,768.10	2.12
497	002469	三维工程	5,815,670.91	2.10
498	600406	国电南瑞	5,615,435.61	2.03
499	600036	招商银行	5,571,778.73	2.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 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	50,641,382,593.94
卖出股票收入（成交）总额	48,217,000,564.55

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

新开普（300248）于 2015 年 7 月 31 日收到中国证券监督管理委员会河南监管局《关于对新开普电子股份有限公司实施出具警示函措施的决定》，因公司违反《上市公司信息披露管理办法》以及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，河南证监局对公司采取出具了警示函的监管措施，并记入证券期货诚信档案。同时要求公司董事、监事、高级管理人员应着重加强对信息披露和内幕信息管理相关法律法规的学习，对以上问题提出切实可行的整改措施与计划，并在收到本决定书之日起 30 日内向河南证监局提交书面报告。

德奥通航（002260）于 2015 年 6 月 15 日收到深圳证券交易所《关于对广东伊立浦电器股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》，因公司未及时履行信息披露义务，决定对公司给予通报批评的处分，同时对公司董事长朱家钢、副董事长兼总经理王正年、董事兼副总经理王鑫文、副总经理兼董事会秘书陈国辉、财务总监张之珩给予通报批评的处分，并记入上市公司诚

信档案。

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八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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	7,081,616.89
2	应收证券清算款	91,174,476.26
3	应收股利	-
4	应收利息	144,888.31
5	应收申购款	33,395,046.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,796,028.21

8.12.4 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。

8.12.5 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	002612	朗姿股份	194,033,467.32	4.35	重大事项停牌
2	300038	梅泰诺	172,971,943.04	3.88	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
159,735	11,702.81	721,887,606.08	38.62%	1,147,460,116.22	61.38%

9.2 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	911,675.41	0.0488%

9.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年6月27日）基金份额总额	1,449,066,584.71
本报告期期初基金份额总额	236,737,169.71
本报告期基金总申购份额	4,347,635,361.83
减：本报告期基金总赎回份额	2,715,024,809.24
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	1,869,347,722.30

注：总申购份额含红利再投和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本报告期内，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

基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 100,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2013 年 6 月 27 日）起至本报告期末。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国信证券	1	15,469,014,352.00	15.65%	14,121,220.64	15.62%	-
国泰君安	2	13,195,548,222.23	13.35%	12,059,047.62	13.34%	-
长江证券	1	11,875,396,520.61	12.01%	10,982,597.02	12.14%	-
海通证券	2	11,104,579,132.04	11.23%	10,016,806.47	11.08%	-
中信证券	1	10,644,861,298.76	10.77%	9,839,337.95	10.88%	-
招商证券	1	5,476,710,219.81	5.54%	4,990,923.52	5.52%	-
华泰联合	1	4,822,266,631.75	4.88%	4,437,587.94	4.91%	-
兴业证券	2	4,637,552,059.52	4.69%	4,239,804.90	4.69%	-
银河证券	1	4,239,698,415.19	4.29%	3,840,853.43	4.25%	-
中信建投	2	3,807,493,032.16	3.85%	3,530,518.12	3.90%	-
东方证券	1	2,914,741,958.04	2.95%	2,656,204.71	2.94%	-
中投证券	1	2,690,390,559.00	2.72%	2,436,732.84	2.69%	-
华创证券	1	2,481,496,369.20	2.51%	2,261,387.44	2.50%	-
上海证券	1	1,666,832,282.53	1.69%	1,518,985.35	1.68%	-
浙商证券	1	1,529,375,470.19	1.55%	1,393,718.13	1.54%	-
民生证券	1	1,356,839,581.99	1.37%	1,223,638.43	1.35%	-
方正证券	1	487,364,732.58	0.49%	453,882.21	0.50%	-
中金国际	1	458,222,320.89	0.46%	426,741.30	0.47%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：财力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，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；适当的区域分散化。

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

2、本报告期新增的交易单元为海通证券、银河证券、浙商证券、东方证券、上海证券、兴业证券、华创证券、中信建投、方正证券、招商证券、爱建证券、东吴证券、东北证券。

11.7.2 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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华宝兴业服务优选混合型证券投资基金在中国工商银行股份有限公司	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人	2015 年 12 月 3 日

	公司开通转换业务的公告	网站	
2	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业服务优选混合型证券投资基金增加代销机构的公告	《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 11 月 24 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金开展定期定额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 10 月 29 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平安证券有限责任公司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 10 月 20 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限的公告	《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 9 月 29 日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海陆金所资产管理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 9 月 1 日
7	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上海浦东发展银行网上银行、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 8 月 3 日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于	《中国证券报》、《证	2015 年 8 月 3 日

	旗下部分开放式基金增加申万宏源西部证券有限公司为代销机构的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
9	关于旗下部分基金开展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7月31日
10	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中信期货有限公司为代销机构的公告	《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7月27日
11	华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同	《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7月22日
12	华宝兴业服务优选混合型证券投资基金托管协议	《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7月22日
13	华宝兴业基金管理有限公司关于修改华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金名称及基金合同的公告	《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7月22日
14	华宝兴业服务优选股票型证券投资基金恢复大额申购（含定投及转换转入）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7月15日

15	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7月14日
16	华宝兴业服务优选股票型证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）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7月4日
17	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7月1日
18	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
19	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
20	华宝兴业服务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
21	华宝兴业服务优选股票型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	《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5月28日
22	华宝兴业服务优选股票型证券投资	《中国证券报》、《证	2015年4月24日

	资基金调整大额申购（含定投及转换转入）上限的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
23	华宝兴业服务优选股票型证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）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 4 月 17 日
24	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
25	关于调整华宝兴业直销 e 网金基金申购优惠费率的公告	《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 20 日
26	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中国国际金融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 10 日
27	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
28	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华泰证券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 3 月 2 日
29	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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2015 年 3 月 2 日

	销售有限公司申购费率优惠活动的公告	报》以及基金管理人网站	
30	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金经理变更公告	《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 17 日
31	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
32	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

§ 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；
 华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同；
 华宝兴业服务优选混合型证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业服务优选混合型证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 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。

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
2016 年 3 月 28 日