

华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

2015 半年度报告摘要

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		514,499,890.83
卖出股票收入(成交)总额		723,477,048.02

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 期末按品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(沪、深)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	损益说明
IF1507	IF1507	-107	-140,496,200.04	88,529,040.00	-
IF1509	IF1509	-3	-3,032,040.00	-460,330.00	-
公允价值变动合计(元)					18,279,709.07
股指期货持仓收益(元)					-62,900,522.19
股指期货持仓净收益(元)					-44,620,813.12

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作,规避市场系统性风险。在完成套保的理念下,本基金根据股票资产组合价值与股指期货合约公允价值,并根据市场变化对股指期货合约头寸量进行动态跟踪并适时调整。同时,综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在不同股指期货合约之间进行动态配置,并适时进行合约展期操作,以求得投资组合收益和套期保值的效果。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金主要运用国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未运用国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未运用国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

招商南油于2014年4月4日因自身工作操作疏忽致其承主的大冶有色金属集团控股有限公司2013年报及2014年一季度未能按期披露,受到深圳证券交易所交易商协会谴责函批评。

“中国平安证券公司平安证券有限责任公司(以下简称“平安证券”)于2014年12月8日收到《中国证监会行政处罚决定书》(2014)1103号。处罚原因是平安证券出具的保荐意见书存在虚假记载,且未审慎核查海联讯公开发行募集资金文件的真实性,并擅自修改、删除部分数据,中国证监会决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入4,000元,没收承销业务收入2,897元,并处以40万元罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和析,认为上述处罚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于上述股票的投资并未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的投资主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 报告期末各项资产构成

单位:人民币元		名称	金额
1	存出保证金		14,819,362.83
2	应收证券清算款		5,706,562.65
3	应收利息		22,170.36
4	应收股利		22,169,204.79
5	其他应收款		-
6	其他		-
7	合计		42,714,640.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.1 期末基金持有人户数及持有人结构

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	持有人户数	户均持有的基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者
	</			

8.2 期末基金基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	基金管理人	持有份额(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	华宝兴业量化对冲策略C	1,310,961.49	2.6989%
	华宝兴业量化对冲策略A	3,810,769.76	1.8714%

8.3 期末基金基金管理人的从业人员持有本开放式基金总份额区间的情况

项目	份额类别	持有基金份额区间数量(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人(含高级管理人员)持有本基金	华宝兴业量化对冲策略C	>100
	华宝兴业量化对冲策略A	50-100
合计		>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业量化对冲策略C	10-50
	华宝兴业量化对冲策略A	50-100
合计		50-100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	份额类别	持有基金份额区间数量(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人(含高级管理人员)持有本基金	华宝兴业量化对冲策略C	>100
	华宝兴业量化对冲策略A	50-100
合计		>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业量化对冲策略C	10-50
	华宝兴业量化对冲策略A	50-100
合计		50-100

注:1、本基金基金管理人、基金管理人运用自有资金、基金管理人高级管理人员及基金基金经理等人员使用自有资金作为发起资金认购1,000万元用于认购本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起存续期不少于3年;

2、本基金基金管理人运用自有资金于2014年9月12日通过本公司官网认购本基金作为发起资金的认购费用为1,000元;本基金基金管理人运用自有资金认购的基金份额作为发起资金的认购费用为0.3%;本基金基金管理人运用自有资金认购的基金份额作为发起资金的认购费用为0.3%。符合基金合同招募说明书等法律文件的约定。

5 9 开放式基金业绩变动

项目	华宝兴业量化对冲策略A	华宝兴业量化对冲策略C
基金合同生效日(2014年9月17日)基金资产净值	639,001,068.45	67,427,012.12
基金合同生效日(2014年9月17日)基金份额总额	322,160,084.09	41,819,762.43
基金合同生效日(2014年9月17日)基金份额净值	197.35,442.06	90.406,530.21
截至本报告期末(2015年6月30日)基金资产净值	336,436,960.10	62,009,967.30
截至本报告期末(2015年6月30日)基金份额总额	1,684,512.28	674,217.11
截至本报告期末(2015年6月30日)基金份额净值	194.51,569.03	91.25,347.04

注:总申购份额转换转入份额;总赎回份额转换转出份额。

10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.基金管理人重大人事变动

2.基金托管人重大人事变动

3.基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

10.3 涉及基金诉讼、仲裁事项及基金业务诉讼

10.4 基金投资范围的变更

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或处分情况

1.报告期内基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

2.报告期内基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

3.报告期内基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

10.7 基金运用证券公司交易单元进行证券投资及交易情况

10.8 基金运用证券公司交易单元进行股指期货及期货交易情况

10.9 基金运用证券公司交易单元进行国债期货及期货交易情况

10.10 基金运用证券公司交易单元进行权证投资及期货交易情况

10.11 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.12 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

1.基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

2.基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

3.基金管理人、基金托管人、基金销售机构等人员变动

10.13 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.14 基金运用证券公司交易单元进行股指期货及期货交易情况

10.15 基金运用证券公司交易单元进行国债期货及期货交易情况

10.16 基金运用证券公司交易单元进行权证投资及期货交易情况

10.17 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.18 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.19 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.20 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.21 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.22 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.23 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.24 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.25 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.26 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.27 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.28 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.29 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.30 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.31 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.32 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.33 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.34 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.35 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.36 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.37 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.38 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.39 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.40 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.41 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.42 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.43 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.44 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.45 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.46 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.47 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.48 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.49 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.50 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.51 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.52 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.53 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.54 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.55 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.56 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.57 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.58 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.59 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.60 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.61 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.62 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.63 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.64 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.65 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.66 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.67 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.68 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.69 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.70 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.71 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.72 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.73 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.74 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.75 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.76 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.77 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.78 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.79 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.80 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.81 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.82 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.83 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.84 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.85 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.86 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.87 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.88 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.89 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.90 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.91 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.92 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.93 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.94 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.95 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.96 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.97 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.98 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.99 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.100 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.101 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.102 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.103 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.104 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.105 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.106 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.107 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.108 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.109 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.110 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.111 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.112 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.113 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.114 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.115 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.116 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.117 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.118 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.119 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.120 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

10.121 基金运用证券公司交易单元进行融资融券及期货交易情况

10.122 基金运用证券公司交易单元进行其他证券投资及期货交易情况

</