华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期: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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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3月27日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝稳健回报混合
基金主代码	000993
交易代码	000993
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	794,769,589.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 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。 2、股票投资策略 本基金采取积极的股票选择策略,将"自上而下"的行业配置策略和"自下而上"的股票精选策略相结合,根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断,进行投资组合的动态优化,实现基金资产长期稳定增值。 3、固定收益类投资工具投资策略 本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益率投资工具,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 4、权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。 5、股指期货投资策略 本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险及特殊情况下的流动性风险,以达到降低投资组合整体风险的目的。 6、其他金融工具投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人可根据法律法规及监管机构的规定及本基金的投资目标,制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

2.4 信息披露方式

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	基金管理人及基金托管人住所

§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3月27日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	288,900,601.10
本期利润	313,788,069.46
加权平均基金份额本期利润	0.2290
本期加权平均净值利润率	22.05%
本期基金份额净值增长率	6.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	49,980,313.32
期末可供分配基金份额利润	0.0629
期末基金资产净值	844,749,902.82
期末基金份额净值	1.063
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	6.30%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
4、净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

3.2 基金净值表现

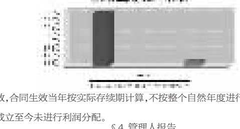
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	25.50%	2.03%	9.92%	0.92%	15.58%	1.11%
过去六个月	2.11%	2.86%	-7.13%	1.47%	9.24%	1.39%
自基金合同生效日起至今	6.30%	2.78%	0.46%	1.46%	5.84%	1.32%

注:1、本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
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)。

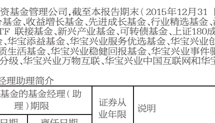
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2015年3月27日至2015年12月31日)



注:1、本基金基金合同生效于2015年3月27日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。
2、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2015年9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



注:本基金合同于2015年3月27日生效,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

本基金成立于2015年3月27日,基金成立至今未进行利润分配。

§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、华宝兴业中证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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
闫旭	助理投资总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝行业精选混合、华宝兴业收益增长基金经理	2015年3月27日	–	15年	硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作,2004年10月至2010年7月任职于华宝兴业基金管理有限公司,先后任基金经理助理、基金经理的职务。2010年7月至2014年2月任职于银华(梅隆西部)基金管理有限公司投资副总监兼基金经理,2014年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,现任助理投资总监,2015年3月起兼任国内投资部总经理。2014年7月起任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理,2015年2月兼任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理,2015年3月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。
代云锋	本基金基金经理助理、华宝服务优选混合基金经理助理	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任研究部分析师的职务。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投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业稳健回报灵活配置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。

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。公司内部制度规定的公平交易的控制方法适用于公司管理的所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),交易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,所有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,投资组合经理在授权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进行事前控制,主要包括限制公司旗下组合自身反向交易、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交易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年全年沪深300上涨5.58%,创业板上涨84%,但整体行情震荡较大。A股市场杠杆率的变化、流动性的波动与传统实体经济的低迷、新兴产业的萌芽交织在一起。美国加息预期、原油价格大幅下跌等因素,也导致海外市场动荡不安。总体来看,景气度向上及受益于改革红利的行业和公司在2015年取得了相对较好的表现。

本基金根据市场环境的变化,采取了稳步建仓的投资策略。前期市场上涨过程中,基金对互联网、传媒、计算机等新兴产业增加了配置。在市场调整过程中对基金的结构也进行了相应调整,对需求相对稳定的传媒、家电等行业保持了一定的仓位,增加了教育、智能制造等行业的配置。同时也阶段性参与了新能源汽车、国企改革等主题性投资机会。

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6.30%,同期业绩比较基准收益率为0.46%,基金表现领先基准5.84%。

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,我们认为尽管经济整体仍处于增长放缓的态势,但在政策调控下,GDP增速有望保持在相对平稳的水平。同时,随着改革的推进,特别是政府强化实施供给端改革,经济结构的调整也在加速。一方面,落后产能的逐步出清有望看到效果,传统行业的效率和集中度将得到改善提升;另一方面,新兴产业仍然处于快速发展的机遇期,在整体国民经济中的占比将不断提升。

中期来看,通胀预计大概率将继续保持在低位。但受全球经济的影响,汇率波动、美元进入加息周期等扰动因素在增多,货币政策预计仍将保持相对宽松。同时,随着注册制的临近,战略新兴板的即将推出,市场供给端的增加将会带来一定的资金分流,同时也带来估值体系的变化。因此,我们需要在不同阶段行细分和比较资金供需面的平衡状况。

整体而言,我们看好2016年股票市场的资产配置价值,但是在新的市场环境下结构分化预计将有所加剧,甄选优质行业和公司的重要性在大幅提升,对于估值考量的要求也在提高。我们对政府的改革充满信心,但也深刻认识到过程的曲折。我们预计市场机会将继续围绕受益于改革和经济结构调整,真正具备成长性的行业和个股。相应的,我们将采取较为平衡的投资策略,对于细分行业的思考会更加全面、深刻,对成长性个股的选择会更加严格,也更加注重投资的安全边际。

感谢持有人一直以来对我们的支持,在后续投资中,我们将继续总结经验,勤勉尽责,努力实现本基金的良好表现。

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,同时定期向监督部门、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,在符合公司已有制度的前提下,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、投资研究等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结果所提出的建议或意见。

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

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,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业稳健回报灵活配置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
资 产:		
银行存款		229,795,653.12
结算备付金		5,278,353.12
存出保证金		1,911,170.86
交易性金融资产		606,877,604.22
其中:股票投资		606,877,604.22
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		–
买入返售金融资产		–
应收证券清算款		11,837,688.82
应收利息		39,281.36
应收股利		–
应收申购款		139,892.08
递延所得税资产		–
其他资产		–
资产总计		855,879,643.58
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015年12月31日**
负 债:		
短期借款		–
交易性金融负债		–
衍生金融负债		–
卖出回购金融资产款		–
应付证券清算款		–
应付赎回款		3,758,497.23
应付管理人报酬		1,152,377.79
应付托管费		192,062.97
应付销售服务费		–
应付交易费用		5,583,636.07
应交税费		–
应付利息		–
应付利润		–
递延所得税负债		–
其他负债		443,166.70
负债合计		11,129,740.76
所有者权益:		
实收基金		794,769,589.50
未分配利润		49,980,313.32
所有者权益合计		844,749,902.82
负债和所有者权益总计		855,879,643.58

注:
1. 报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.063元,基金份额总额794,769,589.50份。
2. 本财务报表的实际编制期间为2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		348,063,858.77
1.利息收入		2,316,105.43
其中:存款利息收入		2,316,105.43
债券利息收入		–
资产支持证券利息收入		–
买入返售金融资产收入		–
其他利息收入		–
2.投资收益(损失以"-"填列)		312,735,549.84
其中:股票投资收益		306,180,552.67
基金投资收益		–
债券投资收益		–
资产支持证券投资收益		–
贵金属投资收益		–
衍生工具收益		–
股利收益		6,554,997.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		24,887,468.36
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		8,124,735.14
减:二、费用		34,275,789.31
1. 管理人报酬		16,185,010.52
2. 托管费		2,697,501.71
3. 销售服务费		–
4. 交易费用		14,920,825.79
5. 利息支出		–
其中:卖出回购金融资产支出		–
6. 其他费用		472,451.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		313,788,069.46
减:所得税费用		–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		313,788,069.46

注:本基金成立于2015年3月27日,因此无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)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)	2,356,565,874.08	–	2,356,565,874.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	313,788,069.46	313,788,069.46
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)	-1,561,796,284.58	-263,807,756.14	-1,825,604,040.72
其中:1.基金申购款	428,940,079.73	56,467,466.87	485,407,546.60
2.基金赎回款	-1,990,736,364.31	-320,275,223.01	-2,311,011,587.32
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)	794,769,589.50	49,980,313.32	844,749,902.82

注:本基金成立于2015年3月27日,因此无上年度可比期间数据。

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:

黄小薏 向辉 张幸骏
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]第1379号《关于准予华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华宝兴业稳健回报灵活配置混合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2,355,993,269.20 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第220号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年3月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,356,565,874.08 份基金份额,其中认购资金利息折合572,604.88 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业稳健回报灵活配置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(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的股票投资比例不低于基金资产的0%-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业稳健回报灵活配置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3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

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变动计入当期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和债券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均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金额。

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 关联方关系

项目	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司("华宝兴业")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,185,010.52
其中:支付销售机构的客户维护费	7,402,128.36

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,697,501.71

注:支付基金托管人 中国银行 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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年3月27日)持有的基金份额	1,091,269.84
期初持有的基金份额	0.00
期间申购/买入总份额	252,620.94
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	1,343,890.78
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.17%

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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国银行	229,795,653.12	2,235,907.73

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国银行 保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大资产重组	56.68	–	–	295,900	9,692,600.50	16,771,612.00	–
600153	建发股份	2015年6月29日	重大资产重组	14.69	–	–	1,086,534	23,042,136.95	15,961,184.46	–
300036	超图软件	2015年10月30日	重大资产重组	39.01	2016年1月15日	35.11	293,740	9,525,050.19	11,458,797.40	–
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大事项	15.80	–	–	700,000	11,621,200.50	11,060,000.00	–
600699	均胜电子	2015年11月4日	重大资产重组	35.91	2016年3月10日	29.00	266,743	10,061,840.72	9,578,741.13	–
2231	奥维通信	2015年12月3日	重大资产重组	16.36	–	–	499,997	8,898,725.08	8,179,950.92	–
2465	海格通信	2015年12月30日	重大事项	16.69	2016年2月4日	15.02	530,000	9,588,247.57	8,845,700.00	–
300238	冠昊生物	2015年11月12日	重大资产重组	55.14	–	–	110,000	4,493,751.54	6,065,400.00	–
300063	天龙集团	2015年12月22日	重大资产重组	43.33	–	–	117,817	4,656,580.27	5,105,010.61	–
300010	立思辰	2015年12月30日	重大事项	31.90	2016年1月8日	28.71	160,000	5,302,125.59	5,104,000.00	–

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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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508,747,207.70元,属于第二层次的余额为98,130,396.52元,无属于第三层次的余额。

(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。

(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	606,877,604.22	70.91
	其中:股票	606,877,604.22	70.91
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	235,074,006.24	27.47
7	其他各项资产	13,928,033.12	1.63
8	合计	855,879,643.58	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.9 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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	273,955,102.87	32.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	2,088,949.50	0.25
F	批发和零售业	38,029,132.26	4.50
G	交通运输、仓储和邮政业	9,281,082.00	1.10
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	114,436,873.55	13.55
J	金融业	–	–
K	房地产业	6,972,000.00	0.83
L	租赁和商务服务业	8,966,131.72	1.06
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	7,746,756.00	0.92
R	文化、体育和娱乐业	145,401,576.32	17.21
S	综合	–	–
	合计	606,877,604.22	71.84

8.2.10 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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

代码	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	002739	万达院线	435,000	52,200,000.00	6.18
2	300027	华谊兄弟	1,173,400	48,672,632.00	5.76
3	300017	网宿科技	748,887	44,925,731.13	5.32
4	600060	海信电器	2,045,200	40,229,084.00	4.76
5	600576	万家文化	811,620	22,067,947.80	2.61
6	000802	北京文化	650,784	22,048,561.92	2.61
7	002494	华斯股份	680,004	18,020,106.00	2.13
8	002373	千方科技	369,984	16,926,768.00	2.00
9	300038	梅泰诺	295,900	16,771,612.00	1.99
10	600884	杉杉股份	423,000	16,598,520.00	1.96

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.fsfund.com的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.9 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600060	海信电器	164,243,316.21	19.44
2	601111	中国国航	139,450,528.81	16.51
3	601166	兴业银行	104,054,842.84	12.32
4	002739	万达院线	90,519,336.27	10.72
5	300168	万达信息	87,844,374.24	10.40
6	002241	歌尔声学	86,358,755.38	10.22
7	300027	华谊兄弟	82,509,408.50	9.77
8	600050	中国联通	76,370,907.46	9.04
9	601607	上海医药	71,468,354.92	8.46
10	600029	南方航空	71,438,623.98	8.46
11	002405	四维图新	67,007,346.35	7.93
12	300347	泰格医药	62,737,698.84	7.43
13	002183	怡亚通	61,622,979.04	7.29
14	000829	天音控股	60,497,642.93	7.16
15	600153	建发股份	59,416,775.47	7.03
16	002332	仙琚制药	59,247,570.63	7.01
17	300075	数字政通	58,736,247.14	6.95
18	600109	国金证券	58,657,350.92	6.94
19	002273	水晶光电	57,513,914.43	6.81
20	300392	腾信股份	55,403,935.97	6.56
21	601126	四方股份	53,035,345.54	6.28
22	600188	兖州煤业	49,158,188.45	5.82
23	600016	民生银行	47,329,547.67	5.60
24	002024	苏宁云商	47,242,357.78	5.59
25	300017	网宿科技	47,216,128.90	5.59
26	600138	中青旅	47,209,035.40	5.59
27	600115	东方航空	47,161,776.58	5.58
28	600728	佳都科技	46,413,616.02	5.49
29	600885	宏发股份	46,097,699.47	5.46
30	300238	冠昊生物	45,921,812.50	5.44
31	601021	春秋航空	45,823,999.28	5.42
32	000566	海南海药	45,185,738.20	5.35
33	600118	中国卫星	44,470,050.28	5.26
34	600026	中海发展	43,841,123.50	5.19
35	300251	光线传媒	43,378,939.83	5.14
36	002456	欧菲光	42,695,345.40	5.05
37	002594	比亚迪	42,418,956.19	5.02
38	000718	苏宁环球	40,722,695.41	4.82
39	600699	均胜电子	40,672,592.92	4.81
40	300010	立思辰	40,136,523.16	4.75
41	601872	招商轮船	38,456,354.24	4.55
42	300146	汤臣倍健	38,227,707.88	4.53
43	300252	金信诺	38,011,549.70	4.50
44	600038	中直股份	36,623,034.78	4.34
45	601628	中国人寿	35,923,061.01	4.25
46	002280	联络互动	35,183,963.62	4.17
47	300226	上海钢联	35,008,205.78	4.14
48	000524	岭南控股	34,560,222.15	4.09
49	002214	大立科技	33,866,705.33	4.01
50	002477	雏鹰农牧	33,767,183.76	4.00
51	002022	科华生物	33,335,050.01	3.95
52	601377	兴业证券	33,054,958.62	3.91
53	002142	宁波银行	32,614,679.80	3.86
54	300131	英唐智控	30,466,445.82	3.61
55	000547	航天发展	30,087,411.05	3.56
56	600332	白云山	29,716,033.28	3.52
57	000831	五矿稀土	29,582,084.40	3.50
58	300400	劲拓股份	29,156,052.94	3.45
59	603128	华贸物流	28,405,147.76	3.36
60	600884	杉杉股份	28,233,325.36	3.34
61	002271	东方雨虹	28,003,684.06	3.32
62	300244	迪安诊断	27,902,861.83	3.30
63	300012	华测检测	27,680,540.46	3.28
64	300096	易联众	27,679,349.00	3.28
65	300413	快乐购	27,548,666.00	3.26
66	002351	漫步者	27,493,981.01	3.25
67	600376	首开股份	27,488,590.96	3.25
68	600547	山东黄金	27,145,958.65	3.21
69	002217	合力泰	26,430,191.40	3.13
70	002363	隆基机械	26,150,565.88	3.10
71	600882	华联矿业	25,825,373.48	3.06
72	600005	武钢股份	25,130,499.60	2.97
73	600804	鹏博士	25,109,233.47	2.97
74	600570	恒生电子	24,623,604.24	2.91
75	000681	视觉中国	24,488,837.99	2.90
76	600362	江西铜业	24,376,262.58	2.89
77	600406	国电南瑞	24,015,562.74	2.84
78	002029	七匹狼	23,896,234.48	2.83
79	300273	和佳股份	23,849,165.30	2.82
80	300183	东软载波	23,670,806.98	2.80
81	002415	海康威视	23,622,571.96	2.80
82	600518	康美药业	23,613,203.98	2.80
83	600986	科达股份	23,606,826.25	2.79
84	600661	新南洋	23,601,733.16	2.79
85	601633	长城汽车	23,556,442.98	2.79
86	002494	华斯股份	23,538,991.74	2.79
87	300274	阳光电源	23,480,243.60	2.78
88	601933	永辉超市	23,477,597.62	2.78
89	002284	亚太股份	23,429,805.00	2.77
90	300399	京天利	23,402,777.10	2.77
91	600276	恒瑞医药	23,388,708.78	2.77
92	300058	蓝色光标	23,354,697.59	2.76
93	600074	保千里	22,650,217.89	2.68
94	300088	长信科技	22,180,864.49	2.63
95	600058	五矿发展	22,167,297.29	2.62
96	300006	莱美药业	21,675,051.74	2.57
97	000802	北京文化	19,924,823.21	2.36
98	603008	喜临门	19,722,104.73	2.33
99	000969	安泰科技	19,684,394.19	2.33
100	300227	光韵达	19,545,990.60	2.31
101	002373	千方科技	19,391,163.40	2.30
102	600598	北大荒	19,127,192.91	2.26
103	600587	新华医疗	19,120,824.86	2.26
104	002184	海得控制	18,648,898.66	2.21
105	300065	海兰信	17,865,794.28	2.11
106	300166	东方国信	17,771,157.90	2.10
107	601688	华泰证券	17,626,007.00	2.09
108	002285	世联行	17,475,933.98	2.07

注:买入金额不包括相关交易费用。

8.4.10 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601111	中国国航	173,142,139.96	20.50
2	600060	海信电器	134,234,905.32	15.89
3	002241	歌尔声学	101,357,591.41	12.00
4	601166	兴业银行	98,037,468.41	11.61
5	601607	上海医药	79,759,557.44	9.44
6	002405	四维图新	72,408,901.71	8.57
7	600050	中国联通	71,809,317.99	8.50
8	600029	南方航空	71,349,313.65	8.45
9	300168	万达信息	70,356,608.95	8.33
10	600115	东方航空	69,574,549.52	8.24
11	002024	苏宁云商	65,893,229.59	7.80
12	002739	万达院线	64,665,343.28	7.65
13	601021	春秋航空	64,237,376.25	7.60
14	300075	数字政通	62,195,090.67	7.36
15	000718	苏宁环球	61,454,218.90	7.27
16	601126	四方股份	60,886,141.93	7.21
17	300392	腾信股份	58,771,349.68	6.96
18	002273	水晶光电	55,826,889.28	6.61
19	300347	泰格医药	52,884,893.65	6.26
20	600026	中海发展	51,632,074.41	6.11
21	600885	宏发股份	50,539,132.91	5.98
22	600188	兖州煤业	49,447,149.20	5.85
23	600016	民生银行	49,433,990.87	5.85
24	300010	立思辰	49,394,298.85	5.85
25	000566	海南海药	48,936,936.85	5.79
26	600728	佳都科技	48,754,290.80	5.77
27	300251	光线传媒	46,465,973.63	5.50
28	300027	华谊兄弟	46,411,398.21	5.49
29	600138	中青旅	46,124,191.62	5.46
30	600118	中国卫星	45,842,961.31	5.43
31	002456	欧菲光	45,756,292.20	5.42
32	601872	招商轮船	44,145,099.61	5.23
33	300252	金信诺	42,625,531.17	5.05
34	600074	保千里	42,131,442.98	4.99
35	600153	建发股份	41,175,935.05	4.87
36	002351	漫步者	40,455,415.60	4.79
37	002280	联络互动	39,475,085.55	4.67
38	300131	英唐智控	38,587,263.70	4.57
39	002477	雏鹰农牧	38,531,354.90	4.56
40	600038	中直股份	38,346,863.63	4.54
41	300238	冠昊生物	38,246,115.47	4.53
42	002214	大立科技	38,194,883.83	4.52
43	600109	国金证券	38,116,629.35	4.51
44	002594	比亚迪	38,030,643.72	4.50
45	601377	兴业证券	37,816,127.45	4.48
46	002029	七匹狼	37,646,549.20	4.46
47	300226	上海钢联	37,335,160.45	4.42
48	002022	科华生物	36,851,590.24	4.36
49	603128	华贸物流	36,223,761.97	4.29
50	000524	岭南控股	35,431,886.37	4.19
51	000547	航天发展	35,281,873.98	4.18
52	002415	海康威视	33,958,444.79	4.02
53	601799	星宇股份	32,306,878.85	3.82
54	002183	怡亚通	32,294,123.54	3.82
55	300146	汤臣倍健	31,197,654.19	3.69
56	000829	天音控股	30,476,567.73	3.61
57	002363	隆基机械	30,337,781.14	3.59
58	300183	东软载波	30,208,848.90	3.58
59	000681	视觉中国	30,113,680.25	3.56
60	600699	均胜电子	29,972,358.70	3.55
61	002332	仙琚制药	29,901,615.63	3.54
62	600332	白云山	29,871,301.74	3.54
63	000831	五矿稀土	29,718,417.65	3.52
64	601628	中国人寿	29,152,349.00	3.45
65	002142	宁波银行	28,467,063.14	3.37
66	600661	新南洋	28,154,429.46	3.33
67	002284	亚太股份	27,877,470.18	3.30
68	600547	山东黄金	27,482,725.91	3.25
69	600518	康美药业	27,266,703.88	3.23
70	600376	首开股份	27,133,196.91	3.21
71	600570	恒生电子	27,008,752.00	3.20
72	600406	国电南瑞	26,906,210.73	3.19
73	300012	华测检测	26,593,377.20	3.15
74	600804	鹏博士	26,502,867.73	3.14
75	300399	京天利	26,345,861.79	3.12
76	300058	蓝色光标	25,729,640.41	3.05
77	300413	快乐购	25,469,345.08	3.02
78	600005	武钢股份	25,308,255.80	3.00
79	600362	江西铜业	25,034,299.77	2.96
80	300274	阳光电源	24,707,685.34	2.92
81	300273	和佳股份	24,584,687.02	2.91
82	300088	长信科技	24,262,830.22	2.87
83	600882	华联矿业	24,123,952.12	2.86
84	002271	东方雨虹	24,074,181.46	2.85
85	600058	五矿发展	23,914,037.78	2.83
86	600276	恒瑞医药	23,489,692.83	2.78
87	601933	永辉超市	23,432,610.60	2.77
88	300006	莱美药业	23,292,093.61	2.76
89	300096	易联众	21,876,195.50	2.59
90	601633	长城汽车	21,339,513.31	2.53
91	300065	海兰信	20,458,244.44	2.42
92	600598	北大荒	20,063,472.65	2.38
93	300400	劲拓股份	19,848,618.08	2.35
94	002184	海得控制	18,987,651.91	2.25
95	601998	中信银行	18,840,000.00	2.23
96	002285	世联行	18,777,702.24	2.22
97	600986	科达股份	18,282,527.27	2.16
98	601688	华泰证券	17,860,959.22	2.11
99	601009	南京银行	17,561,920.38	2.08
100	300017	网宿科技	17,403,111.82	2.06
101	601818	光大银行	17,264,112.15	2.04
102	600036	招商银行	16,908,949.44	2.00

注:卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.11 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	5,131,151,354.22
卖出股票收入(成交)总额	4,855,341,771.03

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。

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

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。

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	1,911,170.86
2	应收证券清算款	11,837,688.82
3	应收股利	–
4	应收利息	39,281.36
5	应收申购款	139,892.08
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,928,033.12

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	300038	梅泰诺	16,771,612.00	1.99	临时停牌

§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)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
12,036	66,032.70	3,318,335.93	0.42%	791,451,253.57	99.58%

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	1,820,251.54	0.2290%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年3月27日)基金份额总额	2,356,565,874.08
本报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	428,940,079.73
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,990,736,364.31
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	794,769,589.50

注:1.本基金于2015年5月27日起开始办理日常申购赎回业务。
2.总申购份额含转换入份额;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
2015年4月,李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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(2015年3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、本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、本报告期内,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、本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
海通证券	1	1,768,423,391.26	17.71%	1,564,877.23	17.34%	–
中泰证券	1	1,185,616,642.37	11.87%	1,096,320.41	12.15%	–
招商证券	1	1,031,109,175.30	10.33%	924,585.43	10.24%	–
兴业证券	2	1,020,556,723.11	10.22%	927,598.08	10.28%	–
申万宏源	1	825,839,120.50	8.27%	751,840.23	8.33%	–
广发证券	2	720,113,842.25	7.21%	655,937.38	7.27%	–
安信证券	1	706,180,179.14	7.07%	634,096.30	7.03%	–
中金国际	2	569,460,616.12	5.70%	509,353.75	5.64%	–
华创证券	2	492,506,570.78	4.93%	447,104.85	4.95%	–
中信建投	1	360,657,211.24	3.61%	329,337.57	3.65%	–
国海证券	2	341,600,549.17	3.42%	306,860.89	3.40%	–
长江证券	1	239,562,145.88	2.40%	218,096.46	2.42%	–
国泰君安	1	231,865,577.43	2.32%	211,087.82	2.34%	–
中信金通	1	221,493,475.17	2.22%	205,236.19	2.27%	–
国金证券	2	166,910,400.06	1.67%	152,475.34	1.69%	–
光大证券	1	102,709,289.04	1.03%	90,887.37	1.01%	–
国联证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–

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

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
中金国际	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
中信金通	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
国联证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–

华宝兴业基金管理有限公司
2016年3月28日