

# 华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证 券投资基金(LOF) 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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

送出日期：2017 年 8 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	8
2.6 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	42
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	52
7.7 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.....	52
7.8 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.....	52
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金融衍生品投资明细.....	52
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	53
7.11 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.4 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.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	62
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数 (LOF)
场内简称	香港中小
基金主代码	501021
交易代码	501021
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2016年6月24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	1,557,338,077.61份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年7月6日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过5%。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>1、组合复制策略 本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>2、替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p> <p>3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将适当</p>

	<p>投资于债券和货币市场工具，固定收益投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。</p>
业绩比较基准	经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑安国	王洪章

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	State Street Bank and Trust Company

	中文	-	美国道富银行有限公司
注册地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		-	02111

## 2.5 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》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号



## § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	55,078,916.98
本期利润	128,044,070.75
加权平均基金份额本期利润	0.0886
本期加权平均净值利润率	7.52%
本期基金份额净值增长率	14.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	48,606,613.32
期末可供分配基金份额利润	0.0312
期末基金资产净值	1,882,501,428.73
期末基金份额净值	1.2088
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	20.88%

### 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
过去一个月	0.63%	0.67%	0.23%	0.64%	0.40%	0.03%
过去三个月	1.77%	0.68%	1.21%	0.66%	0.56%	0.02%
过去六个月	14.02%	0.74%	13.32%	0.73%	0.70%	0.01%
过去一年	20.87%	0.79%	25.20%	0.80%	-4.33%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	20.88%	0.78%	27.20%	0.81%	-6.32%	-0.03%

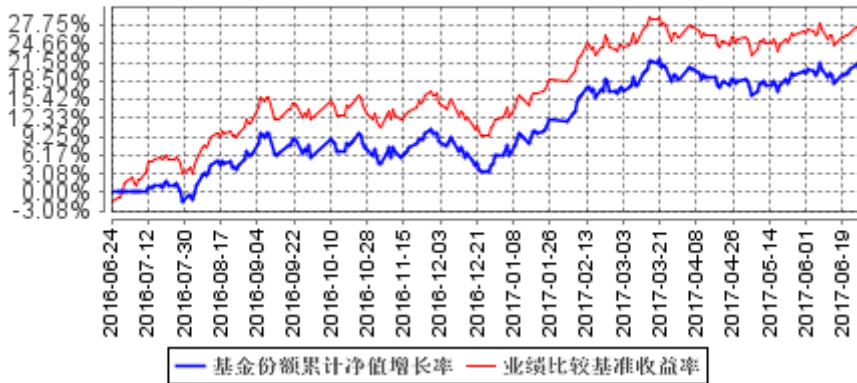
注：1、本基金业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

(2016年6月24日至2017年6月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至2016年12月24日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 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

基金管理人是在 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（2017 年 6 月 30 日），所管理的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、中国互联网基金、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、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来产业主导基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金及新优享基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 122,557,514,320.78 元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周晶	国际业务部总经理，本基金基金经理、华宝油气、华宝中国互联股票、美国消	2016 年 6 月 24 日	-	11 年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005 年至 2007 年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计

	费、华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数（场内简称“香港大盘”）基金经理、华宝兴业资产管理（香港）有限公司总经理			风险管理部主管，2011年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师，现任国际业务部总经理。2013年6月至2015年11月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2014年9月起兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金经理，2015年9月兼任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理，2016年3月任华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）经理。2016年6月任华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年4月任华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理（香港）有限公司总经理。
--	---	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金在短期内出现过持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于 5%以及投资于标的指数、备选成分股占基金资产净值低于 80%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

### **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**

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。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和公司内部制度要求，分析了本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）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

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**

本基金采用全复制方法跟踪标普香港中小盘指数。整个 17 年上半年，随着中国经济趋于稳定，海外资金开始回流香港，而同时随着深港通的开通，南下资金也不断涌入估值更加合理的香港市场，香港股市一路上行。一季度港股中小盘板块表现靓丽，但在二季度港股板块表现出现了分化，资金追逐成长确定性高的行业龙头的趋势明显，龙头企业的估值水平得到了进一步的提升。因此整个港股中小盘板块二季度表现相较恒生大盘有所减弱。

截止 2017/6/30，标普香港中小盘指数收 2726.52，涨幅 17.5%。恒生指数 17 年上半年上涨 17.1%，标的指数涨幅略超过恒生涨幅。指数年化日均波幅 14.3%，恒生指数 10.1%。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2017 年上半年人民币汇率震荡上行。上半年人行港币中

间价从 0.8945 升值至 0.8679, 相对于港币升值 3.0%。同期, 人民币交易价也相对于港币升值 3.1% 左右。基金在仓位控制上一直比较谨慎, 尽可能使得基金的业绩表现能够和业绩比较基准贴近。整个上半年, 香港中小基金年化跟踪误差(剔除汇率因素) 约为 0.6%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末, 本报告期内基金份额净值增长率为 14.02%, 同期业绩比较基准收益率为 13.32%, 基金表现略高于业绩比较基准。高于基准的主要原因是仓位控制以及基金规模波动导致的汇兑损益。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在当前时点展望 2017 年下半年, 我们对港股市场走势持乐观看法, 预计恒生主要指数均仍将呈振荡上行态势。就基本面而言, 海外市场的干扰因素不多, 目前看, 美国经济仍在缓慢复苏的过程中。同时, 特朗普新政的推进进度显著慢于预期, 也使经济短期内获得新的增长动能的可能性大打折扣; 面对缓慢增长的经济, 我们认为联储的货币政策不会出现超预期的收紧, 预期整体仍然偏鸽派, 从而减少对新兴市场的冲击; 而欧洲市场则在法国大选后, 最大不确定性消除, 整体经济亦持续其复苏路径, 有利于市场的风险偏好上升; 而国内经济增速下半年尽管仍可能有所放缓, 但得益于上半年经济增长的超预期表现, 及外需的持续改善, 全年达到年初设定的 6.5% 增速的压力并不大, 预计整体经济仍能维持有序的放缓, 从而使其对市场的负面影响已大部分反映在了当前的股价中。

从估值看, 港股当前依然落后于海外主要市场, 相较 A 股市场也仍然有明显的估值优势, 尤其恒生中盘股目前估值仅为市盈率 15 倍左右, 相对 A 股的估值优势更大。中国经济的韧性如果能持续好于预期, 则估值优势将成为吸引各路资金的重要因素; 同时, 港股通机制的设立及南下资金总额度的取消也为国内资金提供了投资港股市场的便利, 有利于活跃市场成交, 增加市场的吸引力。展望未来, 考虑到香港增量资金仍以机构投资人为主, 机构对业绩的重视决定了资金对行业龙头及基本面优秀的公司的偏好, 并最终体现在优秀公司的市值增长上。由于标的指数标普香港中小盘指数正是以市值排序来选择其成分股, 且其中又以中盘股为主, 因此也将受益于未来市场的这一变化趋势。

尽管存在上述利好, 但我们认为仍需关注国内经济及全球主要经济体下半年的经济表现。海

外主要经济体强势的复苏将迫使其央行加快货币紧缩的步伐，从而收紧市场流动性，并对其他经济体，尤其是新兴市场带来冲击。同时，国内经济的表现也需要紧密跟踪。一旦整体经济表现低于预期，则仍将可能对市场造成冲击。而在港股今年以来整体涨幅已经比较大的情况下，上述风险点如果爆发，虽然不会改变港股向上的长期趋势，但是短期对市场造成的杀伤力可能会较大。

#### **4.6 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其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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **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**

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体： 华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	64,787,028.52	46,872,219.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,798,480,289.42	887,117,534.20
其中：股票投资		1,798,480,289.42	887,117,534.20
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		37,280,281.37	-
应收利息	6.4.7.5	12,458.04	3,295.43
应收股利		12,885,567.24	276,547.11
应收申购款		146,698.52	160,847.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,902.05	1,789,800.00
资产总计		1,913,594,225.16	936,220,243.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		316.12	83.78
应付赎回款		26,960,153.48	14,602,657.34
应付管理人报酬		1,600,303.41	807,667.34
应付托管费		400,075.88	201,916.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,218,754.98	395,972.64

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	913,192.56	2,224,158.26
负债合计		31,092,796.43	18,232,456.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,557,338,077.61	865,828,244.25
未分配利润	6.4.7.10	325,163,351.12	52,159,543.18
所有者权益合计		1,882,501,428.73	917,987,787.43
负债和所有者权益总计		1,913,594,225.16	936,220,243.64

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2088 元，基金份额总额 1,557,338,077.61 份。

## 6.2 利润表

公告主体：华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 6 月 24 日 (基金 合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		143,682,590.44	146,566.81
1. 利息收入		466,661.96	146,579.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	466,661.96	45,040.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	101,538.78
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		71,670,836.78	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	48,745,743.22	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	45,873.82	-
股利收益	6.4.7.16	22,879,219.74	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	72,965,153.77	-

4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-2,577,624.97	-12.54
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	1,157,562.90	-
<b>减: 二、费用</b>		15,638,519.69	100,744.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,362,044.45	70,739.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,090,511.14	17,684.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,601,968.01	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	583,996.09	12,319.53
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		128,044,070.75	45,822.61
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		128,044,070.75	45,822.61

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2017年1月1日至2017年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	865,828,244.25	52,159,543.18	917,987,787.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	128,044,070.75	128,044,070.75
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)	691,509,833.36	144,959,737.19	836,469,570.55
其中: 1. 基金申购款	1,513,086,486.19	290,547,407.91	1,803,633,894.10
2. 基金赎回款	-821,576,652.83	-145,587,670.72	-967,164,323.55
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)	1,557,338,077.61	325,163,351.12	1,882,501,428.73
项目	上年度可比期间 2016年6月24日(基金合同生效日)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)	431,503,809.43	-	431,503,809.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	45,822.61	45,822.61
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	431,503,809.43	45,822.61	431,549,632.04

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：

<u>黄小薏</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]626号《关于准予华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)注册的批复》的核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)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 431,404,826.85 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 828 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 431,503,809.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 98,982.58 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,境外资产托管人为道富银行(State Street Bank and Trust Company)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]175 号核准,本基金于 2016 年 7 月 6 日于上交所挂牌交易。基金份额持有人通过场外代销机构持有的基金份额,需转托管至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标普香港上市中国中小盘指数成份股、备选成份股、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪标普香港上市中国中小盘指数的股指期货等金融衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会相关规定)。本基金在投资香港特别行政区证券市场挂牌交易的股票时,在法律法规允许的前提下,既可通过合格境内机构投资者的额度进行投资,也可通过沪港股票市场互联互通机制进行投资。本基金投资于标普香港上市中国中小盘指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产的 80%;投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率 $\times$ 95%+人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业标普香港上市中国

中小盘指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 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。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	64,787,028.52
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	64,787,028.52

注：于 2017 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 54,833,439.41 元，港元活期存款 11,468,325.55 元(折合人民币 9,953,589.11 元)。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,722,000,121.30	1,798,480,289.42	76,480,168.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,722,000,121.30	1,798,480,289.42	76,480,168.12

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	12,454.27
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3.77
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	12,458.04



#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	1,902.05
待摊费用	-
合计	1,902.05

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,218,754.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,218,754.98

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	93,605.94
预提费用	208,488.47
应付数据费	31,552.45
应付指数使用费	579,545.70
合计	913,192.56

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	865,828,244.25	865,828,244.25
本期申购	1,513,086,486.19	1,513,086,486.19
本期赎回(以“-”号填列)	-821,576,652.83	-821,576,652.83
本期末	1,557,338,077.61	1,557,338,077.61

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：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	-1,635,837.86	53,795,381.04	52,159,543.18
本期利润	55,078,916.98	72,965,153.77	128,044,070.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,836,465.80	149,796,202.99	144,959,737.19
其中：基金申购款	2,152,847.35	288,394,560.56	290,547,407.91
基金赎回款	-6,989,313.15	-138,598,357.57	-145,587,670.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,606,613.32	276,556,737.80	325,163,351.12

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	256,065.17
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	74,074.48
其他	136,522.31
合计	466,661.96

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	881,253,705.34
减：卖出股票成本总额	832,507,962.12
买卖股票差价收入	48,745,743.22

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出权证成交总额	45,873.82
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	45,873.82

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,879,219.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,879,219.74

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	72,965,153.77
——股票投资	72,965,153.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	72,965,153.77

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	1,157,562.90
合计	1,157,562.90

注：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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	4,601,968.01
银行间市场交易费用	-
合计	4,601,968.01

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	115,760.05
银行划款手续费	780.00
指数使用费	434,727.62
合计	583,996.09

### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

根据中国证监会于 2017 年 7 月 21 日发布的《关于核准华宝兴业基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可（2017）1321 号），中国证监会已核准“领先资产管理有限公司”将持有的我公司 49% 的股权转让给 Warburg Pincus Asset Management, L.P.。我公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜，敬请投资者知悉。

##### 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
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
道富银行(State Street Bank and Trust Corporation)	境外资产托管人
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

## 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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年6月24日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,362,044.45	70,739.74
其中：支付销售机构的客户维护费	516,870.96	26,884.45

注：支付基金管理人 华宝兴业 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年6月24日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,090,511.14	17,684.93

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 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

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年6月24日(基金合同生效 日)至2016年6月30日
基金合同生效日(2016年6月24日)持有的基金份额	-	694,444.44
期初持有的基金份额	694,444.44	-

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	694,444.44	694,444.44
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.04%	0.16%

注：基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月24日(基金合同生效日)至2016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
中国建设银行	54,833,954.37	256,065.17	31,503,449.43	45,040.57
道富银行	9,953,074.15	-	-	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国道富银行有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 6.4.12 期末（2017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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 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
1378 HK	中国宏桥	2017年3月22日	重大事项停牌	4.50	-	-	1,553,000	9,575,101.44	6,995,495.95	-

注：期末估值单价为交易币种单价按当日估值汇率折算后的人民币单价。

#### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金为指数型基金，跟踪标普香港上市中国中小盘指数。本基金在日常经营活动中面临的与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与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察



稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和监察稽核部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，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的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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同责任，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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行和道富银行，因而与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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的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 2017 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

### 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。本基金持有的法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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。

于 2017 年 6 月 30 日，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等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	64,787,028.52	-	-	-	64,787,028.52
交易性金融资产	-	-	-	1,798,480,289.42	1,798,480,289.42
应收利息	-	-	-	12,458.04	12,458.04
应收股利	-	-	-	12,885,567.24	12,885,567.24
应收申购款	795.83	-	-	145,902.69	146,698.52
其他资产	-	-	-	37,282,183.42	37,282,183.42
资产总计	64,787,824.35	-	-	1,848,806,400.81	1,913,594,225.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	316.12	316.12
应付赎回款	-	-	-	26,960,153.48	26,960,153.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,600,303.41	1,600,303.41
应付托管费	-	-	-	400,075.88	400,075.88
应付交易费用	-	-	-	1,218,754.98	1,218,754.98
其他负债	-	-	-	913,192.56	913,192.56
负债总计	-	-	-	31,092,796.43	31,092,796.43
利率敏感度缺口	64,787,824.35	-	-	-1,817,713,604.38	1,882,501,428.73
上年度末 2016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	46,872,219.78	-	-	-	46,872,219.78
交易性金融资产	-	-	-	887,117,534.20	887,117,534.20
应收利息	-	-	-	3,295.43	3,295.43
应收股利	-	-	-	276,547.11	276,547.11
应收申购款	1,491.06	-	-	159,356.06	160,847.12

其他资产	-	-	-	1,789,800.00	1,789,800.00
资产总计	46,873,710.84	-	-	889,346,532.80	936,220,243.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	83.78	83.78
应付赎回款	-	-	-	14,602,657.34	14,602,657.34
应付管理人报酬	-	-	-	807,667.34	807,667.34
应付托管费	-	-	-	201,916.85	201,916.85
应付交易费用	-	-	-	395,972.64	395,972.64
其他负债	-	-	-	2,224,158.26	2,224,158.26
负债总计	-	-	-	18,232,456.21	18,232,456.21
利率敏感度缺口	46,873,710.84	-	-	871,114,076.59	917,987,787.43

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2016年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	9,953,589.11	-	9,953,589.11
交易性金融资产	-	1,798,480,289.42	-	1,798,480,289.42
应收股利	-	2,703,513.72	-	2,703,513.72
应收利息	-	49.71	-	49.71
应收证券清算款	-	37,280,281.37	-	37,280,281.37
其它资产	-	1,902.05	-	1,902.05
资产合计	-	1,848,419,625.38	-	1,848,419,625.38
以外币计价的负债				
其它负债	31,552.45	-	-	31,552.45
负债合计	31,552.45	-	-	31,552.45

资产负债表外汇风险敞口净额	-31,552.45	1,848,419,625.38	-	1,848,388,072.93
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	39,490,392.66	-	39,490,392.66
交易性金融资产	-	887,117,534.20	-	887,117,534.20
应收股利	-	146,589.15	-	146,589.15
应收利息	-	15.69	-	15.69
资产合计	-	926,754,531.70	-	926,754,531.70
以外币计价的负债				
其它负债	15,502.11	1,789,020.00	-	1,804,522.11
负债合计	15,502.11	1,789,020.00	-	1,804,522.11
资产负债表外汇风险敞口净额	-15,502.11	924,965,511.70	-	924,950,009.59

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	90,588,176.13	46,247,500.48
	所有外币相对人民币贬值5%	-90,588,176.13	-46,247,500.48

#### 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的股票，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。

本基金采用指数化投资策略，股票资产跟踪的标的指数为标普香港上市中国中小盘指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标普香港上市中国中小盘指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的80%。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 2017年6月30日		上年度末 2016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	1,798,480,289.42	95.54	887,117,534.20	96.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	1,798,480,289.42	95.54	887,117,534.20	96.64

#### 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：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	87,647,205.18	-
业绩比较基准下降5%	-87,647,205.18	-	

注：于2016年12月31日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,791,484,793.47 元，第二层次的余额为 6,995,495.95 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 887,117,534.20 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非

保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 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	1,798,480,289.42	93.98
	其中: 普通股票	1,798,480,289.42	93.98
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	64,787,028.52	3.39
8	其他各项资产	50,326,907.22	2.63
9	合计	1,913,594,225.16	100.00

### 7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	1,798,480,289.42	95.54
合计	1,798,480,289.42	95.54

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
电信业务	10,162,475.28	0.54
房地产	156,004,420.12	8.29
非日常生活消费品	361,369,618.71	19.20
工业	284,759,947.70	15.13
公用事业	124,523,711.04	6.61
金融	149,150,687.61	7.92
能源	43,630,998.02	2.32
日常消费品	140,338,116.08	7.45
信息技术	202,989,732.81	10.78
医疗保健	180,974,108.83	9.61
原材料	144,576,473.22	7.68
合计	1,798,480,289.42	95.54

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车	175 HK	香港	中国香港	5,530,000	80,825,223.58	4.29
2	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	香港	中国香港	4,874,000	48,224,759.71	2.56
3	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	中国香港	728,000	44,229,203.20	2.35
4	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国汽车控股有限公司	1114 HK	香港	中国香港	3,180,000	39,246,995.23	2.08

5	CHINA MENGNIU DAIRY CO	蒙牛乳业	2319 HK	香港	中国香港	2,946,000	39,120,452.49	2.08
6	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	百丽	1880 HK	香港	中国香港	7,248,000	38,750,614.42	2.06
7	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	香港	中国香港	4,147,500	32,577,268.71	1.73
8	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	270 HK	香港	中国香港	3,200,000	29,884,221.44	1.59
9	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	香港	中国香港	4,918,000	29,452,170.87	1.56
10	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	华润啤酒	291 HK	香港	中国香港	1,694,000	28,964,052.65	1.54
11	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国控股有限公司	1918 HK	香港	中国香港	2,004,000	28,385,566.62	1.51
12	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水务集团	371 HK	香港	中国香港	5,332,000	28,044,161.60	1.49
13	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港	中国香港	609,000	27,115,296.26	1.44
14	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港	中国香港	1,563,800	26,846,470.19	1.43
15	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	香港	中国香港	1,138,000	25,482,478.37	1.35
16	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港	中国香港	1,963,000	24,363,295.53	1.29
17	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	中国光大国际	257 HK	香港	中国香港	2,877,000	24,320,836.89	1.29
18	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器	1169 HK	香港	中国香港	1,337,000	23,556,303.51	1.25
19	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港	中国香港	3,774,000	22,928,710.56	1.22
20	GF SECURITIES CO LTD-H	广发证券	1776 HK	香港	中国香港	1,684,600	22,925,697.14	1.22
21	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	香港	中国香港	1,720,400	22,397,543.52	1.19
22	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑	3311 HK	香港	中国香港	1,856,000	21,521,083.19	1.14

		国际						
23	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港	中国香港	742,000	21,316,288.78	1.13
24	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 HK	香港	中国香港	3,688,000	21,189,884.91	1.13
25	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华润燃气	1193 HK	香港	中国香港	896,000	20,724,540.92	1.10
26	FULLSHARE HOLDINGS LTD	丰盛控股	607 HK	香港	中国香港	7,510,000	20,336,407.10	1.08
27	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港	中国香港	1,014,000	20,241,630.24	1.08
28	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	香港	中国香港	595,400	19,791,891.46	1.05
29	LONGFOR PROPERTIES	龙湖地产	960 HK	香港	中国香港	1,339,500	19,508,072.93	1.04
30	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	建滔化工	148 HK	香港	中国香港	711,500	19,205,029.99	1.02
31	MEITU INC	美图公司	1357 HK	香港	中国香港	2,448,000	18,059,679.36	0.96
32	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港	中国香港	2,626,000	17,617,890.72	0.94
33	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港	中国香港	1,461,000	17,118,420.12	0.91
34	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	北京控股	392 HK	香港	中国香港	521,500	17,041,153.54	0.91
35	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港	中国香港	3,379,000	16,657,745.54	0.88
36	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港	中国香港	1,830,000	16,518,253.44	0.88
37	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	康傅控股	322 HK	香港	中国香港	2,012,000	16,170,321.67	0.86
38	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	香港	中国香港	5,563,000	15,788,341.40	0.84
39	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	香港	中国香港	758,100	15,297,806.04	0.81
40	CREDIT CHINA FINTECH HOLDING	中国信贷	8207 HK	香港	中国香港	15,832,000	14,840,182.20	0.79
41	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都机场	694 HK	香港	中国香港	1,554,000	14,836,224.48	0.79

42	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂 房地 产	813 HK	香 港	中 国 香 港	1,252,500	14,523,252.53	0.77
43	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江 西 铜 业	358 HK	香 港	中 国 香 港	1,298,000	14,442,501.26	0.77
44	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福 耀 玻 璃	3606 HK	香 港	中 国 香 港	550,000	14,272,944.40	0.76
45	COSCO SHIPPING PORTS LTD	中 远 海 运 港 口	1199 HK	香 港	中 国 香 港	1,772,000	14,087,660.84	0.75
46	KINGSOFT CORP LTD	金 山 软 件	3888 HK	香 港	中 国 香 港	797,000	14,076,751.08	0.75
47	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙 江 沪 杭 甬	576 HK	香 港	中 国 香 港	1,560,000	13,810,343.04	0.73
48	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上 海 石 化	338 HK	香 港	中 国 香 港	3,802,000	13,793,297.09	0.73
49	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	阿 里 影 业	1060 HK	香 港	中 国 香 港	12,080,000	13,629,815.68	0.72
50	CHINA EVERBRIGHT LTD	中 国 光 大 控 股	165 HK	香 港	中 国 香 港	916,000	13,515,250.24	0.72
51	SUN ART RETAIL GROUP LTD	高 鑫 零 售	6808 HK	香 港	中 国 香 港	2,386,500	12,883,430.52	0.68
52	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	宁 沪 高 速	177 HK	香 港	中 国 香 港	1,330,000	12,720,756.27	0.68
53	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中 国 建 材	3323 HK	香 港	中 国 香 港	3,132,000	12,613,030.04	0.67
54	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍 柴 动 力	2338 HK	香 港	中 国 香 港	2,114,000	12,549,914.90	0.67
55	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重 庆 农 村 商 业 银 行	3618 HK	香 港	中 国 香 港	2,734,000	12,505,147.58	0.66
56	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深 圳 国 际	152 HK	香 港	中 国 香 港	1,001,000	12,441,043.02	0.66
57	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖 州 煤 业	1171 HK	香 港	中 国 香 港	1,932,000	11,737,750.08	0.62
58	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富 力 地 产	2777 HK	香 港	中 国 香 港	1,104,400	11,636,564.50	0.62
59	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理 文 造 纸	2314 HK	香 港	中 国 香 港	1,769,000	11,131,290.98	0.59
60	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青 岛 啤 酒	168 HK	香 港	中 国 香 港	370,000	11,095,055.32	0.59

61	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	山东威高	1066 HK	香港	中国香港	2,048,000	10,896,075.99	0.58
62	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	远洋集团	3377 HK	香港	中国香港	3,270,000	10,841,535.88	0.58
63	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油服	2883 HK	香港	中国香港	1,970,000	10,703,363.03	0.57
64	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能源	958 HK	香港	中国香港	5,090,000	10,646,687.84	0.57
65	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	复星医药	2196 HK	香港	中国香港	405,500	10,646,232.19	0.57
66	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港	中国香港	3,936,000	10,214,238.03	0.54
67	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	国美电器	493 HK	香港	中国香港	12,250,000	10,206,739.20	0.54
68	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信服务	552 HK	香港	中国香港	2,602,000	10,162,475.28	0.54
69	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股	363 HK	香港	中国香港	497,000	9,964,329.14	0.53
70	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港	中国香港	13,344,000	9,844,295.81	0.52
71	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	604 HK	香港	中国香港	3,246,000	9,719,575.70	0.52
72	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动	658 HK	香港	中国香港	1,281,000	9,505,937.19	0.50
73	3SBIO INC	三生制药	1530 HK	香港	中国香港	1,046,500	9,409,762.98	0.50
74	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	香港	中国香港	686,500	9,223,403.20	0.49
75	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	香港	中国香港	4,764,000	9,220,539.07	0.49
76	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港	中国香港	1,774,000	9,145,759.08	0.49
77	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	中远海控	1919 HK	香港	中国香港	2,807,000	8,989,767.81	0.48
78	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港	中国香港	2,256,000	8,967,766.04	0.48
79	BBMG CORP-H	金隅股份	2009 HK	香港	中国香港	2,544,000	8,699,474.61	0.46

80	DALI FOODS GROUP CO LTD	达利食品	3799 HK	香港	中国香港	2,234,500	8,688,365.23	0.46
81	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	2380 HK	香港	中国香港	3,600,000	8,654,898.24	0.46
82	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港	中国香港	2,052,000	8,637,713.42	0.46
83	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	香港	中国香港	677,000	8,555,191.59	0.45
84	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港	中国香港	2,299,000	8,260,741.05	0.44
85	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	香港	中国香港	2,333,000	8,099,429.44	0.43
86	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际	336 HK	香港	中国香港	1,995,000	8,068,791.87	0.43
87	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产	123 HK	香港	中国香港	6,768,000	7,812,529.80	0.42
88	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国	220 HK	香港	中国香港	1,410,000	7,721,971.03	0.41
89	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	中国国际金融股份有限公司	3908 HK	香港	中国香港	760,800	7,606,811.93	0.40
90	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	香港	中国香港	1,142,500	7,506,401.40	0.40
91	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港	中国香港	1,951,000	7,247,375.02	0.38
92	ZALL GROUP LTD	卓尔发展	2098 HK	香港	中国香港	1,869,000	7,218,534.04	0.38
93	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	中国宏桥	1378 HK	香港	中国香港	1,553,000	6,995,495.95	0.37
94	YINGDE GASES GROUP CO LTD	盈德气体	2168 HK	香港	中国香港	1,319,000	6,880,166.74	0.37
95	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港	中国香港	838,000	6,851,325.76	0.36
96	SOHO CHINA LTD	SOHO中国	410 HK	香港	中国香港	2,036,000	6,803,277.71	0.36
97	CHINA AGRI-INDUSTRIES	中国粮油	606 HK	香港	中国香港	2,398,000	6,743,321.80	0.36

	HLDGS	控股						
98	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	1813 HK	香港	中国香港	1,461,500	6,634,072.37	0.35
99	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	1313 HK	香港	中国香港	1,918,000	6,458,921.77	0.34
100	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地产	272 HK	香港	中国香港	3,841,000	6,300,656.56	0.33
101	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业集团	119 HK	香港	中国香港	2,111,000	6,284,374.38	0.33
102	COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	中远海发	2866 HK	香港	中国香港	4,080,000	6,090,715.40	0.32
103	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业	1818 HK	香港	中国香港	1,084,000	6,011,873.54	0.32
104	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港	中国香港	1,182,000	5,970,629.98	0.32
105	CAR INC	神州租车	699 HK	香港	中国香港	926,000	5,762,485.41	0.31
106	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港	中国香港	2,027,000	5,717,639.98	0.30
107	MMG LTD	五矿资源	1208 HK	香港	中国香港	2,248,000	5,619,122.38	0.30
108	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港	中国香港	2,659,000	5,584,874.25	0.30
109	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	香港	中国香港	1,051,000	5,482,225.36	0.29
110	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港	中国香港	544,000	5,382,492.67	0.29
111	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	1071 HK	香港	中国香港	1,774,000	5,373,518.38	0.29
112	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海能	1138 HK	香港	中国香港	1,410,000	5,335,624.99	0.28
113	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	525 HK	香港	中国香港	1,556,000	5,226,371.22	0.28
114	CHINA RESOURCES PHOENIX HEAL	华润凤凰医疗	1515 HK	香港	中国香港	620,500	5,175,411.30	0.27
115	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	323 HK	香港	中国香港	1,886,000	5,107,119.01	0.27
116	SHENZHEN	深高	548	香	中国	764,000	4,714,576.16	0.25



	EXPRESSWAY CO-H	速	HK	港	香港			
117	ZOOLION HEAVY INDUSTRY - H	中联 重科	1157 HK	香港	中国 香港	1,404,400	4,631,846.02	0.25
118	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港 中旅	308 HK	香港	中国 香港	2,370,000	4,628,183.40	0.25
119	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电 福新	816 HK	香港	中国 香港	2,796,000	4,537,937.08	0.24
120	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云 山	874 HK	香港	中国 香港	240,000	4,468,052.16	0.24
121	LONKING HOLDINGS LTD	中国 龙工	3339 HK	香港	中国 香港	2,049,000	4,357,001.80	0.23
122	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	中国 机械 设备 工程 股份 有限 公司	1829 HK	香港	中国 香港	899,000	4,299,233.04	0.23
123	UNIVERSAL MEDICAL FINANCIAL	环球 医疗	2666 HK	香港	中国 香港	784,000	4,246,003.51	0.23
124	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代 牧业	1117 HK	香港	中国 香港	2,935,000	3,948,385.06	0.21
125	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶 教育	1317 HK	香港	中国 香港	690,000	3,820,757.42	0.20
126	HEALTH AND HAPPINESS H&H INT	合生 元	1112 HK	香港	中国 香港	199,500	3,421,444.79	0.18
127	CSSC OFFSHORE & MARINE ENG-H	中船 防务	317 HK	香港	中国 香港	270,000	3,271,364.07	0.17
128	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海 石油 化学	3983 HK	香港	中国 香港	1,926,000	3,092,485.75	0.16
129	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦 制药	3933 HK	香港	中国 香港	672,000	3,003,697.54	0.16
130	WEST CHINA CEMENT LTD	西部 水泥	2233 HK	香港	中国 香港	2,890,000	2,959,780.78	0.16
131	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐 汽车	3836 HK	香港	中国 香港	840,000	2,719,366.94	0.14
132	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	中集 安瑞 科	3899 HK	香港	中国 香港	632,000	2,676,804.14	0.14
133	COGOBUY GROUP	科通 芯城	400 HK	香港	中国 香港	629,000	2,238,278.89	0.12
134	IMAX CHINA HOLDING	IMAX	1970	香	中国	100,900	2,097,376.42	0.11

	INC	(中 国)	HK	港	香港			
135	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	辉山 乳业	6863 HK	香 港	中 国 香 港	4,338,000	1,581,315.52	0.08

#### 7.4.2 积极投资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益投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	52,403,053.19	5.71
2	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	48,552,503.41	5.29
3	MEITU INC	1357 HK	44,123,608.95	4.81
4	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	36,188,313.38	3.94
5	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	34,596,517.01	3.77
6	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	31,125,763.16	3.39
7	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	29,440,055.92	3.21
8	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1880 HK	28,704,633.34	3.13
9	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	25,394,566.02	2.77
10	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	24,194,551.68	2.64
11	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	23,429,366.83	2.55
12	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	23,124,232.04	2.52
13	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	22,969,742.08	2.50
14	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	22,765,882.30	2.48
15	CHINA TAIPING INSURANCE	966 HK	22,669,931.74	2.47

	HOLD			
16	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	22,607,671.95	2.46
17	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	21,705,345.26	2.36
18	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	20,892,417.75	2.28
19	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6886 HK	20,844,021.17	2.27
20	GF SECURITIES CO LTD-H	1776 HK	20,204,065.34	2.20
21	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	19,446,288.87	2.12
22	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	19,268,399.34	2.10
23	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	19,267,176.26	2.10
24	CREDIT CHINA FINTECH HOLDING	8207 HK	18,886,153.19	2.06

注：买入金额不包括相关交易费用。

## 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	27,935,761.99	3.04
2	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	21,376,445.14	2.33
3	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	19,109,397.11	2.08
4	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	17,681,766.94	1.93
5	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	17,644,091.55	1.92
6	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1880 HK	17,556,183.88	1.91
7	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	13,471,063.67	1.47
8	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	13,349,480.56	1.45
9	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	13,325,234.71	1.45
10	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	13,289,754.32	1.45
11	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	13,279,368.13	1.45

12	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	12,690,715.13	1.38
13	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	12,546,240.90	1.37
14	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	12,434,874.37	1.35
15	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	12,409,803.48	1.35
16	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	11,600,102.37	1.26
17	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	11,315,127.66	1.23
18	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6886 HK	11,295,934.88	1.23
19	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	10,953,927.59	1.19
20	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	10,585,319.26	1.15

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,670,905,563.57
卖出收入（成交）总额	881,253,705.34

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

报告期末，本基金未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 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	应收证券清算款	37,280,281.37
3	应收股利	12,885,567.24
4	应收利息	12,458.04
5	应收申购款	146,698.52
6	其他应收款	1,902.05
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,326,907.22

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.11.5.1 期末指数投资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情况。

#### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。



## § 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
9,059	171,910.59	1,405,718,344.20	90.26%	151,619,733.41	9.74%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	永安国富资产管理有限公司—永安国富—价值3号私募投资基金	71,085,869.00	29.29%
2	招商证券股份有限公司	40,388,708.00	16.64%
3	昌都市凯丰投资管理有限公司—凯丰宏观对冲11号私募基金	17,107,784.00	7.05%
4	长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划	10,477,715.00	4.32%
5	天津民晟资产管理有限公司—民晟全天候1号私募证券投资基金	8,434,463.00	3.48%
6	兴业全球基金—工商银行—兴全特定策略33号特定多客户资产管理计划	6,843,299.00	2.82%
7	长江证券—交行—长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	4,585,900.00	1.89%
8	李爱莲	3,319,600.00	1.37%
9	华夏资本—农业银行—华夏资本—民晟资产2号资产管理计划	2,628,000.00	1.08%
10	兴业全球基金—工商银行—兴全套利期权6号特定多客户资产管理计划	2,556,945.00	1.05%

### 8.3 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	51,130.25	0.0033%
------------------	-----------	---------

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年6月24日）基金份额总额	431,503,809.43
本报告期期初基金份额总额	865,828,244.25
本报告期基金总申购份额	1,513,086,486.19
减：本报告期基金总赎回份额	821,576,652.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,557,338,077.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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、基金管理人的重大人事变动

2017年6月9日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强因个人原因，自2017年5月31日起不再担任副总经理的职务。

2017年8月11日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自2017年8月9日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

### 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 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	
DAIWA	-	1,135,461,861.60	44.81%	454,184.79	31.87%	-
中金国际上海	-	1,028,472,062.17	40.59%	822,782.34	57.74%	-
JP	-	370,067,717.10	14.60%	148,026.90	10.39%	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，信誉良好；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期交易单元无变化。

### 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
DAIWA	-	-	-	-	10,796.08	23.53%	-	-
中金国际上海	-	-	-	-	35,077.75	76.47%	-	-
JP	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于开通华宝兴业网上直销赎回T+0 转申购业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年1月19日
2	关于华宝兴业现金宝E货币基金转换、赎回转申购业务费率优惠公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年2月23日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年2月23日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年2月28日
5	关于华宝兴业现金宝E货币基金转换、赎回转申购业务费率优惠公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年3月24日
6	华宝兴业基金公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券股份有限公司申购费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年4月10日
7	华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)因香港交易所休市暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年4月12日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年4月24日
9	华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)因香港交易所休市暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年4月27日
10	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金首次申购最低金额、追加申购最低金额、定期定额申购最低金额、单笔最低	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年5月15日

	赎回份额、赎回后最低保有份额及基金转换份额限制的公告		
11	关于华宝兴业现金宝E货币基金转换、赎回转申购业务费率优惠公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年5月31日
12	关于华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)增加中银国际证券为代销机构并开展定期定额投资费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年6月5日
13	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金新增财通证券股份有限公司为代销机构并开展费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年6月9日
14	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》及基金管理人网站	2017年6月21日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170103~20170213	184,381,856.70	0.00	0.00	184,381,856.70	11.84
	2	20170103~20170213	200,193,757.60	16,741,168.59	0.00	216,934,926.20	13.93
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2017年8月25日