

华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券  
投资基金  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</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 .....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
基金简称	华宝沪深 300 增强
基金主代码	003876
交易代码	003876
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	306,687,670.20 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深 300 指数增强型基金,在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理,力争实现稳定的优于标的指数的投资收益,追求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金在复制标的指数的基础上通过数量化模型优化投资组合,力求在控制与业绩比较基准偏离度前提下获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略 本基金主要投资于沪深 300 指数成分股及备选股票。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。同时,基于流动性管理及策略性投资的需要,本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。</p> <p>2、股票投资策略 本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合,在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现。</p> <p>(1) 量化行业配置模型 在跟踪偏离风险可控的前提下,结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型,在标的指数行业权重的基础上进行优化。</p> <p>(2) 量化 Alpha 选股模型 本基金采用的是基金管理人量化团队经过对中国证券</p>

市场运行特征的长期研究和检验后自主开发的量化 Alpha 选股模型。该模型主要选取估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析确定各因子的权重，对股票池中的股票进行综合打分后，构建股票投资组合。在此基础上，本基金进一步根据个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，对行业内的个股权重进行动态调整，以保证股票组合的跟踪误差处于可控范围内。股票池包括标的指数的成分股及备选股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成分股中流动性良好、基本面优质及与成分股相关度高的股票。

#### （3）投资组合调整与风险控制

本基金将定期调整投资组合，并会对标的指数成分股保持密切跟踪。在出现因增发、送配、长期停牌后复牌等对成分股在标的指数中权重有影响的情况，或者成分股临时调入调出、成分股出现黑天鹅事件等情况时，本基金将及时对投资组合进行调整。

本基金将通过风险评估模型控制投资组合的跟踪偏离风险。本基金主要采用“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。

本基金的风险控制目标为力争使基金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 7.75%。

#### （4）模型的动态调整

基金管理人量化团队会根据市场变化趋势，定期对量化模型进行动态调整，不断改进量化模型的有效性。

### 3、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货提高投资效率，以更好地实现本基金的投资目标，降低跟踪误差。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金参与股指期货交易时，将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行投资。

### 4、固定收益类投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，可投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益类品种，以保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

### 5、资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的

	<p>品种进行投资。</p> <p>6、其他金融工具投资策略 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以期更好地实现本基金的投资目标。 未来如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p> <p>7、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金将在法律法规允许的范围和比例内，以及风险可控的前提下，基于谨慎原则参与融资和转融通证券出借业务。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	林葛
	联系电话	021-38505888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95599
传真		021-38505777	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		200120	100031
法定代表人		郑安国	周慕冰



## 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》
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	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼

### § 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	3,697,096.84
本期利润	35,699,963.19
加权平均基金份额本期利润	0.2298
本期加权平均净值利润率	21.46%
本期基金份额净值增长率	16.05%
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	3,322,022.13
期末可供分配基金份额利润	0.0108
期末基金资产净值	353,404,248.17
期末基金份额净值	1.1523
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	15.23%

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.88%	0.75%	4.85%	0.64%	2.03%	0.11%
过去三个月	10.03%	0.67%	6.18%	0.59%	3.85%	0.08%
过去六个月	16.05%	0.61%	11.04%	0.54%	5.01%	0.07%
自基金合同生效日起至	15.23%	0.57%	6.27%	0.58%	8.96%	-0.01%

今						
---	--	--	--	--	--	--

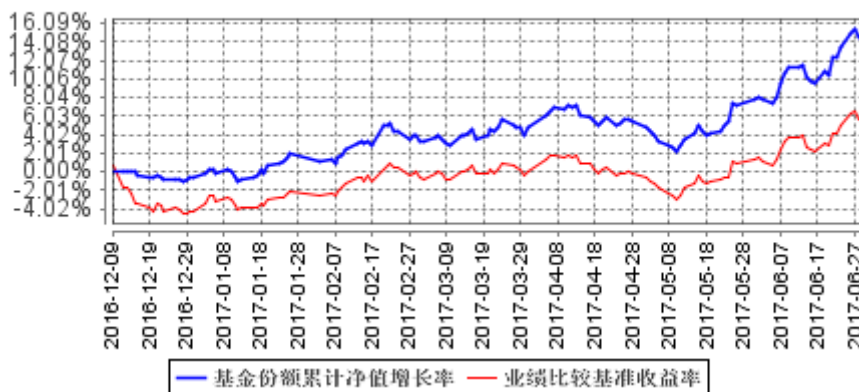
注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

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 12 月 9 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：1、本基金基金合同生效于 2016 年 12 月 9 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。  
2、按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2017 年 6 月 9 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		
徐林明	助理投资总监、量化投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业量化对冲混合、华	2016 年 12 月 9 日	-	15 年	复旦大学经济学硕士，FRM，曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、金

	宝事件驱动混合基金经理				融工程部副总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝兴业中证 100 指数型证券投资基金基金经理，2010 年 2 月起任量化投资部总经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 6 月任助理投资总监，2014 年 9 月兼任华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2015 年 4 月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
王正	本基金基金经理助理、华宝事件驱动混合、华宝量化对冲混合基金经理助理	2016 年 12 月 21 日	-	5 年	硕士。2012 年加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任助理量化分析师、投资经理助理，2014 年 10 月起任华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理助理。2015 年 11 月起兼任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理助理。2016 年 12 月起兼任华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助

					理。
--	--	--	--	--	----

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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，沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在短期内出现过基金资产总值占基金资产净值高于 140%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

基金运用量化 Alpha 选股模型和行业配置模型进行股票筛选和权重配置，在沪深 300 成分股及备选股内精选兼具价值性和成长性、基本面优良的股票，在跟踪沪深 300 指数的基础上力争实现稳定的超越指数的表现。2017 年上半年市场出现明显的结构性分化行情，以上证 50、沪深 300 为代表的大盘蓝筹指数表现亮眼，低估值、高股息的价值股备受关注。在此背景下，基金的增强选股策略实现了较稳定的超额收益，另外 4 月份基金已达到新股申购的市值要求，通过积极参与新股网下申购，进一步增厚产品收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 16.05%，同期业绩比较基准收益率为 11.04%，基金表现领先比较基准 5.01%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年，货币政策维持稳健中性，供给侧改革初见成效，实体经济企稳向好。A 股市场呈现明显的结构性行情，板块和风格的分化加剧，资金进一步向大盘蓝筹股集中，中小市值股票持续疲弱。以银行、保险、券商为代表的低估金融股和煤炭、钢铁、有色为代表的业绩改善周期股表现强劲，投资者对公司基本面的关注不断加强。

展望下半年，预计名义利率上行速度放缓，通胀继续保持在低位，实体经济延续企稳态势，随着各项改革的持续推进，经济体系有望进一步实现结构性优化。从证券市场来看，IPO 大概率延续较为稳定的发行节奏，同时金融监管将持续高压态势，在存量资金博弈的背景下，那些自身竞争力不足、讲故事炒概念的股票将进一步被市场抛弃，符合价值投资理念的公司将取得长期优秀的表现。在板块配置上，看好低估值且业绩改善的周期行业、兼具成长和价值的大消费以及符合长期经济发展方向的智能制造领域；在个股选择上重点关注估值合理、有核心竞争力、财务指标健康等有基本面支撑的优质公司。

#### 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 & 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

本基金为发起式基金，基金合同于 2016 年 12 月 9 日生效，基金管理人于 2016 年 12 月 5 日运用自有资金作为发起资金认购本基金，且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于 3 年。

根据本基金基金合同的规定：基金合同生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。截止 2017 年 6 月 30 日，本基金基金合同生效未满三年，基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。



## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华宝兴业基金管理有限公司本报告期内本基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，华宝兴业基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，华宝兴业基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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	20,124,312.16	581,120.82
结算备付金		1,532,034.95	-
存出保证金		97,694.64	-
交易性金融资产	6.4.7.2	333,909,911.54	5,845,200.00
其中：股票投资		333,909,911.54	5,845,200.00
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	-	2,500,000.00
应收证券清算款		-	1,411,760.13
应收利息	6.4.7.5	4,372.94	653.89
应收股利		-	-
应收申购款		185,224.44	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		355,853,550.67	10,338,734.84
<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		1,536,253.89	396,908.27
应付赎回款		1,665.99	-
应付管理人报酬		288,976.24	5,981.46
应付托管费		43,346.44	897.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	556,800.49	2,901.01

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	22,259.45	2,500.00
负债合计		2,449,302.50	409,187.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	306,687,670.20	10,000,450.05
未分配利润	6.4.7.10	46,716,577.97	-70,903.18
所有者权益合计		353,404,248.17	9,929,546.87
负债和所有者权益总计		355,853,550.67	10,338,734.84

注：

报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1523 元，基金份额总额 306,687,670.20 份

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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
一、收入		37,417,970.43
1.利息收入		46,589.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,043.00
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		546.45
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,283,512.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,741,471.94
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	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	3,542,040.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	32,002,866.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	85,002.03
<b>减：二、费用</b>		1,718,007.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	801,434.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	120,215.17
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	760,445.73
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	35,911.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		35,699,963.19
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		35,699,963.19

注：本基金成立于 2016 年 12 月 9 日，因此无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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）	10,000,450.05	-70,903.18	9,929,546.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,699,963.19	35,699,963.19
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）	296,687,220.15	11,087,517.96	307,774,738.11
其中：1.基金申购款	316,961,543.40	12,998,418.60	329,959,962.00
2.基金赎回款	-20,274,323.25	-1,910,900.64	-22,185,223.89
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	306,687,670.20	46,716,577.97	353,404,248.17

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金成立于 2016 年 12 月 09 日，因此无上年度可比期间数据

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          黄小慧          </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

华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016] 2663 号《关于准予华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 10,000,000.00 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(16)第 0862 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,000,450.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 450.05 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日

终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*95%+1.5%(指年收益率，评价时按期间折算)。

#### 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》、《华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表中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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。



#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部

分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

## 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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，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	20,124,312.16
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	20,124,312.16

#### 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	301,978,511.61	333,909,911.54	31,931,399.93
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	301,978,511.61	333,909,911.54	31,931,399.93

### 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	3,639.64
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	689.40
应收债券利息	-
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	43.90
合计	4,372.94

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 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	556,800.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	556,800.49

**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	3.49
预提费用	11,056.11
指数使用费	11,199.85
合计	22,259.45

**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	10,000,450.05	10,000,450.05
本期申购	316,961,543.40	316,961,543.40
本期赎回(以“-”号填列)	-20,274,323.25	-20,274,323.25
本期末	306,687,670.20	306,687,670.20

**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	563.24	-71,466.42	-70,903.18
本期利润	3,697,096.84	32,002,866.35	35,699,963.19
本期基金份额交易产生的变动数	-375,637.95	11,463,155.91	11,087,517.96
其中：基金申购款	-312,436.96	13,310,855.56	12,998,418.60
基金赎回款	-63,200.99	-1,847,699.65	-1,910,900.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,322,022.13	43,394,555.84	46,716,577.97

**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	40,094.45
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	5,595.04
其他	353.51
合计	46,043.00

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 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	153,350,122.47
减：卖出股票成本总额	151,608,650.53
买卖股票差价收入	1,741,471.94

### 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。

### 6.4.7.14 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。

### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.17 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	3,542,040.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,542,040.66

#### 6.4.7.18 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	32,002,866.35
——股票投资	32,002,866.35
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	32,002,866.35

#### 6.4.7.19 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	82,804.41
转换费收入	2,197.62
合计	85,002.03

#### 6.4.7.20 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	760,445.73
银行间市场交易费用	-
合计	760,445.73



### 6.4.7.21 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	4,959.40
信息披露费	6,096.71
指数使用费	21,199.85
其他费用	400.00
银行费用	3,255.94
合计	35,911.90

### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset	基金管理人的股东

Management S.A.)	
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

本基金本报告期内未发生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
当期发生的基金应支付的管理费	801,434.44
其中：支付销售机构的客户维护费	2,913.70

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% ÷ 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
当期发生的基金应支付的托管费	120,215.17

注：支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 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
期初持有的基金份额	10,000,450.05
期间申购/买入总份额	478,795.12
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	10,479,245.17
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.42%

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**

本报告期末及上年度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	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	20,124,312.16	40,094.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**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

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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

**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
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项停牌	23.48	-	-	231,500	4,211,192.02	5,435,620.00	-
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项停牌	7.47	2017年8月21日	8.22	193,300	1,447,705.00	1,443,951.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项停牌	14.59	-	-	3,600	58,092.00	52,524.00	-

注：本基金截至 2017 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**

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

本基金为指数增强型基金，在实现对标的指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。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，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范

围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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。

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 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主要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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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，其余金融资产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 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担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、结算备付金及存出保证金等。

##### 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 个月以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	--------	-------	-------	-----	----



资产					
银行存款	20,124,312.16	-	-	-	20,124,312.16
结算备付金	1,532,034.95	-	-	-	1,532,034.95
存出保证金	97,694.64	-	-	-	97,694.64
交易性金融资产	-	-	-	-333,909,911.54	333,909,911.54
应收利息	-	-	-	4,372.94	4,372.94
应收申购款	-	-	-	185,224.44	185,224.44
资产总计	21,754,041.75	-	-	-334,099,508.92	355,853,550.67
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,536,253.89	1,536,253.89
应付赎回款	-	-	-	1,665.99	1,665.99
应付管理人报酬	-	-	-	288,976.24	288,976.24
应付托管费	-	-	-	43,346.44	43,346.44
应付交易费用	-	-	-	556,800.49	556,800.49
其他负债	-	-	-	22,259.45	22,259.45
负债总计	-	-	-	2,449,302.50	2,449,302.50
利率敏感度缺口	21,754,041.75	-	-	-331,650,206.42	353,404,248.17
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	581,120.82	-	-	-	581,120.82
交易性金融资产	-	-	-	5,845,200.00	5,845,200.00
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	2,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,411,760.13	1,411,760.13
应收利息	-	-	-	653.89	653.89
资产总计	3,081,120.82	-	-	7,257,614.02	10,338,734.84
负债					
应付证券清算款	-	-	-	396,908.27	396,908.27
应付管理人报酬	-	-	-	5,981.46	5,981.46
应付托管费	-	-	-	897.23	897.23
应付交易费用	-	-	-	2,901.01	2,901.01
其他负债	-	-	-	2,500.00	2,500.00
负债总计	-	-	-	409,187.97	409,187.97
利率敏感度缺口	3,081,120.82	-	-	6,848,426.05	9,929,546.87

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，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。

本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	333,909,911.54	94.48	5,845,200.00	58.87
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	333,909,911.54	94.48	5,845,200.00	58.87
----	----------------	-------	--------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，无足够的经验数据进行其他价格风险敏感性分析。

#### 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) 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。

##### (b) 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 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 326,854,133.44 元，属于第二层次的余额为人民币 7,055,778.10 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (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	333,909,911.54	93.83
	其中：股票	333,909,911.54	93.83
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,656,347.11	6.09
7	其他各项资产	287,292.02	0.08
8	合计	355,853,550.67	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	18,490,791.00	5.23
C	制造业	112,826,637.50	31.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,310,380.00	1.50
E	建筑业	15,424,495.00	4.36
F	批发和零售业	22,320,569.00	6.32
G	交通运输、仓储和邮政业	5,095,590.00	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,119,023.00	1.73
J	金融业	113,916,383.42	32.23
K	房地产业	19,299,725.60	5.46

L	租赁和商务服务业	1,494,944.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,063,475.00	1.43
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	6,827,351.02	1.93
S	综合	1,342,131.00	0.38
	合计	333,531,495.54	94.38

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	370,776.38	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	378,416.00	0.11

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

### 7.3.1 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	601318	中国平安	333,500	16,544,935.00	4.68
2	600036	招商银行	435,300	10,408,023.00	2.95
3	601166	兴业银行	579,200	9,765,312.00	2.76
4	000001	平安银行	1,013,700	9,518,643.00	2.69
5	600015	华夏银行	1,024,640	9,447,180.80	2.67
6	600000	浦发银行	740,540	9,367,831.00	2.65
7	601939	建设银行	1,494,000	9,188,100.00	2.60
8	600028	中国石化	1,531,800	9,083,574.00	2.57
9	002236	大华股份	379,100	8,647,271.00	2.45
10	600030	中信证券	498,900	8,491,278.00	2.40
11	000776	广发证券	487,600	8,411,100.00	2.38
12	600999	招商证券	484,871	8,349,478.62	2.36
13	000166	申万宏源	1,471,400	8,239,840.00	2.33
14	000651	格力电器	194,700	8,015,799.00	2.27
15	601668	中国建筑	805,400	7,796,272.00	2.21
16	601186	中国铁建	634,100	7,628,223.00	2.16
17	600690	青岛海尔	499,900	7,523,495.00	2.13
18	000063	中兴通讯	306,000	7,264,440.00	2.06
19	600373	中文传媒	290,402	6,827,351.02	1.93
20	002456	欧菲光	347,050	6,305,898.50	1.78
21	000540	中天金融	907,100	6,304,345.00	1.78
22	600887	伊利股份	291,000	6,282,690.00	1.78
23	600048	保利地产	621,100	6,192,367.00	1.75
24	601601	中国太保	182,600	6,184,662.00	1.75
25	000858	五粮液	111,100	6,183,826.00	1.75
26	000895	双汇发展	259,700	6,167,875.00	1.75

27	601607	上海医药	210,400	6,076,352.00	1.72
28	002241	歌尔股份	307,100	5,920,888.00	1.68
29	600104	上汽集团	187,200	5,812,560.00	1.64
30	600340	华夏幸福	172,400	5,789,192.00	1.64
31	000625	长安汽车	396,200	5,713,204.00	1.62
32	000423	东阿阿胶	79,400	5,708,066.00	1.62
33	000963	华东医药	113,700	5,650,890.00	1.60
34	600153	建发股份	436,700	5,646,531.00	1.60
35	601088	中国神华	231,500	5,435,620.00	1.54
36	600886	国投电力	672,200	5,310,380.00	1.50
37	600029	南方航空	585,700	5,095,590.00	1.44
38	300070	碧水源	271,500	5,063,475.00	1.43
39	601933	永辉超市	698,700	4,946,796.00	1.40
40	002202	金风科技	310,100	4,797,247.00	1.36
41	002174	游族网络	147,200	4,675,072.00	1.32
42	002466	天齐锂业	78,100	4,244,735.00	1.20
43	601899	紫金矿业	1,157,900	3,971,597.00	1.12
44	002152	广电运通	437,800	3,638,118.00	1.03
45	600031	三一重工	442,800	3,599,964.00	1.02
46	000709	河钢股份	839,900	3,519,181.00	1.00
47	601766	中国中车	323,000	3,268,760.00	0.92
48	600372	中航电子	180,600	3,137,022.00	0.89
49	600893	航发动力	101,900	2,781,870.00	0.79
50	600585	海螺水泥	99,400	2,259,362.00	0.64
51	000876	新希望	241,100	1,981,842.00	0.56
52	601888	中国国旅	49,600	1,494,944.00	0.42
53	600050	中国联通	193,300	1,443,951.00	0.41
54	000009	中国宝安	165,900	1,342,131.00	0.38
55	600177	雅戈尔	100,180	1,013,821.60	0.29
56	600485	信威集团	3,600	52,524.00	0.01

### 7.3.2 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

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	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01



2	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
3	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
4	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
5	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
6	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
7	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
8	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
9	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
10	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
11	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
12	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
13	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
14	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
15	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
16	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
17	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
18	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	000001	平安银行	14,781,085.03	148.86
2	601939	建设银行	13,809,738.74	139.08
3	601318	中国平安	13,377,724.42	134.73
4	600000	浦发银行	13,307,563.32	134.02
5	000625	长安汽车	11,710,358.77	117.93
6	600015	华夏银行	10,527,348.07	106.02
7	601166	兴业银行	10,260,265.00	103.33
8	601398	工商银行	9,718,084.91	97.87
9	600036	招商银行	9,642,420.01	97.11
10	600028	中国石化	9,209,513.00	92.75
11	600016	民生银行	9,020,371.00	90.84

12	600999	招商证券	8,916,023.29	89.79
13	000776	广发证券	8,851,666.47	89.14
14	601186	中国铁建	8,699,819.07	87.62
15	000686	东北证券	8,698,212.78	87.60
16	601211	国泰君安	8,641,911.07	87.03
17	002236	大华股份	8,568,403.40	86.29
18	000166	申万宏源	8,447,803.92	85.08
19	600030	中信证券	8,406,213.31	84.66
20	601668	中国建筑	7,844,895.00	79.01

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 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	601398	工商银行	10,310,835.74	103.84
2	600016	民生银行	8,785,587.00	88.48
3	601211	国泰君安	8,644,417.08	87.06
4	000686	东北证券	7,669,499.25	77.24
5	300182	捷成股份	6,429,856.28	64.75
6	300058	蓝色光标	5,787,823.84	58.29
7	600383	金地集团	5,692,036.68	57.32
8	600795	国电电力	5,666,652.00	57.07
9	000001	平安银行	5,624,020.00	56.64
10	000625	长安汽车	5,407,866.96	54.46
11	600000	浦发银行	4,809,836.38	48.44
12	601939	建设银行	4,735,674.77	47.69
13	600068	葛洲坝	4,393,912.55	44.25
14	600827	百联股份	4,047,839.39	40.77
15	002146	荣盛发展	3,854,612.40	38.82
16	600582	天地科技	3,677,561.08	37.04
17	600038	中直股份	3,479,937.53	35.05
18	000002	万科 A	2,574,446.50	25.93
19	601336	新华保险	2,493,341.20	25.11
20	002304	洋河股份	2,308,203.24	23.25

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	447,670,495.72
卖出股票收入（成交）总额	153,350,122.47

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

华宝沪深 300 增强基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的平安银行(000001)于 2016 年 12 月 2 日收到中国银行间市场交易商协会的通报批评和整改通知。因其作为主承销商,对青岛海湾集团有限公司未能按照相关自律规则的规定及时披露公司重大资产无偿划转相关事项,未能及时召开持有人会议,给予平安银行通报批评处分,责令平安银行立即纠正违规行为,并针对本次事件中暴露出的问题进行整改。

华宝沪深 300 增强基金截至 2017 年 6 月 30 日前十名证券中的中信证券(600030)于 2016 年 8 月 23 日收到全国中小企业股份转让系统《关于对中信证券股份有限公司采取出具责令改正自律监管措施的决定》。在投资者适当性管理过程中,未依据委托代理协议签署日前一交易日日终的投资者名下证券类资产市值判断适当性,而是错误根据投资者临拒办理业务权限开通手续时点的实时资产市值,为 506 户不符合要求的投资者账户开通全国股转系统合格投资者权限,违反了《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理细则(试行)》第五条关于自然人投资者证券类资产市值计算时点要求的规定。决定对公司采取责令改正的自律监管措施。

中信证券(600030)于 2017 年 5 月 25 日收到中国证监会处罚决定。在客户开户未满半年的情况下为其开立信用账户,提供融资融券服务,违反了《证券公司融资融券业务管理办法》。责令中信证券改正,给予警告,没收违法所得人民币 61,655,849.78 元,并处人民币 308,279,248.90 元罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	97,694.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,372.94
5	应收申购款	185,224.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	287,292.02

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002879	长缆科技	23,660.26	0.01	新股锁定

## § 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
344	891,533.93	300,530,012.61	97.99%	6,157,657.59	2.01%

### 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	1,198,078.25	0.3907%

### 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

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,479,245.17	3.42	10,000,450.05	3.26	不少于三年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	496,078.16	0.16	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	702,000.09	0.23	-	-	-
合计	11,677,323.42	3.81	10,000,450.05	3.26	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用自有资金于 2016 年 12 月 6 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 9 日）基金份额总额	10,000,450.05
本报告期期初基金份额总额	10,000,450.05
本报告期基金总申购份额	316,961,543.40
减:本报告期基金总赎回份额	20,274,323.25
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	306,687,670.20

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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、基金资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（2016 年 12 月 09 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	
海通证券	2	599,708,042.23	100.00%	553,899.48	100.00%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

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

2. 本报告其租用的证券公司交易单元均为新增。

### 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	
	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
海通证券	-	-	2,400,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

## 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	华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 01 月 13 日
2	华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式型证券投资基金参加部分代销机构定期定额投资及电子渠道申购费率优惠活动的提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 01 月 18 日
3	关于调整沪深 300 增强基金网上直销申购费率优惠的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 01 月 20 日
4	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定投金额下限的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 03 月 04 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	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 03 月 24 日
6	华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 05 月 10 日
7	关于华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 05 月 15 日
8	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	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 05 月 15 日

	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		
9	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	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 05 月 31 日
10	华宝兴业公司关于旗下部分开放式基金增加中国银行为代销机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参与费率优惠活动的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 06 月 05 日
11	关于华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金增加交通银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2017 年 06 月 14 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	20170103~20170309	10,000,450.05	478,795.12	0.00	10,479,245.17	3.42
	2	20170221~20170307	0.00	4,764,582.53	0.00	4,764,582.53	1.55
	3	20170308~20170630	0.00	125,420,909.60	0.00	125,420,909.60	40.90
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；  
华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同；  
华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；  
华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议；  
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