

华安宝利配置证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 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：二〇一六年八月二十六日

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 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	错误！未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误！未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误！未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误！未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误！未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	错误！未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误！未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误！未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误！未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误！未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误！未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误！未定义书签。
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	错误！未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	错误！未定义书签。
6.2 利润表	错误！未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	错误！未定义书签。
6.4 报表附注	错误！未定义书签。
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	错误！未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
7.4 期末指数投资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	错误！未定义书签。
7.5 期末积极投资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	错误！未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动	错误！未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误！未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	错误！未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误！未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	错误！未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误！未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误！未定义书签。
7.13 投资组合报告附注	错误！未定义书签。
8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误！未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误！未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误！未定义书签。
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误！未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误！未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误！未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误！未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	50
12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	错误！未定义书签。
12.2 存放地点	错误！未定义书签。
12.3 查阅方式	错误！未定义书签。

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	1,893,309,998.39 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-169,083,986.41
本期利润	-242,129,795.54
加权平均基金份额本期利润	-0.1213
本期加权平均净值利润率	-10.98%
本期基金份额净值增长率	-10.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	304,103,783.57
期末可供分配基金份额利润	0.1606
期末基金资产净值	2,197,413,781.96
期末基金份额净值	1.161
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	850.62%

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	6.12%	1.44%	0.63%	0.36%	5.49%	1.08%
过去 3 个月	7.60%	1.47%	0.43%	0.44%	7.17%	1.03%
过去 6 个月	-10.53%	2.34%	-3.82%	0.79%	-6.71%	1.55%
过去 1 年	-5.34%	2.61%	-11.93%	1.38%	6.59%	1.23%
过去 3 年	91.82%	1.84%	23.27%	1.14%	68.55%	0.70%
自基金合同生效起至今	850.62%	1.39%	112.20%	0.92%	738.42%	0.47%

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%。

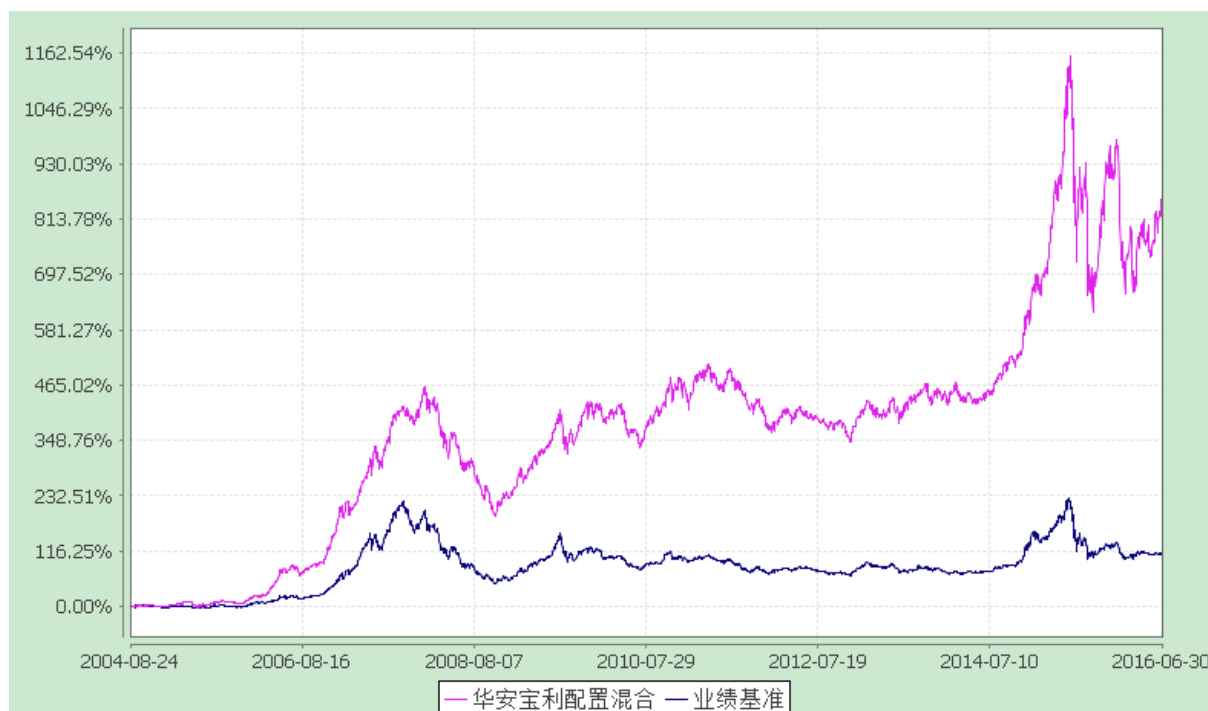
根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%（其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%）；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。

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

份额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 2016 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 2016 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、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、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 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分

地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、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、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 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		
刘伟亭	基金经理	2015-09-25	-	11 年	硕士研究生，11 年证券、基金从业经验，曾任长江巴黎百富勤证券有限公司助理经理、国海富兰克林基金基金经理。2015 年 6 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起担任本基金及华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
翁启森	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	-	20 年	工业工程学硕士，20 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，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部总监。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混合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、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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。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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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、发送邮件、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，则投资部门在风控部门的监督参与下，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；风险管理部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。

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，出现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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

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

由于经济总体继续处于探底阶段，年初在人民币小幅贬值、熔断制度实施、流动性边际改善较小、减持解禁开始等负面因素影响下风险偏好大幅下降导致市场发生大幅下挫，本基金由于仓位偏高加之弹性品种占比较大，在这波下跌中，净值回撤受损较大。在这个过程中本基金通过降低仓位与加大力度调整持仓结构，降低风险容忍度，逐步扭转了下滑的势头。二季度，资本市场正本清源启动供给侧改革加之经济刺激逻辑被证伪后，市场结构分化加剧；在经历未加入 MSCI、关键时点美联储没有加息、英国公投脱欧等重要风险事件冲击后，市场基本保持平稳，显示了市场存在一定的韧性。由于市场相对平稳，热点轮动特征较为明显，投资可操作性尚可，本基金在二季度保持了偏高的仓位，并通过自下而上选股来获得超额收益，主要是增持了新能源汽车产业链和半导体产业链相关个股，同时减持受政策负面影响较大的传媒、周期品等行业个股，从结果来看，效果尚可。

由于未来一段时间企业盈利维持低位波动，利率保持平稳，市场整体性机会依然较少，因此，我们会从更多维的视角去选择投资标的，努力为投资人创造更好的收益。

本基金上半年业绩主要贡献来自于个股选择，行业配置主要集中于新能源汽车、TMT 和农业等领域。整体上，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机会较多，因此在操作上，主要采取自下而上的策略来获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.161 元，本报告期份额净值增长率为-10.53%，同期业绩比较基准增长率为-3.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从去年高点至今，市场出现了较大幅度的调整，风险也得到一定程度的释放，这对于追求稳健收益的投资者来说，机会正变得越来越大，越来越多的优秀公司估值进入可投资区间。虽然从短期静态的视角看，宏观经济基本面还没完全企稳，仍将在底部调整一段时间，汇率调整也依然还没完全达到均衡水平，无风险收益率的下降空间相比去年也较小，但我们也要看到过去一段时间的市场大幅下跌正是反映了这些风险因素，未来一段时间只要不出现超预期的风险因素，市场将进入具有投资价值的结构性机会阶段，将涌现出一些具有时代特征的优质成长股和政策受益标的。因此在操作上，我们将依据市场阶段特征和主要矛盾，提高投资的灵活性。

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历的描述

（1）公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、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，台湾保德信投信基金基金经理。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、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理，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高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，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。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、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、华安信用增强债券、华安双债添利债券、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、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，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（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 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 4.36 元。权益登记日及除息日：2016 年 1 月 27 日；
现金红利发放日：2016 年 1 月 28 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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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

2016 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

2016 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 1791718987.56 元, 符合基金合同的规定。

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

2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	25,409,514.62	102,870,304.76
结算备付金		122,588,216.53	63,460,155.56
存出保证金		2,033,771.96	1,717,219.90
交易性金融资产	6.4.7.2	2,100,721,259.15	2,017,149,191.20
其中：股票投资		1,827,656,033.60	1,771,437,008.40
基金投资		-	-
债券投资		273,065,225.55	235,648,182.80
资产支持证券投资		-	10,064,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	20,282,292.71
应收利息	6.4.7.5	3,665,189.69	6,590,950.63
应收股利		-	-
应收申购款		988,182.44	394,984.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,255,406,134.39	2,212,465,099.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		43,239,402.95	-
应付赎回款		6,811,605.43	3,747,139.14
应付管理人报酬		2,097,815.85	2,199,135.01
应付托管费		437,044.99	458,153.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,936,411.01	5,582,730.72
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	470,072.20	653,117.34
负债合计		57,992,352.43	12,640,275.35
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,893,309,998.39	1,171,351,204.30
未分配利润	6.4.7.10	304,103,783.57	1,028,473,619.77
所有者权益合计		2,197,413,781.96	2,199,824,824.07
负债和所有者权益总计		2,255,406,134.39	2,212,465,099.42

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.161 元，基金份额总额 1,893,309,998.39 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-207,552,537.70	1,064,981,105.14
1.利息收入		6,726,745.05	11,241,110.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,915,020.41	2,491,525.09
债券利息收入		4,343,954.73	7,987,296.79
资产支持证券利息收入		165,737.18	425,654.79
买入返售金融资产收入		302,032.73	336,634.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-144,877,023.02	1,037,179,979.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-150,835,020.74	927,167,224.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	245,812.13	100,525,593.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	341,546.12	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.15	5,370,639.47	9,487,161.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-73,045,809.13	13,445,297.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,643,549.40	3,114,717.53
减：二、费用		34,577,257.84	29,978,510.47
1. 管理人报酬		13,171,769.57	18,079,803.34
2. 托管费		2,744,118.71	3,766,625.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	18,445,038.55	7,915,922.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	216,331.01	216,158.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-242,129,795.54	1,035,002,594.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-242,129,795.54	1,035,002,594.67

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,171,351,204.30	1,028,473,619.77	2,199,824,824.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-242,129,795.54	-242,129,795.54
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）	721,958,794.09	1,309,478,946.90	2,031,437,740.99
其中：1.基金申购款	3,635,391,341.06	1,340,787,388.07	4,976,178,729.13
2.基金赎回款	-2,913,432,546.97	-31,308,441.17	-2,944,740,988.14
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）	-	-1,791,718,987.56	-1,791,718,987.56
五、期末所有者权益（基金净值）	1,893,309,998.39	304,103,783.57	2,197,413,781.96

项目	上年度可比期间 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

注：报告附注为财务报表的组成部分。

报表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的、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%。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 2016 年 8 月 23 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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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 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的说明

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，应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。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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	25,409,514.62
定期存款	-
其他存款	-
合计	25,409,514.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,730,411,696.29	1,827,656,033.60	97,244,337.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	76,673,125.81	83,193,225.55	6,520,099.74
	银行间市场	189,898,100.00	189,872,000.00	-26,100.00
	合计	266,571,225.81	273,065,225.55	6,493,999.74
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,996,982,922.10	2,100,721,259.15	103,738,337.05

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

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,377.68
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	51,214.61
应收债券利息	3,608,773.72
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	823.68
合计	3,665,189.69

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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,936,000.66
银行间市场应付交易费用	410.35
合计	4,936,411.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	24,647.88
预提账户维护费	-
预提审计费	46,246.20
预提信息披露费	149,178.12
合计	470,072.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,171,351,204.30	1,171,351,204.30
本期申购	3,635,391,341.06	3,635,391,341.06
本期赎回（以“-”号填列）	-2,913,432,546.97	-2,913,432,546.97
本期末	1,893,309,998.39	1,893,309,998.39

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	1,146,454,116.51	-117,980,496.74	1,028,473,619.77
本期利润	-169,083,986.41	-73,045,809.13	-242,129,795.54
本期基金份额交易产生的变动数	1,633,207,007.91	-323,728,061.01	1,309,478,946.90
其中：基金申购款	2,946,169,820.56	-1,605,382,432.49	1,340,787,388.07
基金赎回款	-1,312,962,812.65	1,281,654,371.48	-31,308,441.17
本期已分配利润	-1,791,718,987.56	-	-1,791,718,987.56
本期末	818,858,150.45	-514,754,366.88	304,103,783.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	266,846.36
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	1,631,178.65
其他	16,995.40
合计	1,915,020.41

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,972,446,741.98
减：卖出股票成本总额	6,123,281,762.72
买卖股票差价收入	-150,835,020.74

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	221,087,647.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	213,170,187.87

成本总额	
减：应收利息总额	7,671,647.04
买卖债券差价收入	245,812.13

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,296,674.03
减：卖出资产支持证券成本总额	9,792,117.88
减：应收利息总额	163,010.03
资产支持证券投资收益	341,546.12

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,370,639.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,370,639.47

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-73,045,809.13
——股票投资	-75,422,836.91
——债券投资	2,648,909.90
——资产支持证券投资	-271,882.12
——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	-73,045,809.13

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	3,643,549.40
合计	3,643,549.40

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 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	18,443,288.55
银行间市场交易费用	1,750.00
合计	18,445,038.55

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	46,246.20
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	1,906.69
帐户维护费	18,400.00
其他费用	600.00
合计	216,331.01

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

无。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,171,769.57	18,079,803.34
其中：支付销售机构的客户维护费	1,999,951.29	360,686.29

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,744,118.71	3,766,625.67

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

无。

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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	25,409,514.62	266,846.36	15,007,797.60	178,571.03

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 2016 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(2015 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

无。

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

单位：人民币元

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
-	2016-01-27	2016-01-27	4.360	1,503,198,75 2.80	288,520,234. 76	1,791,718,98 7.56	-
合计			4.360	1,503,198,75 2.80	288,520,234. 76	1,791,718,98 7.56	-

6.4.12 期末（2016 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	14,245.00	184,900.10	184,900.10	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项	14.12	-	-	2,165,323.00	30,002,672.55	30,574,360.76	-
000932	华菱钢铁	2016-03-28	重大事项	3.95	2016-08-08	4.35	6,065,900.00	23,664,510.00	23,960,305.00	-
00207	凯瑞德	2016-02	重大事	23.44	2016-0	20.38	4,042,257.00	97,675,010.12	94,750,504.00	-

2		-24	项		8-17		0		8	
002089	新海宜	2016-01-08	重大事项	17.71	2016-07-18	18.55	3,180,025.00	66,958,351.84	56,318,242.75	-
300299	富春通信	2016-02-29	重大事项	31.50	-	-	1,612,219.00	52,402,871.28	50,784,898.50	-
600556	慧球科技	2016-01-19	重大事项	16.19	2016-07-07	14.22	1,059,344.00	28,240,954.02	17,150,779.36	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大事项	22.35	-	-	1,354,388.00	25,652,669.90	30,270,571.80	-

注：本基金截至 2016 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。本基金的活期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 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 3.69%(2015 年 12 月 31 日：3.78%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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公司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。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

本基金持有及承担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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	25,409,514.62	-	-	-	25,409,514.62
结算备付金	122,588,216.53	-	-	-	122,588,216.53
存出保证金	2,033,771.96	-	-	-	2,033,771.96
交易性金融资产	239,983,290.95	28,485,563.10	4,596,371.50	1,827,656,033.60	2,100,721,259.15
应收利息	-	-	-	3,665,189.69	3,665,189.69
应收申购款	-	-	-	988,182.44	988,182.44
资产总计	390,014,794.06	28,485,563.10	4,596,371.50	1,832,309,405.73	2,255,406,134.39
负债					
应付证券清算款	-	-	-	43,239,402.95	43,239,402.95
应付赎回款	-	-	-	6,811,605.43	6,811,605.43
应付管理人报酬	-	-	-	2,097,815.85	2,097,815.85
应付托管费	-	-	-	437,044.99	437,044.99
应付交易费用	-	-	-	4,936,411.01	4,936,411.01
其他负债	-	-	-	470,072.20	470,072.20
负债总计	-	-	-	57,992,352.43	57,992,352.43
利率敏感度缺口	390,014,794.06	28,485,563.10	4,596,371.50	1,774,317,053.30	2,197,413,781.96
上年度末 2015 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	102,870,304.76	-	-	-	102,870,304.76
结算备付金	63,460,155.56	-	-	-	63,460,155.56
存出保证金	1,717,219.90	-	-	-	1,717,219.90

交易性金融资产	211,308,980.70	29,081,913.50	5,321,288.60	1,771,437,008.40	2,017,149,191.20
应收证券清算款	-	-	-	20,282,292.71	20,282,292.71
应收利息	-	-	-	6,590,950.63	6,590,950.63
应收申购款	-	-	-	394,984.66	394,984.66
资产总计	379,356,660.92	29,081,913.50	5,321,288.60	1,798,705,236.40	2,212,465,099.42
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,747,139.14	3,747,139.14
应付管理人报酬	-	-	-	2,199,135.01	2,199,135.01
应付托管费	-	-	-	458,153.14	458,153.14
应付交易费用	-	-	-	5,582,730.72	5,582,730.72
其他负债	-	-	-	653,117.34	653,117.34
负债总计	-	-	-	12,640,275.35	12,640,275.35
利率敏感度缺口	379,356,660.92	29,081,913.50	5,321,288.60	1,786,064,961.05	2,199,824,824.07

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：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 46	减少约 37
	市场利率下降 25 个基点	增加约 47	增加约 38

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,827,656,033.60	83.17	1,771,437,008.40	80.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,827,656,033.60	83.17	1,771,437,008.40	80.53

	60		.40	
--	----	--	-----	--

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：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 28,727	增加约 13,241
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 28,727	减少约 13,241

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	1,827,656,033.60	81.03
	其中：股票	1,827,656,033.60	81.03
2	固定收益投资	273,065,225.55	12.11
	其中：债券	273,065,225.55	12.11
	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	147,997,731.15	6.56
7	其他各项资产	6,687,144.09	0.30
8	合计	2,255,406,134.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,015,046,658.03	46.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	104,879,575.90	4.77
F	批发和零售业	158,383,062.90	7.21
G	交通运输、仓储和邮政业	41,501,810.42	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	207,626,413.54	9.45
J	金融业	141,640,479.92	6.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	158,557,906.79	7.22
S	综合	-	-
	合计	1,827,656,033.60	83.17

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

金额单位：人民币元

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	002699	美盛文化	4,490,261	149,929,814.79	6.82
2	600109	国金证券	10,507,454	141,640,479.92	6.45
3	002510	天汽模	15,965,998	132,837,103.36	6.05
4	002240	威华股份	7,885,450	105,349,612.00	4.79

5	002325	洪涛股份	11,327,998	104,104,301.62	4.74
6	600360	华微电子	8,661,120	102,720,883.20	4.67
7	002072	凯瑞德	4,042,257	94,750,504.08	4.31
8	600755	厦门国贸	10,617,949	84,412,694.55	3.84
9	603718	海利生物	5,064,120	83,152,850.40	3.78
10	600855	航天长峰	2,611,827	81,750,185.10	3.72
11	300297	蓝盾股份	4,990,848	79,504,208.64	3.62
12	300196	长海股份	1,455,769	57,022,471.73	2.59
13	002553	南方轴承	4,000,000	56,360,000.00	2.56
14	002089	新海宜	3,180,025	56,318,242.75	2.56
15	300098	高新兴	3,437,275	54,583,927.00	2.48
16	300299	富春通信	1,612,219	50,784,898.50	2.31
17	000829	天音控股	3,273,393	43,699,796.55	1.99
18	300011	鼎汉技术	1,784,362	41,878,976.14	1.91
19	002245	澳洋顺昌	3,249,946	41,501,810.42	1.89
20	002639	雪人股份	2,676,863	31,158,685.32	1.42
21	000639	西王食品	2,165,323	30,574,360.76	1.39
22	600576	万家文化	1,354,388	30,270,571.80	1.38
23	002182	云海金属	1,493,916	29,728,928.40	1.35
24	600305	恒顺醋业	2,206,066	25,413,880.32	1.16
25	000932	华菱钢铁	6,065,900	23,960,305.00	1.09
26	300183	东软载波	855,958	22,682,887.00	1.03
27	002491	通鼎互联	1,264,903	21,579,245.18	0.98
28	600556	慧球科技	1,059,344	17,150,779.36	0.78
29	600114	东睦股份	698,232	11,737,279.92	0.53
30	002590	万安科技	340,400	10,596,652.00	0.48
31	300336	新文化	345,400	8,628,092.00	0.39
32	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
33	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
34	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
35	601966	玲珑轮胎	14,245	184,900.10	0.01
36	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
37	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
38	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
39	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
40	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
41	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
42	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
43	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
44	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
45	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600109	国金证券	322,453,397.72	14.66
2	002699	美盛文化	176,786,432.35	8.04
3	002510	天汽模	160,479,798.64	7.30
4	300113	顺网科技	158,685,850.71	7.21
5	002325	洪涛股份	155,292,637.61	7.06
6	002245	澳洋顺昌	153,035,780.82	6.96
7	601336	新华保险	136,048,070.86	6.18
8	300196	长海股份	106,005,008.97	4.82
9	600755	厦门国贸	103,820,105.15	4.72
10	600661	新南洋	94,309,069.18	4.29
11	300078	思创医惠	93,657,329.29	4.26
12	600360	华微电子	86,411,018.26	3.93
13	000687	华讯方舟	84,642,300.36	3.85
14	002240	威华股份	83,712,810.66	3.81
15	000932	华菱钢铁	82,207,517.96	3.74
16	600362	江西铜业	81,875,204.65	3.72
17	002280	联络互动	80,401,316.55	3.65
18	603718	海利生物	79,658,791.24	3.62
19	603898	好莱客	76,386,161.64	3.47
20	600855	航天长峰	74,881,188.15	3.40
21	300299	富春通信	74,119,197.85	3.37
22	300297	蓝盾股份	73,999,581.44	3.36
23	600136	当代明诚	73,163,789.32	3.33
24	603999	读者传媒	70,769,321.41	3.22
25	600170	上海建工	68,837,116.30	3.13
26	002241	歌尔股份	67,650,434.11	3.08
27	600826	兰生股份	66,243,257.85	3.01
28	002329	皇氏集团	64,984,424.52	2.95
29	300098	高新兴	63,359,929.90	2.88
30	002468	艾迪西	62,950,988.60	2.86
31	002045	国光电器	60,493,374.01	2.75
32	002553	南方轴承	60,339,522.05	2.74
33	002070	众和股份	57,852,925.01	2.63
34	002343	慈文传媒	57,429,792.05	2.61
35	300336	新文化	57,207,846.98	2.60
36	300494	盛天网络	56,191,283.46	2.55

37	600138	中青旅	55,110,133.97	2.51
38	000829	天音控股	55,048,495.59	2.50
39	600730	中国高科	54,980,772.27	2.50
40	002643	万润股份	53,734,178.40	2.44
41	600576	万家文化	53,537,709.63	2.43
42	600556	慧球科技	50,101,051.30	2.28
43	300011	鼎汉技术	49,294,652.60	2.24
44	600756	浪潮软件	48,745,221.17	2.22
45	600114	东睦股份	47,270,032.14	2.15
46	300183	东软载波	46,490,719.52	2.11
47	002425	凯撒股份	44,804,364.77	2.04
48	000800	一汽轿车	44,611,153.86	2.03

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	601336	新华保险	216,438,655.62	9.84
2	600109	国金证券	182,945,321.77	8.32
3	300113	顺网科技	180,793,379.96	8.22
4	002245	澳洋顺昌	171,596,131.85	7.80
5	002241	歌尔股份	149,021,727.13	6.77
6	002329	皇氏集团	113,521,035.35	5.16
7	002510	天汽模	107,133,462.94	4.87
8	002699	美盛文化	100,048,540.03	4.55
9	600661	新南洋	95,852,260.69	4.36
10	300078	思创医惠	92,786,083.78	4.22
11	600271	航天信息	91,646,268.07	4.17
12	002280	联络互动	87,125,373.16	3.96
13	300012	华测检测	86,036,561.97	3.91
14	603898	好莱客	82,578,309.66	3.75
15	000687	华讯方舟	81,543,877.45	3.71
16	600362	江西铜业	81,254,846.04	3.69
17	600305	恒顺醋业	81,247,687.38	3.69
18	002045	国光电器	77,634,994.72	3.53
19	002070	众和股份	74,968,545.88	3.41
20	002643	万润股份	73,815,887.63	3.36
21	600170	上海建工	71,754,888.08	3.26
22	600749	西藏旅游	70,106,635.84	3.19
23	300217	东方电热	68,003,765.88	3.09

24	300494	盛天网络	66,818,157.50	3.04
25	300196	长海股份	66,409,603.92	3.02
26	600136	当代明诚	66,351,483.91	3.02
27	600826	兰生股份	62,435,079.44	2.84
28	000932	华菱钢铁	61,993,695.59	2.82
29	002655	共达电声	59,492,894.13	2.70
30	002325	洪涛股份	59,289,778.06	2.70
31	300458	全志科技	58,026,330.80	2.64
32	000531	穗恒运 A	56,997,291.24	2.59
33	002086	东方海洋	56,581,741.34	2.57
34	002343	慈文传媒	55,592,241.40	2.53
35	002468	艾迪西	54,204,068.42	2.46
36	603999	读者传媒	53,747,853.28	2.44
37	600138	中青旅	52,422,480.99	2.38
38	002445	中南文化	49,050,988.14	2.23
39	002670	华声股份	48,017,879.58	2.18
40	603806	福斯特	47,837,284.93	2.17
41	600699	均胜电子	47,691,882.41	2.17
42	002308	威创股份	46,766,668.89	2.13
43	002355	兴民钢圈	44,859,393.08	2.04
44	002425	凯撒股份	44,799,380.67	2.04
45	000800	一汽轿车	44,222,711.55	2.01

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	6,254,923,624.83
卖出股票的收入（成交）总额	5,972,446,741.98

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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,161,600.00	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	189,872,000.00	8.64

	其中：政策性金融债	189,872,000.00	8.64
4	企业债券	44,020,791.20	2.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	37,010,834.35	1.68
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	273,065,225.55	12.43

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	160204	16 国开 04	900,000	89,892,000.00	4.09
2	160401	16 农发 01	500,000	49,990,000.00	2.27
3	150419	15 农发 19	300,000	30,006,000.00	1.37
4	128010	顺昌转债	179,455	25,970,727.60	1.18
5	160304	16 进出 04	200,000	19,984,000.00	0.91

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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投资。

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 本期国债期货投资政策

无。

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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,033,771.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,665,189.69
5	应收申购款	988,182.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,687,144.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	142,274.10	0.01
2	123001	蓝标转债	200,322.00	0.01
3	132002	15 天集 EB	745,793.90	0.03

7.12.5 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	002072	凯瑞德	94,750,504.08	4.31	重大事项停牌

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
109,614	17,272.52	370,393,069.26	19.56%	1,522,916,929.13	80.44%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	349,379.89	0.02%

8.3 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

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。

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	1,171,351,204.30
本报告期基金总申购份额	3,635,391,341.06
减：本报告期基金总赎回份额	2,913,432,546.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,893,309,998.39

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

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

本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

本报告期内无改聘会计师事务所的情况。

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	4,737,112,553.81	38.75%	4,411,684.01	38.75%	-
兴业证券	2	4,077,525,455.82	33.35%	3,797,392.53	33.35%	-
中信建投	1	2,600,700,613.23	21.27%	2,422,034.93	21.27%	-
渤海证券	1	712,928,730.24	5.83%	663,947.87	5.83%	-
申万宏源	2	97,011,880.48	0.79%	90,348.57	0.79%	-

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
长城证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	23,236,731.03	97.47%	-	-	-	-
兴业证券	603,909.90	2.53%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-07
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新希望”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	2016-01-12
5	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金牛网为销售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	2016-01-14
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新海宜”、“蓝色光标”、“宁波港”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	2016-01-16

7	华安基金管理有限公司关于参加渤海银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
8	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝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	2016-01-19
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“凯撒旅游”、“安徽水利”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	2016-01-20
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-25
11	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	2016-01-25
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长信科技”、“慧球科技”、“升华拜克”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	2016-01-29
13	华安基金管理有限公司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	2016-02-03
14	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加郑州银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-04
15	华安基金管理有限公司关于华安宝利配置证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入及定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-16
16	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“众和股份”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	2016-02-16
17	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
18	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正为销售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	2016-02-25
19	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏州银行为销售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	2016-03-23
20	华安宝利配置证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入及定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-23
21	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-24

		司网站	
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“富春通信”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	2016-03-26
23	华安基金管理有限公司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	2016-03-28
24	华安基金管理有限公司关于华安旗下基金参加工商银行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	2016-03-30
25	华安基金管理有限公司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	2016-03-30
26	华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
27	华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-11
28	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赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
29	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售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	2016-04-19
30	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加格上理财为销售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	2016-04-26
31	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中经北证为销售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	2016-04-29
32	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
33	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
34	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
35	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金观诚为销售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	2016-05-10
36	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平	《上海证券报》、《证券时	2016-05-10

	台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
37	华安基金管理有限公司关于华安旗下部分基金参加民生银行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	2016-05-14
38	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
39	华安基金管理有限公司关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-25
40	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售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	2016-06-02
41	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晟视天下为销售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	2016-06-03
42	华安基金管理有限公司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	2016-06-08
43	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售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	2016-06-14
44	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广源达信为销售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	2016-06-21
45	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通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	2016-06-23
46	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加东亚中国费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-27
47	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28
48	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东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	2016-06-28

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 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
二〇一六年八月二十六日