华宝兴业行业精选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。

本报告中财务报告部分的内容经具有从事证券业务资格的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

§2 §2基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业行业精选混合型证券投资基金
基金简称	华宝行业精选混合
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14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	2,437,386,666.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300 指数收益率。
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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853

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	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。

§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

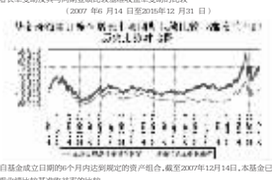
3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	3,483,960,547.53	2,031,850,001.31	1,579,202,019.97
本期利润	2,787,855,361.24	1,387,049,290.91	2,111,283,323.86
加权平均基金份额本期利润	0.7509	0.1638	0.1874
本期加权平均净值利润率	48.38%	15.45%	18.37%
本期基金份额净值增长率	35.49%	17.35%	18.64%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	1,640,329,121.27	874,093,168.38	-1,219,259,623.23
期末可供分配基金份额利润	0.6730	0.1325	-0.1274
期末基金资产净值	4,077,715,787.34	8,146,663,914.88	10,068,599,149.59
期末基金份额净值	1.6730	1.2348	1.0522
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	67.30%	23.48%	5.22%

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.本期已实现收益指期末基金期利息收入、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非末日的一日(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

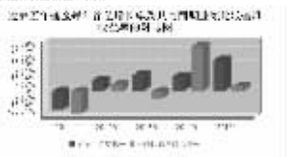
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	22.86%	2.10%	16.49%	1.67%	6.37%	0.43%
过去六个月	-5.59%	2.92%	-16.59%	2.68%	11.00%	0.24%
过去一年	35.49%	2.61%	5.58%	2.48%	29.91%	0.13%
过去三年	88.63%	1.86%	47.88%	1.79%	40.75%	0.07%
过去五年	67.90%	1.60%	19.27%	1.61%	48.63%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	67.30%	1.68%	-9.40%	1.93%	76.70%	-0.25%

注:1.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非末最后一日休日(如非交易日)。
2.本基金业绩比较基准为:沪深300 指数收益率。
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

(2007 年6 月14 日至2015年12 月31 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2007年12月14日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。
3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§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、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业高端制造基金、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182,703,481,966.16元。
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会简介

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
范红兵	本基金基金经理、助理投资总监、华宝医药生物混合基金经理	2013年7月25日	-	15年	硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作,于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理,2010年7月至2014年10月任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理。2014年6月任助理投资总监。
闫旭	本基金基金经理、助理投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业收益增长混合、华宝稳健回报混合基金经理	2014年7月9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月任组银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混合型证券投资基金基金经理。
李卓	研究部总经理、本基金基金经理	2013年8月22日	2015年5月7日	10年	硕士。曾在中银基金管理有限公司、富邦证券上海代表处从事研究工作,2008年加入华宝兴业基金管理有限公司,历任分析师、高级分析师、基金经理助理、研究部总经理助理、研究部副总经理。2013年8月至2015年5月任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理,2014年6月至2015年9月任研究部总经理。
光磊	本基金基金经理助理、华宝品质生活股票基金经理	2014年6月18日	2015年5月26日	8年	硕士,曾在汇添富基金管理有限公司任投资研究部高级行业分析师,2012年10月加入华宝兴业基金管理有限公司,任华宝兴业宝康消费品混合证券投资基金基金经理助理。2014年6月兼任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理助理。2015年4月起任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。
2.证券从业年限是以从事证券业(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、《宝兴业行业精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。
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、债券的一级市场中购、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。

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、债券的一级市场中购、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,分别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;并采用了连续四个季度期间、不同时间窗下(1日、3日、5日)同向交易的样本,对其进行t检验假设检测下的假设检验分析,同时结合角租合的成交金额、并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能性。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,我司服务性选基金与事件驱动基金于6月11日对股票——尚荣医疗(002561)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阶进行买入,服务性选为实现收益卖出,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,政动性的波动与传统实体经济的低迷,新兴产业的明芽交织在一起。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,转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,在不同阶段采取了相应的投资策略,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36.49%,同期业绩比较基准收益率为5.58%,基金表现领先于比较基准29.91%。
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16年全年,我们认为反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侧改革,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,传统行业的收益和集中度将得到提升;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,通胀预计被温和控在,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,战略新兴板的逐渐推出,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仔细分析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,概念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,我们将采取权均平衡的投资策略,对于部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,勤范道德风险,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)完善公司规章体系,公司一方面坚持制度的刚性,不轻易改变,同化已确立的制度。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,公司能重和吸收海外股东、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,允许各级员工在其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,不断加强了的控内幕交易等行为的稽核力度;并与相关部门进行沟通,形成共识规避和避免上相反提出的风险禁区,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性的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力的范和控制各种风险,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者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,本发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。
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

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:华宝兴业行业精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		1,035,621,528.83	527,076,070.81
结算备付金		18,416,584.24	13,528,948.44
存出保证金		3,441,989.04	2,856,897.22
交易性金融资产		3,001,196,768.14	7,488,995,712.39
其中:股票投资		3,001,196,768.14	7,488,995,712.39
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		-	98,000,267.00
应收证券清算款		65,656,062.99	115,214,418.40
应收利息		155,563.53	169,859.98
应收股利		-	-
应收申购款		107,854.41	311,352.61
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,124,596,351.18	8,246,153,526.85
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		8,159,524.61	53,649,495.86
应付管理人报酬		5,187,955.17	10,834,871.31
应付托管费		864,659.18	1,805,811.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		31,972,497.41	32,146,149.83
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		695,927.47	1,053,283.10
负债合计		46,880,563.84	99,489,611.97
所有者权益:			
实收基金		2,437,386,666.07	6,597,670,239.07
未分配利润		1,640,329,121.27	1,548,993,675.81
所有者权益合计		4,077,715,787.34	8,146,663,914.88
负债和所有者权益总计		4,124,596,351.18	8,246,153,526.85

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.6730元,基金份额总额2,437,386,666.07份。
7.2 利润表
会计主体:华宝兴业行业精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		2,961,725,536.83	1,618,498,716.98
1.利息收入		5,863,711.71	13,133,627.92
其中:存款利息收入		5,715,241.61	7,909,976.85
债券利息收入		-	2,648,839.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		148,470.10	2,574,811.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,641,494,680.44	2,249,875,415.81
其中:股票投资收益		3,604,511,233.36	2,184,227,075.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	610,777.12
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		36,983,447.08	65,037,563.37
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-696,105,186.29	-644,800,710.40
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		472,330.97	290,383.65
减:二、费用		163,870,175.59	231,449,426.07
1. 管理人报酬		86,666,516.03	135,018,963.45
2. 托管费		14,444,419.41	22,503,160.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		62,264,238.62	73,311,625.33
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		495,001.53	615,676.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,787,855,361.24	1,387,049,290.91
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,787,855,361.24	1,387,049,290.91

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:华宝兴业行业精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)	6,597,670,239.07	1,548,993,675.81	8,146,663,914.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,787,855,361.24	2,787,855,361.24
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)	-4,160,283,573.00	-2,696,519,915.78	-6,856,803,488.78
其中:1.基金申购款	414,120,385.44	244,791,288.89	658,911,674.33
2.基金赎回款	-4,574,403,958.44	-2,941,311,204.67	-7,515,715,163.11
四、本期向基金分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)	2,437,386,666.07	1,640,329,121.27	4,077,715,787.34

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)	9,569,338,196.01	499,260,953.58	10,068,599,149.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,387,049,290.91	1,387,049,290.91
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)	-2,971,667,956.94	-337,316,568.68	-3,308,984,525.62
其中:1.基金申购款	107,986,101.90	13,285,277.75	121,271,379.65
2.基金赎回款	-3,079,654,058.84	-350,601,846.43	-3,430,255,905.27
四、本期向基金分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)	6,597,670,239.07	1,548,993,675.81	8,146,663,914.88

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:
黄小雅 _____ 向辉 _____ 张平骏 _____
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
华宝兴业行业精选混合型证券投资基金(即:名为华宝兴业行业精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”)证监基金字[2007]96号《关于同意华宝兴业行业精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独家(中华人民共和国证券投资基金法)和华宝兴业行业精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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币9,998,141,906.12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(2007)第071号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金合同》于2007年6月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为9,998,540,080.34份基金份额,其中认购资金利息折合398,174.22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年中国证监会第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华宝兴业行业精选股票型证券投资基金于2015年7月22日公告日更名为华宝兴业行业精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《华宝兴业行业精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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资比例范围为:股票占基金资产总值的60%-95%,权证:0%-3%,资产支持证券:0%-20%,债券及现金:5%-40%,其中,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为:沪深300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日发以后颁同颁布的《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》,《华宝兴业行业精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会计处理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和债券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应收申购款等。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,回购计提和终止确认
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实用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,不以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产实质上已经转移了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,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 应收款项和其他金融负债的初始确认
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实际发生时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。
7.4.4.11 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照息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,但结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,即已实现部分和损未实现部分的余额。

应宣告的复位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
本基金以内部管理的结构、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。

本基金目前这一个唯一的经营分部运行,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投票投资和债券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《关于发布中国指数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、债券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、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代代扣缴20%的个人所得税。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