

(上接B055版)

法定代表人: 龙增来
联系电话: 0755-82023442
传真: 0755-82026359
联系人: 刘毅
客服电话: 400 600 8008, 95632
网站: www.china-invs.cn
(41) 安信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人: 牛冠兴
联系电话: 0755-82583823
传真: 0755-82583855
联系人: 陈剑虹
客服电话: 4008-001-001
公司网址: www.essence.com.cn
(42) 中国国际金融股份有限公司
住所: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层
法定代表人: 丁学东
基金代销业务联系人: 罗春蓉、陈康、康楠
联系电话: 010-65051166
传真: 010-65058065
客户服务电话: 400-910-1166
(43) 民生证券有限责任公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人: 余政
联系人: 赵明
联系电话: 010-85127622
联系传真: 010-85127917
网站: www.mszzq.com
客户服务电话: 4006198888
(44) 中泰证券股份有限公司
注册地址: 山东省济南市市中区经七路86号
办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人: 李玮
联系人: 吴阳
电话: 0531-68889155
传真: 0531-68889752
客服电话: 95638
网站: www.qtzq.com.cn
(45) 华福证券有限责任公司
地址: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人: 黄金琳
客服电话: 96326 (福建省外请加0691)
公司网址: www.hfzq.com.cn
(46) 信达证券股份有限公司
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
联系人: 唐静
联系电话: 010-63081000
传真: 010-63080978
客服电话: 400-900-8899
公司网址: www.cindasc.com
(47) 江海证券有限公司
注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人: 孙名扬
联系人: 刘禹
电话: 0451-859863719
传真: 0451-82287211
客户服务热线: 400-666-2288
网站: www.jhzq.com.cn
(48) 国都证券股份有限公司
注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人: 常喆
客户服务电话: 400-818-8118
网站: www.guodu.com
(49) 东兴证券股份有限公司
公司名称: 东兴证券股份有限公司
住所: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人: 徐勇力
基金销售联系人: 汤漫川
电话: 010-66565316
传真: 010-66565246
公司网站: www.dxzq.net.cn
公司客户服务电话: 400-8888-993
(50) 东北证券股份有限公司
注册地址: 长春市自由大路1138号
办公地址: 长春市自由大路1138号
法定代表人: 杨树财
电话: 0431-85096157
传真: 0431-85096795
客服电话: 4006000686
网站: www.nesc.cn
(51) 德邦证券股份有限公司
名称: 德邦证券股份有限公司
住所: 上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼
办公地址: 上海市浦东新区600号城建国际中心26楼
邮政编码: 200122
注册资本: 16.9亿元人民币
法定代表人: 姚文平
联系人: 朱磊
联系电话: 862168761616-8507
传真: 862168767981
(52) 华安证券股份有限公司
注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路190号
办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人: 李工
公司电话: 0651-65161666
传真: 0651-65161660
网站: www.hazq.com
客户服务电话: 96518 (安徽)、400-80-96518 (全国)
(53) 上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市西藏中路336号
办公地址: 上海市西藏中路336号
法定代表人: 龚德雄
联系人: 许曼华
电话: 021-53519888
传真: 021-53519888
网站: www.962518.com
客户服务电话: 4006918918, 021-962518
(54) 方正证券股份有限公司
注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
公司地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人: 雷杰
全国统一客服热线: 95571
方正证券网站: www.foundersc.com
(55) 东海证券股份有限公司
注册地址: 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人: 朱科敏
电话: 021-20333333
传真: 021-50498925
客服电话: 95531; 400-8888-588
网站: www.longone.com.cn
(56) 中航证券有限公司
注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人: 王宜四
联系人: 戴静
联系电话: 0791-86769681
客服电话: 400-8866-567
公司网址: www.avicsec.com
(57) 山西证券股份有限公司
注册地址: 山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址: 山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
联系人: 郭耀
联系电话: 0351-8686659
传真: 0351-8686619
客户服务电话: 400-666-1618, 95573
公司网址: www.j618.com.cn
(58) 申万宏源西部证券有限公司
注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(邮编: 830002)
法定代表人: 许建平
电话: 010-88085888
传真: 010-88085196 客户服务电话: 400-800-0562
网站: www.hysec.com
联系人: 李巍
(59) 中信期货有限公司
注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
注册资本: 1604792982元人民币
法定代表人: 张皓
联系人: 洪诚
电话: 0755-23963913
传真: 0755-83217421
客户服务电话: 400-990-8826
网站: www.citicfc.com
(60) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 上海市虹口区广顺路360弄9号3724室
办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路32号C楼2楼
法定代表人: 汪静波
联系人: 方成
联系电话: 021-38609777
公司网址: www.noah-fund.com
客户服务电话: 400-821-5399
(61) 深圳腾元基金销售有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810
办公地址: 深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810
法定代表人: 曾基
业务联系人: 廖蔚莎
联系电话: 0755-33376922
公司网址: www.tenyuanfund.com
客户服务电话: 4006-877-889
(62) 和讯信息科技有限公司
注册地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人: 王莉
电话: 021-20835788
传真: 021-20835879
客户服务电话: 400-920-0022
公司网址: l.licaike.hexun.com
(63) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人: 王树
电话: 010-58325396
传真: 010-58325282
客户服务电话: 400-166-1188
网站: http://t.8.jrj.com.cn
(64) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人: 薛峰
电话: 0755-33227950
传真: 0755-33227951
公司网址: www.zlfund.cn www.jmmw.com
客服电话: 4006-788-887
(65) 杭州数米基金销售有限公司
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道358号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
电话: 0571-28829790, 021-60897869
传真: 0571-266989533
客服热线: 4000-766-123
公司网址: http://www.fund123.cn/
(66) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路196号3C座9楼
注册资本: 人民币伍仟万元
法定代表人: 其实
电话: 021-54509988
传真: 021-64385308
公司网址: www.1234567.com.cn
客户服务电话: 400-1818-188
(67) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室
法定代表人: 凌顺平
电话: 0571-88911818
传真: 0571-88910240
网站: www.5ifund.com
客服: 4008-773-772
(68) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法人名称: 沈伟伟
销售网站: www.yixinfund.com
客服电话: 400-6099-200
(69) 中经北证(北京)资产管理有限公司
注册地址: 北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法人代表名称: 徐福慧
办公地址: 北京市西城区车公庄大街4号1号楼1层
电话: 010-68998820
传真: 010-88381560
网站: www.bzfunds.com
客服电话: 400-600-0030
(70) 上海好买基金销售有限公司
办公地址: 上海市浦东新区1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人: 杨文斌
电话: 021-58870011
传真: 021-68596919
客服热线: 400-700-9665
好买基金交易网: www.ehowbuy.com
(71) 上海陆金所资产管理有限公司
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法人代表: 郭坚
电话: 021-22066562
传真: 021-22066653
公司网站: www.lufunds.com
客户服务电话: 4008219031
基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。
(二) 注册登记机构: 华宝兴业基金管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼
电话: 021-38505888
传真: 021-38505777
联系人: 韩东辉
(三) 律师事务所和经办律师
名称: 通力律师事务所
住所: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人: 韩帅
联系电话: (86 21) 3135 8666
传真: (86 21) 3135 8600
联系人: 黎明
经办律师: 吕红、黎明
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 安永华明会计师事务所
住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心050楼
执行事务合伙人: 吴港平
联系电话: (021) 22288888
传真: (021) 22280000
联系人: 边卓群
经办注册会计师: 边卓群 濮晓达
五、基金名称
华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金
六、基金类型
契约型开放式基金
七、基金的投资
(一) 本基金投资目标、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征
1. 投资目标
在控制风险的前提下, 争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
2. 投资范围
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资股指期货期权等其它品种, 基金管理人在履行适当的程序后, 可以将其纳入投资范围。

3、投资策略
(1) 资产配置策略
本基金采取积极的资产配置策略, 通过宏观策略研究, 对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪, 决定大类资产配置比例。本基金的股票投资比例为基金资产净值的60%-95%, 其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于80%, 权益投资比例为基金资产净值的0%-3%, 资产支持证券比例为基金资产净值的0%-20%, 债券及现金投资比例为基金资产净值的5%-40% (其中, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大到小排名在前1/3的股票。
(2) 股票投资策略
本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景, 注重价值挖掘, 精选个股。
1) 定量与定性相结合的个股精选策略
本基金的股票池主要包括大盘股;
在股票池中先用7个指标进行定量分析, 这7个定量指标分别为: 成长指标: -- 预测未来两年EPS复合增长率
价值指标: -- 预测P/E -- 预测P/B -- 预测P/CF -- 预测P/S
盈利指标: -- 过去三年平均ROE -- 过去三年平均ROIC
筛选出排名靠前的股票形成初选股票池。
对初选股票池中的股票, 进行案头研究和实地调研, 深入研究企业的基本面和长期发展前景, 精选符合以下一条或数条定性判断标准的股票, 形成备选股票池:
(6) 显著的规模经济和范围经济;
行业地位突出, 强大的核心竞争力;
良好的管理能力和长远规划;
盈利能力强大且注重股东回报和投资者关系;
公司治理完善, 信息披露规范等。
2) 行业调整策略
通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识, 调整股票资产在不同行业的投资比例。
(3) 债券投资策略
本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理, 以追求稳定收益和充分流动性的投资目标。大资产配置主要是通过宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断对货币资产和债券类资产进行选择配置, 同时也在银行间市场、交易所债券市场进行选择配置。
分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用分析进行分类品种配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券。
品种选择上, 主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析, 筛选出流动性良好、成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。
主要采用的投资策略包括:
1) 久期投资管理: 在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上, 确定债券组合久期目标范围, 在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短, 以获取市场超额收益。
2) 曲线合理定价: 按照市场各品种实际成交情况, 得出合理收益率曲线, 使用该曲线对备选品种进行合理定价, 确定其公允价格, 在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。
3) 曲线下滑策略: 对收益率曲线形态进行分析, 并预测其未来形态变化, 选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作, 买入曲线上端品种, 等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑, 从而得到超额下滑利润。
(4) 其他品种投资策略
本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况, 将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具, 包括但不限于可转换债券、央行票据、票据市场机会, 提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略, 可转换债券采用自上而下的两层配置策略, 在对宏观经济、行业分析的基础上, 选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个股分析, 转债具体条款分析、股性、债性分析。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险, 追求投资组合的安全和稳定收益, 并利用其股性在股市上涨中分享行业和公司成长带来的收益。
另外, 本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究, 结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值, 主要考虑运用的策略包括: 杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
4、业绩比较基准
本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数, 债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
沪深300指数是第一个覆盖了沪深两市的交易所权威指数, 具有市值覆盖率高、行业代表性强、流动性好等特点。
当市场出现更合适、更权威的比较基准时, 经基金托管人同意, 本基金管理人履行适当程序后, 可选用新的比较基准, 并将及时公告。
5、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。
(二) 投资策略
1. 投资决策委员会负责投资决策
投资决策委员会定期和不定期召开会议, 负责就基金重大战略和资产配置做出决策。
2. 金融工程部负责跟踪数量分析模型
金融工程部实时跟踪数量分析模型, 定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理。
3. 研究部负责投资研究和分析
宏观研究人员通过研究其他证券公司 and 基金管理公司的报告, 通过走访政府决策部门和(研究部门), 研究经济形势、经济政策(货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等)、重大技术发明等, 撰写宏观研究报告, 就基金的股票、债券、现金比例提出建议。
(三) 投资限制
1. 基金经小组负责投资决策
基金经小组根据宏观经济和行业发展, 结合量化分析等工具对股市做出判断, 提出投资组合的资产配置比例建议, 同时结合数量分析模型型的股票排序和研究员的报告, 形成投资计划提交投资决策委员会, 并根据投资决策委员会的决策, 具体实施投资计划。
经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后, 基金经理向交易部下达具体的投资指令, 交易员根据投资决策决定书执行指令。
2. 绩效评估
主要包括四项核心功能: 风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献, 由绩效评估人员利用相关工具评估。
6、内部控制
内部控制委员会、督察长、副总经理、内控审计风险管理部负责内部控制制度的制定, 并检查执行情况。
(三) 投资限制与禁止行为
1. 组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点, 通过分散投资降低基金财产的非系统性风险, 保持基金组合良好的流动性。
本基金的资产配置将遵循以下限制:
(1) 本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的10%;
(2) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的3%;
(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券, 不超过该证券的10%;
(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的10%;
(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
(6) 本基金股票、债权、债券、现金的投资比例范围为: 股票占基金资产净值的60%-95%, 权证占0%-3%, 资产支持证券占0%-20%, 债券及现金占5%-40% (其中, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%);
(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%;
(8) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的20%;
(9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%;
(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11) 本基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易;
(12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券, 在持有期间如果其信用等级下降, 不再符合投资标准, 本基金应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(13) 本基金参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(14) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
(15) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以

内的政府债券;
(16) 本基金资产总值不超过本基金资产净值的140%;
(17) 法律法规或监管部门取消上述限制, 基金管理人履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的, 基金管理人应当在10个交易日内进行调整。对于因基金规模短期内快速增长而导致基金投资比例低于基金合同约定的, 基金管理人可将调整时限从十个交易日延长到三个月。基金规模快速增长主要是指基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个交易日內增加10亿元以上的情形。基金发生上述需延长建仓期限情形的, 基金管理人应同基金托管人协商一致并及时向中国证监会基金监管部书面报告, 说明上述情况出现的原因及解决方案。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。
2、禁止行为
本基金禁止从事下列行为:
(1) 承销证券;
(2) 向他人贷款或者提供担保;
(3) 从事承担无限责任的投资;
(4) 买卖其他基金资产, 但是法律法规另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8) 依照法律、行政法规有关规定, 由中国证监会规定禁止的其他活动。
(四) 基金的融资、融券
本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。
(五) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法
1、不谋求对上市公司的控股、不参与上市公司的经营管理;
2、有利于基金财产的安全与增值;
3、独立行使股东权利, 保护基金投资人的利益;
4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会, 行使股东权利, 履行股东义务。
八、基金的投资组合报告
本基金的投资组合报告所载的数据截至2015年9月30日, 本报告中所列数据未经审计。
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	96,089,976.72	80.14
	其中: 股票	96,089,976.72	80.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,078,684.00	19.45
8	其他资产	481,760.23	0.41
9	合计	118,650,420.95	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	4,896,490.00	4.36
B	采矿业	2,461,088.58	2.19
C	制造业	60,313,792.69	53.73
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,860,220.00	3.44
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	7,747,713.78	6.90
J	金融业	2,284,454.00	2.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,250,082.00	2.90
M	科学研究和技术服务业	4,147,518.00	3.69
N	水利、环境和公共设施管理业	3,648,115.00	3.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,481,482.77	2.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	96,089,976.72	84.71

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002236	大华股份	193,663	6,547,407.93	5.83
2	600271	航天信息	106,731	5,730,387.39	5.10
3	600446	金证股份	212,325	5,393,065.00	4.80
4	002594	比亚迪	75,005	4,381,030.05	3.90
5	600645	中顺洁柔	77,800	4,147,518.00	3.69
6	002589	瑞康医药	121,200	3,860,220.00	3.44
7	300070	碧水源	83,500	3,648,115.00	3.25
8	002407	多氟多	97,600	3,567,280.00	3.18
9	601633	长城汽车	108,700	3,557,751.00	3.17
10	600418	江淮汽车	250,001	3,320,013.28	2.96

4、报告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。
5、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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
6、报告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、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投资。
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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(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。
(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。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1) 本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。
(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。
(3) 本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。
11、投资组合报告附注
(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。
(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范围。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	256,474.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,767.01
5	应收申购款	220,518.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	481,760.23

(4) 报告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。
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

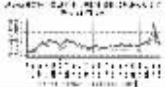
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002589	瑞康医药	3,860,220.00	3.44	重大事項停牌
2	600446	金证股份	4,147,518.00	3.69	重大事項停牌
3	300070	碧水源	3,648,115.00	3.25	重大事項停牌
4	600446	金证股份	5,393,065.00	4.80	重大事項停牌

九、基金的投资业绩
基金业绩截止日为2015年9月30日, 所列数据未经审计。
1、净值增长率与同期比较基准收益率比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2008/10/07-2008/12/31	0.98%	0.21%	-10.74%	2.39%	11.72%	-2.18%
2009/01/01-2009/12/31	91.29%	1.71%	73.60%	1.64%	17.69%	0.07%
2010/01/01-2010/12/31	-3.18%	1.46%	-9.12%	1.26%	5.94%	0.20%
2011/01/01-2011/12/31	-30.49%	1.14%	-19.67%	1.04%	-10.82%	0.10%
2012/01/01-2012/12/31	7.40%	1.16%	7.04%	1.02%	0.36%	0.14%
2013/01/01-2013/12/31	9.65%	1.39%	-5.30%	1.11%	14.95%	0.28%
2014/01/01-2014/12/31	90.70%	1.32%	61.86%	1.27%	18.84%	0.06%
2015/01/01-2015/09/30	1.52%	3.16%	-5.80%	1.26%	7.32%	1.00%
2008/10/07-2015/09/30	83.44%	1.62%	52.64%	1.35%	30.96%	0.23%

2、自基金合同生效以来基金业绩比较基准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:

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年10月7日至2015年9月30日)



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4月7日, 本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

十、基金费用概览
(一) 与基金运作有关的费用
1、基金费用的种类
(1) 基金管理人的管理费;
(2) 基金托管人的托管费;
(3) 因基金的交易或结算而产生的费用 (包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
(4) 基金合同生效以后的信息披露费用;
(5) 基金份额持有人大会费用;
(6) 基金合同生效以后与本基金相关的会计师事务所和律师费;
(7) 基金的资金汇划费用;
(8) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1) 基金管理人的管理费
在通常情况下, 基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 1.5% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费
在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%