

t

# 华安宝利配置证券投资基金 2015 年半年度 报告

## 2015 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

## § 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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录 .....	1
1.1	重要提示 .....	1
2	基金简介 .....	4
2.1	基金基本情况 .....	4
2.2	基金产品说明 .....	4
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4	信息披露方式 .....	5
2.5	其他相关资料 .....	5
3	主要财务指标和基金净值表现 .....	5
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2	基金净值表现 .....	6
4	管理人报告 .....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.8	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 .....	16
5	托管人报告 .....	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
5.3	托管人对本半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	半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1	资产负债表 .....	16
6.2	利润表 .....	18
6.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
6.4	报表附注 .....	20
7	投资组合报告 .....	35
7.1	期末基金资产组合情况 .....	35
7.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	36
7.3	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 .....	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	37
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	39
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 .....	39
7.7	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 .....	39
7.8	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 .....	40
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 .....	40
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.12	投资组合报告附注 .....	40

8	基金份额持有人信息 .....	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
9	开放式基金份额变动 .....	41
10	重大事件揭示 .....	42
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4	基金投资策略的改变 .....	43
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况 .....	43
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8	其他重大事件 .....	46
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
12	备查文件目录 .....	48
12.1	备查文件目录 .....	48
12.2	存放地点 .....	48
12.3	查阅方式 .....	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安宝利配置证券投资基金	
基金简称	华安宝利配置混合	
基金主代码	040004	
交易代码	040004(前端)	041004(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年8月24日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,344,655,739.09份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会，灵活配置资产，并充分提高基金资产的使用效率，在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析，采用积极的投资组合策略，保留可控制的风险，规避或降低无法控制的风险，发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	$35\% \times \text{天相转债指数收益率} + 30\% \times \text{天相280 指数收益率} + 30\% \times \text{天相国债全价指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险,政策风险，经济周期风险，信用风险，再投资风险，上市公司经营风险，新产品创新带来的风险，购买力风险，流动性风险，现金管理风险，技术风

	险，管理风险，巨额赎回风险等。
--	-----------------

### 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		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	汤嵩彦
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		朱学华	牛锡明

### 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
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,021,557,297.17
本期利润	1,035,002,594.67
加权平均基金份额本期利润	0.5879
本期加权平均净值利润率	33.78%
本期基金份额净值增长率	36.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	816,863,751.76
期末可供分配基金份额利润	0.6075
期末基金资产净值	2,387,380,618.56
期末基金份额净值	1.775
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	904.27%

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（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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 1 个月	-11.60%	3.40%	-11.31%	2.92%	-0.29%	0.48%
过去 3 个月	9.50%	2.49%	0.12%	2.04%	9.38%	0.45%
过去 6 个月	36.05%	1.99%	5.82%	1.68%	30.23%	0.31%
过去 1 年	81.93%	1.55%	46.16%	1.32%	35.77%	0.23%
过去 3 年	102.24%	1.17%	43.15%	0.88%	59.09%	0.29%
自基金合同生效起至今	904.27%	1.22%	161.29%	0.87%	742.98%	0.35%

注：本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数

收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

根据本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。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%,最低比例为 10%,最高比例为 70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%);除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%,最低比例为 10%,最高比例为 65%;除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%,最低比例为 10%,最高比例为 65%。

### 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

华安宝利配置证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004 年 8 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日)



## 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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本 1.5 亿元人民币,公司总

部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颐养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等 67 只开放式基金。管理资产规模达到 1214.76 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		

陆从珍	本基金的基金经理	2010-04-21	2015-06-18	15	经济学硕士，15 年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商局职员；京华山一证券上海公司高级研究员；中企东方资产管理公司高级研究员；东方证券研究部资深研究员等职。2008 年 3 月加入华安基金管理公司，任研究发展部高级研究员，2009 年 5 月 16 日起至 2010 年 4 月 21 日担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理，2010 年 4 月起担任本基金的基金经理。2012 年 8 月起同时担任华安逆向策略股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月离开华安基金。
翁启森	本基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部高级总监，公司总经理助理	2015-06-16	-	18	工业工程学硕士，18 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全

				<p>球投资部总监。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013年6月起担任基金投资部兼全球投资部总监。2014年3月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月起同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任本基金、华安生态优先股票型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安宝利配置型证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。

若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的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、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 1 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，除六月份出现了历史罕见的大逆转，市场总体表现良好。风格上，中小盘依然跑赢大盘股，其背后主要逻辑是：首先，虽然经济继续下滑，但由于政府不断出台托底政策，封住了下档风险；其次，代表未来的新经济深入人心，特别是互联网+公司更是深得市场青睐获得大幅估值溢价；最后，由于居民传统投资渠道收益率下降，导致更多的资金涌入资本市场。改革和成长是本基金最为看好的两大方向，本基金在年初逐步提高成长股和改革受益股配置，主要集中于互联网+、智能汽车、国企改革等领域。由于经济处于转轨期，积极转型和敢于拥抱新技术新经济的公司投资机会较多，因此在操作上，主要采取自下而上的策略来选股，并获得了较好的收益。但在季度末，由于监管机构启动去杠杆措施导致发生连锁负反馈，市场超预期大幅下挫，对短期业绩影响较大。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.775 元，本报告期份额净值增长率为 36.05%，同期业绩比较基准增长率为 5.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间内，我国经济整体依然处于新常态期，无风险收益率进入长期下行通道。随着改革不断释放活力、资本市场对外进一步开放和衍生工具不断丰富，市场整体可能会表现为宽幅震荡的上升，结构性机会依然是市场主要特征，因此在操作上，我们将依据市场阶段特征，提高投资的灵活性和针对性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

- 1、估值政策及重大变化  
无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响  
无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经验的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部高级总监、研究发展部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历，15 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安现金富利货币、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、

华安新回报灵活配置的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接基金、华安中证高分红指数增强型、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级的基金经理,指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

#### (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

#### (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

#### 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理翁启森作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

#### 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施了一次分红。

第一次分红方案：每 10 份基金份额派发红利 2.278 元。权益登记日及除息日：2015 年 3 月 26 日；现金红利发放日：2015 年 3 月 27 日。

#### 4.8 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

无。

### 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

2015 年上半年度，基金托管人在华安宝利配置证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2015 年上半年度，华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 583,049,917.73 元。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015 年上半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,007,797.60	8,405,566.95
结算备付金		45,141,206.06	62,284,380.65
存出保证金		1,031,925.88	566,824.03
交易性金融资产	6.4.7.2	2,273,142,445.20	2,602,717,723.76
其中：股票投资		1,900,021,167.40	2,047,803,966.99
基金投资		-	-
债券投资		353,065,277.80	535,587,838.96
资产支持证券投资		20,056,000.00	19,325,917.81
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	83,336,481.67	-
应收证券清算款		30,443,276.15	40,982,505.52
应收利息	6.4.7.5	7,628,176.69	8,180,037.91
应收股利		-	-
应收申购款		12,334,661.19	3,756,877.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,468,065,970.44	2,726,893,916.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.7.3	-	-
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		74,105,191.26	17,453,267.56
应付管理人报酬		2,912,498.77	2,714,994.77
应付托管费		606,770.57	565,623.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,417,129.75	1,786,404.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	643,761.53	783,159.55

负债合计		80,685,351.88	23,303,450.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,344,655,739.09	1,812,796,463.82
未分配利润	6.4.7.10	1,042,724,879.47	890,794,002.44
所有者权益合计		2,387,380,618.56	2,703,590,466.26
负债和所有者权益总计		2,468,065,970.44	2,726,893,916.63

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.775 元，基金份额总额 1,344,655,739.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>1,064,981,105.14</b>	<b>34,445,432.18</b>
1.利息收入		11,241,110.67	13,488,786.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,491,525.09	1,915,111.57
债券利息收入		7,987,296.79	9,968,719.74
资产支持证券利息收入		425,654.79	472,119.18
买入返售金融资产收入		336,634.00	1,132,835.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,037,179,979.44	170,761,988.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	927,167,224.89	160,242,564.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	100,525,593.37	-584,110.60
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	\$3183\$	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	9,487,161.18	11,103,534.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	13,445,297.50	-150,666,351.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号	6.4.7.17	3,114,717.53	861,008.48

填列)			
<b>减：二、费用</b>		<b>29,978,510.47</b>	<b>25,370,163.29</b>
1. 管理人报酬		18,079,803.34	16,892,261.13
2. 托管费		3,766,625.67	3,519,221.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,915,922.76	4,714,580.70
5. 利息支出		-	22,190.17
其中：卖出回购金融资产支出		-	22,190.17
6. 其他费用	6.4.7.19	216,158.70	221,910.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,035,002,594.67</b>	<b>9,075,268.89</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,035,002,594.67</b>	<b>9,075,268.89</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	1,812,796,463.82	890,794,002.44	2,703,590,466.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,035,002,594.67	1,035,002,594.67
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）	-468,140,724.73	-300,021,799.91	-768,162,524.64
其中：1.基金申购款	1,368,641,200.50	1,010,479,412.74	2,379,120,613.24
2.基金赎回款	-1,836,781,925.23	-1,310,501,212.65	-3,147,283,137.88
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）	-	-583,049,917.73	-583,049,917.73
五、期末所有者权益（基金净值）	1,344,655,739.09	1,042,724,879.47	2,387,380,618.56

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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)	3,070,593,877.73	325,031,752.42	3,395,625,630.15
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	9,075,268.89	9,075,268.89
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)	-677,043,914.88	-58,122,338.67	-735,166,253.55
其中：1.基金申购款	149,030,271.94	13,064,720.15	162,094,992.09
2.基金赎回款	-826,074,186.82	-71,187,058.82	-897,261,245.64
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)	2,393,549,962.85	275,984,682.64	2,669,534,645.49

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安宝利配置证券投资基金(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[2004]第 97 号《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》核准，由华安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《华安宝利配置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 1,130,461,912.15 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(2004)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于 2004 年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效

日的基金份额总额为 1,130,480,770.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,857.93 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》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。本基金持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%)；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2015 年 8 月 27 日批准报出。

#### **6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2015 年上半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 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

除下述会计估计变更的说明以外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本会计期间不存在会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本会计期间不存在差错更正。

#### **6.4.6 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》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扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	15,007,797.60
定期存款	-
其他存款	-
合计	15,007,797.60

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,362,785,928.04	1,900,021,167.40	537,235,239.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	81,861,277.80	2,221,494.80
	银行间市场	269,511,460.00	1,692,540.00
	合计	349,151,243.00	3,914,034.80
资产支持证券	19,325,917.81	20,056,000.00	730,082.19
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,731,263,088.85	2,273,142,445.20	541,879,356.35

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间	83,336,481.67	-

合计	83,336,481.67	-
----	---------------	---

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,269.35
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	45,432.22
应收债券利息	7,490,134.20
应收买入返售证券利息	2,856.06
应收申购款利息	365.62
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	73,119.24
合计	7,628,176.69

注：其中其他项包括应收资产支持证券利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,414,139.03
银行间市场应付交易费用	2,990.72
合计	2,417,129.75

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	189,459.30
应付后端申购费	9,419.53
债券利息税	-
预提费用	194,882.70
银行手续费	-
合计	643,761.53

#### 6.4.7.9 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 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,812,796,463.82	1,812,796,463.82
本期申购	1,368,641,200.50	1,368,641,200.50
本期赎回（以“-”号填列）	-1,836,781,925.23	-1,836,781,925.23
本期末	1,344,655,739.09	1,344,655,739.09

注：申购含转入份额，赎回含转出份额。

#### 6.4.7.10 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	413,025,981.45	477,768,020.99	890,794,002.44
本期利润	1,021,557,297.17	13,445,297.50	1,035,002,594.67
本期基金份额交易产生的变动数	-34,669,609.13	-265,352,190.78	-300,021,799.91
其中：基金申购款	529,611,644.10	480,867,768.64	1,010,479,412.74
基金赎回款	-564,281,253.23	-746,219,959.42	-1,310,501,212.65
本期已分配利润	-583,049,917.73	-	-583,049,917.73
本期末	816,863,751.76	225,861,127.71	1,042,724,879.47

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	2,272,435.28
其他	40,518.78
合计	2,491,525.09

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	2,138,101,402.23
买卖股票差价收入	927,167,224.89

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	463,476,314.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	355,648,035.61
减：应收利息总额	7,302,685.85
债券投资收益	100,525,593.37

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,487,161.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,487,161.18

##### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	13,445,297.50
——股票投资	90,285,190.86
——债券投资	-77,569,975.55
——资产支持证券投资	730,082.19
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	13,445,297.50

##### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	3,114,717.53

合计	3,114,717.53
----	--------------

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	7,914,147.76
银行间市场交易费用	1,775.00
合计	7,915,922.76

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	46,116.99
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	2,876.00
帐户维护费	18,400.00
合计	216,158.70

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,079,803.34	16,892,261.13
其中：支付销售机构的客户维护费	360,686.29	3,593,496.04

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 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 X 1.2% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,766,625.67	3,519,221.07

注：支付基金托管人交通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 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收 入	交易金额	利息支 出
交通银行	-	-	79,980,000. 00	33,306.7 4	-	-

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 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

无。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	15,007,797.60	178,571.03	342,065.98	411,771.27

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2015 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2014 年 6 月 30 日：同)。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

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	利润分配 合计	备注
1	2015-03-26	2015-03-26	2.278	373,859,323.43	209,190,594.30	583,049,917.73	-
合计	-	-	-	373,859,323.43	209,190,594.30	583,049,917.73	-

#### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 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
002425	凯撒股份	2015-04-23	资产重组	26.33	-	-	1,808,282	21,989,271.16	47,612,065.06	-
002438	江苏神通	2015-05-25	资产重组	32.56	-	-	800,000	14,479,833.41	26,048,000.00	-
600499	科达洁能	2015-06-10	资产重组	29.64	-	-	550,000	11,876,997.00	16,302,000.00	-
600967	北方创业	2015-04-13	资产重组	17.12	-	-	900,000	13,297,802.22	15,408,000.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的配置型证券投资基金，属于偏低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”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，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并

与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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。

#### 6.4.13.2 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交通银行，与该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，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 06 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 3.34%(2014 年 12 月 31 日：13.33%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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。

本基金所持有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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,007,797.60	-	-	-	15,007,797.60
结算备付金	45,141,206.06	-	-	-	45,141,206.06
存出保证金	1,031,925.88	-	-	-	1,031,925.88
交易性金融资产	325,196,776.90	45,805,500.90	2,119,000.00	1,900,021,167.40	2,273,142,445.20
买入返售金融资产	83,336,481.67	-	-	-	83,336,481.67
应收利息	-	-	-	7,628,176.69	7,628,176.69
应收申购款	479,889.19	-	-	11,854,772.00	12,334,661.19
应收证券清算款	-	-	-	30,443,276.15	30,443,276.15
资产总计	470,194,077.30	45,805,500.90	2,119,000.00	1,949,947,392.24	2,468,065,970.44
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	74,105,191.26	74,105,191.26
应付管理人报酬	-	-	-	2,912,498.77	2,912,498.77
应付托管费	-	-	-	606,770.57	606,770.57
应付交易费用	-	-	-	2,417,129.75	2,417,129.75

应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	643,761.53	643,761.53
负债总计	-	-	-	80,685,351.88	80,685,351.88
利率敏感度缺口	470,194,077.30	45,805,500.90	2,119,000.00	1,869,262,040.36	2,387,380,618.56
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	8,405,566.95	-	-	-	8,405,566.95
结算备付金	62,284,380.65	-	-	-	62,284,380.65
存出保证金	566,824.03	-	-	-	566,824.03
交易性金融资产	176,812,774.60	356,840,207.81	21,260,774.36	2,047,803,966.99	2,602,717,723.76
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,180,037.91	8,180,037.91
应收申购款	456,831.88	-	-	3,300,045.93	3,756,877.81
应收证券清算款	-	-	-	40,982,505.52	40,982,505.52
资产总计	248,526,378.11	356,840,207.81	21,260,774.36	2,100,266,556.35	2,726,893,916.63
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	17,453,267.56	17,453,267.56
应付管理人报酬	-	-	-	2,714,994.77	2,714,994.77
应付托管费	-	-	-	565,623.91	565,623.91
应付交易费用	-	-	-	1,786,404.58	1,786,404.58
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	783,159.55	783,159.55
负债总计	-	-	-	23,303,450.37	23,303,450.37
利率敏感度缺口	248,526,378.11	356,840,207.81	21,260,774.36	2,076,963,105.98	2,703,590,466.26

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）	
		本期末	上年度末

		2015 年 6 月 30 日	2014 年 12 月 31 日
	市场利率下降25个基点	增加约68.00万元	增加约69.00万元
	市场利率上升25个基点	减少约68.00万元	减少约69.00万元

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资组合中可转换债券及其对应的基础股票投资比例为基金资产净值的 10%-70%，除可转换债券外的其它债券投资比例为基金资产净值的 10%-65%，除可转换债券所对应基础股票外的其它股票投资比例为基金资产净值的 10%-65%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 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	1,900,021,167.40	79.59	2,047,803,966.99	75.74
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	1,900,021,167.40	79.59	2,047,803,966.99	75.74

#### 6.4.13.4.3.2 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)	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 14,452.00 万元	增加约 14,760.00 万元
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 14,452.00 万元	减少约 14,760.00 万元

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	1,900,021,167.40	76.98
	其中: 股票	1,900,021,167.40	76.98
2	固定收益投资	373,121,277.80	15.12
	其中: 债券	353,065,277.80	14.31
	资产支持证券	20,056,000.00	0.81
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	83,336,481.67	3.38
	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	60,149,003.66	2.44
7	其他各项资产	51,438,039.91	2.08
8	合计	2,468,065,970.44	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	75,346,496.00	3.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,236,426,981.07	51.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,727,488.00	1.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	66,800,387.20	2.80
I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,812,112.63	8.58
J	金融业	121,024,720.00	5.07
K	房地产业	45,997,982.50	1.93
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	121,885,000.00	5.11
S	综合	-	-
	合计	1,900,021,167.40	79.59

## 7.3 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

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	002250	联化科技	9,500,000	212,800,000.00	8.91

2	002241	歌尔声学	5,280,485	189,569,411.50	7.94
3	600079	人福医药	3,306,200	122,494,710.00	5.13
4	601166	兴业银行	7,000,000	120,750,000.00	5.06
5	002063	远光软件	3,000,000	93,810,000.00	3.93
6	600518	康美药业	4,600,000	81,558,000.00	3.42
7	601098	中南传媒	3,500,000	80,185,000.00	3.36
8	300115	长盈精密	2,400,000	79,944,000.00	3.35
9	600598	*ST 大荒	4,442,600	75,346,496.00	3.16
10	300208	恒顺众昇	925,858	73,596,452.42	3.08
11	600271	航天信息	1,084,000	70,145,640.00	2.94
12	002237	恒邦股份	5,700,000	68,229,000.00	2.86
13	000796	易食股份	2,693,564	66,800,387.20	2.80
14	300033	同花顺	739,737	63,609,984.63	2.66
15	002491	通鼎互联	3,321,634	60,320,873.44	2.53
16	603766	隆鑫通用	2,311,780	58,025,678.00	2.43
17	002425	凯撒股份	1,808,282	47,612,065.06	1.99
18	601929	吉视传媒	3,134,400	47,392,128.00	1.99
19	600325	华发股份	2,541,325	45,997,982.50	1.93
20	002094	青岛金王	2,191,115	42,310,430.65	1.77
21	002488	金固股份	1,286,000	41,769,280.00	1.75
22	600757	长江传媒	3,000,000	41,700,000.00	1.75
23	300005	探路者	1,105,600	30,293,440.00	1.27
24	600323	瀚蓝环境	1,604,600	27,727,488.00	1.16
25	002438	江苏神通	800,000	26,048,000.00	1.09
26	600499	科达洁能	550,000	16,302,000.00	0.68
27	600967	北方创业	900,000	15,408,000.00	0.65
28	601211	国泰君安	8,000	274,720.00	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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

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	002241	歌尔声学	165,300,040.41	6.11
2	601988	中国银行	153,129,766.39	5.66
3	600415	小商品城	115,944,722.14	4.29
4	600271	航天信息	90,101,729.48	3.33
5	600079	人福医药	87,108,452.65	3.22
6	600837	海通证券	86,258,415.81	3.19
7	000796	易食股份	75,116,536.01	2.78

8	601601	中国太保	74,849,411.25	2.77
9	603766	隆鑫通用	67,853,306.03	2.51
10	601318	中国平安	65,236,415.90	2.41
11	300208	恒顺众昇	63,268,008.28	2.34
12	002094	青岛金王	61,485,275.09	2.27
13	600325	华发股份	55,488,795.76	2.05
14	600028	中国石化	50,388,547.44	1.86
15	601929	吉视传媒	49,867,641.52	1.84
16	601166	兴业银行	49,135,000.00	1.82
17	300058	蓝色光标	45,333,004.57	1.68
18	300005	探路者	39,639,882.00	1.47
19	601398	工商银行	36,640,000.00	1.36
20	002391	长青股份	36,359,642.64	1.34

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	294,447,659.80	10.89
2	601988	中国银行	212,865,087.16	7.87
3	300033	同花顺	178,345,185.17	6.60
4	600089	特变电工	144,975,021.76	5.36
5	600415	小商品城	142,419,211.65	5.27
6	600028	中国石化	141,646,736.64	5.24
7	600000	浦发银行	127,450,012.89	4.71
8	000729	燕京啤酒	105,773,421.83	3.91
9	600837	海通证券	104,465,915.86	3.86
10	600518	康美药业	101,098,740.11	3.74
11	600048	保利地产	93,233,110.08	3.45
12	002491	通鼎互联	73,907,066.45	2.73
13	601601	中国太保	71,070,447.38	2.63
14	000069	华侨城 A	68,563,131.75	2.54
15	601166	兴业银行	62,840,930.00	2.32
16	002438	江苏神通	62,020,108.13	2.29
17	300058	蓝色光标	57,357,658.98	2.12
18	002236	大华股份	51,572,386.86	1.91
19	002363	隆基机械	50,465,572.00	1.87
20	000581	威孚高科	47,365,005.99	1.75

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,900,033,411.78
卖出股票的收入（成交）总额	3,065,268,627.12

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,119,000.00	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	271,204,000.00	11.36
	其中：政策性金融债	271,204,000.00	11.36
4	企业债券	78,853,827.90	3.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	888,449.90	0.04
8	其他	-	-
9	合计	353,065,277.80	14.79

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150403	15 农发 03	800,000	80,488,000.00	3.37
2	150202	15 国开 02	700,000	70,378,000.00	2.95
3	140223	14 国开 23	500,000	50,200,000.00	2.10
4	140443	14 农发 43	300,000	30,081,000.00	1.26
5	120229	12 国开 29	300,000	30,009,000.00	1.26

### 7.7 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

无。

## 7.8 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。

## 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

本基金本报告期没有投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的北大荒于 2015 年 6 月 23 日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚及市场禁入事先告知书》。除此之外，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,031,925.88
2	应收证券清算款	30,443,276.15
3	应收股利	-

4	应收利息	7,628,176.69
5	应收申购款	12,334,661.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,438,039.91

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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		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
109,723	12,255.00	79,063,288.60	5.88%	1,265,592,450.49	94.12%

### 8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	327,037.61	0.024%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004 年 8 月 24 日)基金份额总额	1,130,480,770.08
--------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	1,812,796,463.82
本报告期基金总申购份额	1,368,641,200.50
减：本报告期基金总赎回份额	1,836,781,925.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,344,655,739.09

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2015 年 3 月 7 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2) 2015 年 6 月 16 日，基金管理人发布了华安宝利配置证券投资基金基金经理变更公告，新增翁启森先生为本基金的基金经理，与陆从珍女士共同管理本基金。

(3) 2015 年 6 月 19 日，基金管理人发布了华安宝利配置证券投资基金基金经理变更公告，陆从珍女士不再担任本基金的基金经理。

(4) 2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(5) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无

涉及本基金财产的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

#### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	1	561,284,459.80	11.85%	510,992.68	11.85%	-
海通证券股份有限公司	1	1,448,582,226.65	30.59%	1,318,790.07	30.59%	-
兴业证券股份有限公司	1	364,932,998.64	7.71%	332,236.24	7.71%	-
渤海证券有限责任公司	1	1,007,005,522.06	21.26%	916,772.01	21.26%	-
中国中投证券	1	648,872,400.63	13.70%	590,726.43	13.70%	-

申万宏源 证券股份 有限公司	1	637,332,061.56	13.46%	580,224.61	13.46%	-
长城证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	1	68,126,375.79	1.44%	62,022.06	1.44%	-
东莞证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券

商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3.报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

**10.7.2 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		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
中信建投证券股份有限公司	3,365,609.40	5.64%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	19,270,012.70	32.27%	-	-	-	-
渤海证券有限责任公司	3,211,951.60	5.38%	-	-	-	-
中国中投证券	16,609,646.60	27.82%	-	-	-	-
申万宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	17,250,034.10	28.89%	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

有 限 责 任 公 司						
中 银 国 际 证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-01-05
2	关于旗下部分基金增加北京增财基金销售为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-06
3	关于旗下部分开放式基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-13
4	关于旗下部分基金增加太平洋证券为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-18
5	华安基金管理有限公司关于华安宝利配置证券投资基金分红公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-24
6	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-07
7	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-12
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-31
9	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》	2015-04-08

		和公司网站	
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-05-07
11	关于华安旗下部分基金增加天天基金为销售机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-05-28
12	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-05-29
13	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-05-29
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-12
15	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-02
16	关于旗下部分基金在官方京东店开展认购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-10
17	关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-10
18	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-12
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-12
20	华安宝利配置证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》	2015-06-16

		和公司网站	
21	华安宝利配置证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-19
22	关于旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-26
23	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-29
24	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宝利配置证券投资基金设立的文件
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十八日