

# 上证 180 价值交易型开放式指数证券投资 基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 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>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 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      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 34        |
| 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       | 35        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 37        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 38        |
| 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      | 38        |
| 7.7 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   | 38        |
| 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   | 38        |
| 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      | 38        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 39        |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....         | 39        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                     | 39        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                | <b>40</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 40        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                  | 41        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 41        |
| 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 ..... | 41        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                  | <b>42</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 42        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....  | 42        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 42        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 42        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 42        |
| 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 .....     | 42        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 44        |
| <b>§11 备查文件目录.....</b>                  | <b>44</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                       | 44        |
| 11.2 存放地点 .....                         | 44        |
| 11.3 查阅方式 .....                         | 44        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 上证 180 价值 ETF           |
| 场内简称         | 价值 ETF                  |
| 基金主代码        | 510030                  |
| 交易代码         | 510030                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2010 年 4 月 23 日         |
| 基金管理人        | 华宝兴业基金管理有限公司            |
| 基金托管人        | 中国工商银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额   | 122,528,726.00 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         | 2010-05-28              |

### 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的最小化。                                                                                                                                                                                                              |
| 投资策略   | 本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 |
| 业绩比较基准 | 上证 180 价值指数                                                                                                                                                                                                                             |
| 风险收益特征 | 本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。                                                                                                                                    |

### 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                  | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 刘月华                           | 蒋松云                 |
|         | 联系电话 | 021-38505888                  | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com               | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-700-5588、<br>021-38924558 | 95588               |
| 传真      |      | 021-38505777                  | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼     | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址    |      | 上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼     | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码    |      | 200120                        | 100140              |
| 法定代表人   |      | 郑安国                           | 姜建清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                  |
|----------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》           |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦36楼 |
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所     | 北京市东长安街1号东方广场安永大楼16层      |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 162,599,342.79              |
| 本期利润          | 97,488,458.70               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.6374                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 15.11%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 19.38%                      |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2015 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|-------------------------|
| 期末可供分配利润      | 213,528,798.68          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.7427                  |
| 期末基金资产净值      | 581,100,111.38          |
| 期末基金份额净值      | 4.743                   |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2015 年 6 月 30 日 ) |
| 基金份额累计净值增长率   | 62.38%                  |

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

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

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

4、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）。

## 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           | -0.36%   | 3.32%       | -0.79%     | 3.36%         | 0.43%  | -0.04% |
| 过去三个月           | 13.66%   | 2.56%       | 12.77%     | 2.61%         | 0.89%  | -0.05% |
| 过去六个月           | 19.38%   | 2.42%       | 18.35%     | 2.45%         | 1.03%  | -0.03% |
| 过去一年            | 112.40%  | 2.07%       | 105.34%    | 2.09%         | 7.06%  | -0.02% |
| 过去三年            | 109.68%  | 1.63%       | 92.41%     | 1.63%         | 17.27% | 0.00%  |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 62.38%   | 1.54%       | 47.18%     | 1.53%         | 15.20% | 0.01%  |

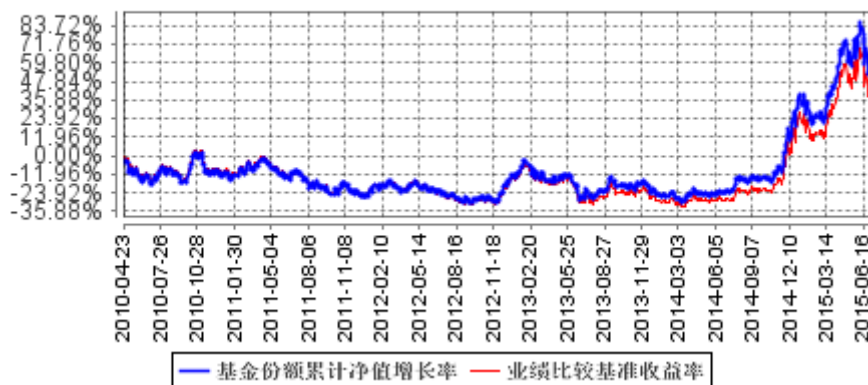
注：1、本基金业绩比较基准为：上证 180 价值指数。

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

(2010 年 4 月 23 日至 2015 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：基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，截至 2010 年 5 月 28 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（2015 年 6 月 30 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业活期货币市场基金、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、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证 1000 分级基金和华宝兴业万物互联基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 110,943,781,389.61 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、华宝兴业中证100指数基金经理、华宝兴业上证180价值ETF联接基金基金经理、华宝兴业量化对冲混合基金经理、华宝事件驱动混合基金经理 | 2010年4月23日      | -    | 13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、金融工程部副总经理。2009年9月起任华宝兴业中证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月起兼任华宝兴业上证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。 |
| 张奇  | 本基金基金经理助理                                                                                  | 2015年4月7日       | -    | 5年     | 本科。曾先后在毕博管理咨询有限                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

|  |                          |  |  |  |                                                                                                                                               |
|--|--------------------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 理、上证 180 价值 ETF 联接基金经理助理 |  |  |  | 公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任华宝兴业上证 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《上证 180 价值交易型开放式指数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。

由于成份股调整，上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金在短期内出现过持有不属于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股以及投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产占基金资产净值比低于 95%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

资产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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2015 年上半年，国内各项经济指标显示中国经济态势依然比较疲弱，经济仍然处于筑底的过程中，能否企稳回升有待进一步观察。从总理在国务院常务会议上的表态以及后续多次降准降息等一系列宽松政策的出台，看出政府稳定经济状况的意愿和决心。上半年 A 股市场波动较大，一季度市场在“互联网+”、国企改革、一带一路等概念股的带领下屡创新高，市场情绪高涨，四、五月份更是出现快速大幅上涨，风险逐渐积聚，到了 6 月中下旬，市场出现了一轮快速剧烈下跌。在本报告期内，沪深 300 和上证 180 价值指数分别上涨 26.58%和 18.35%，而中小板指和创业板指分别上涨为 69.06%和 94.23%。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末，本基金份额净值为 4.743 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.38%，同期业绩比较基准收益率为 18.35%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度的绝对值为 0.07%，年化跟踪误差为 1.55%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望下半年，在宽松的货币政策和积极的财政政策下，实体经济有望逐步企稳，经济结构有

望进一步优化。但需要注意的是，传统经济的去产能、去债务压力仍在，部分行业的盈利水平仍在恶化，资本市场杠杆水平的提高也增加了市场波动的风险，六月中下旬以来的大幅调整就是警示。对于市场，在无风险利率下行、经济转型和深化改革的背景下，我们对 A 股中长期保持积极乐观的态度。本轮调整使得本轮牛市持续积聚风险得到充分释放，尤其是蓝筹股的估值也处于历史底部区域，以上证 180 价值指数为代表的大盘价值股指数在下半年的表现值得关注。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对上证 180 价值指数的有效跟踪。

#### **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

本报告期内，本基金托管人在对上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华宝兴业基金管理有限公司在上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对华宝兴业基金管理有限公司编制和披露的华宝兴业基金管理有限公司在上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 银行存款     | 6.4.7.1 | 10,164,192.55          | 7,141,416.81             |
| 结算备付金    |         | 320,244.43             | 109,659.28               |
| 存出保证金    |         | 49,731.17              | 16,828.94                |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 561,979,786.28         | 1,353,341,719.29         |
| 其中：股票投资  |         | 561,979,786.28         | 1,353,341,719.29         |
| 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         |            | 11,038,989.54             | 1,767,137.55                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,758.87                  | 2,778.52                    |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | 218,281.51                  |
| 资产总计            |            | 583,554,702.84            | 1,362,597,821.90            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2014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         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 175,117.87                | 458,166.77                  |
| 应付托管费           |            | 35,023.55                 | 91,633.33                   |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 984,044.75                | 631,784.51                  |
| 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    | 1,260,405.29              | 645,314.07                  |
| 负债合计            |            | 2,454,591.46              | 1,826,898.68                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 357,929,662.36            | 1,000,591,414.30            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 223,170,449.02            | 360,179,508.92              |
| 所有者权益合计         |            | 581,100,111.38            | 1,360,770,923.22            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 583,554,702.84            | 1,362,597,821.90            |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.743 元，基金份额总额 122,528,726.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014<br>年 6 月 30 日 |
|-----|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
|-----|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|

|                       |            |                |                |
|-----------------------|------------|----------------|----------------|
| 一、收入                  |            | 100,248,571.78 | -20,857,490.76 |
| 1.利息收入                |            | 35,445.28      | 11,144.44      |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 35,445.28      | 11,144.44      |
| 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            |            | -              | -              |
| 其他利息收入                |            | -              | -              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 163,357,184.69 | -19,424,729.40 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 158,502,789.87 | -30,150,551.64 |
| 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   | -              | -              |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 4,854,394.82   | 10,725,822.24  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -65,110,884.09 | -1,427,428.75  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 1,966,825.90   | -16,477.05     |
| 减：二、费用                |            | 2,760,113.08   | 2,869,985.99   |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 1,605,679.36   | 2,012,114.91   |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 321,135.84     | 402,423.00     |
| 3. 销售服务费              |            | -              | -              |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.19   | 544,148.03     | 150,891.99     |
| 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   | 289,149.85     | 304,556.09     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |            | 97,488,458.70  | -23,727,476.75 |
| 减：所得税费用               |            | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |            | 97,488,458.70  | -23,727,476.75 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|                                        | 实收基金                            | 未分配利润             | 所有者权益合计            |
|----------------------------------------|---------------------------------|-------------------|--------------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,000,591,414.30                | 360,179,508.92    | 1,360,770,923.22   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 97,488,458.70     | 97,488,458.70      |
| 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）      | -642,661,751.94                 | -234,497,518.60   | -877,159,270.54    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 6,495,265,478.21                | 3,097,538,901.21  | 9,592,804,379.42   |
| 2. 基金赎回款                               | -7,137,927,230.15               | -3,332,036,419.81 | -10,469,963,649.96 |
| 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）                        | 357,929,662.36                  | 223,170,449.02    | 581,100,111.38     |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                   |                    |
|                                        | 实收基金                            | 未分配利润             | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,133,505,549.22                | -245,674,977.26   | 887,830,571.96     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | -23,727,476.75    | -23,727,476.75     |
| 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）      | -94,938,667.92                  | 24,616,225.18     | -70,322,442.74     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 493,681,072.87                  | -121,107,654.66   | 372,573,418.21     |
| 2. 基金赎回款                               | -588,619,740.79                 | 145,723,879.84    | -442,895,860.95    |
| 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）                        | 1,038,566,881.30                | -244,786,228.83   | 793,780,652.47     |



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>黄小蕙</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

华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2010]227 号《关于核准华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人华宝兴业基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责向社会公开发发行募集。首次设立募集金额总额为人民币 2,109,182,935.00 元（含募集股票市值），业经安永华明(2010)验字第 60737318\_B04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,109,182,935 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括上证 180 价值指数的成份股及其备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

本基金业绩比较基准为标的指数，即上证 180 价值指数。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年半年度的经营成果和净值变动情况。

### 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

本基金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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

### 6.4.6 税项

#### 1, 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2, 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3, 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|                |               |
|----------------|---------------|
| 活期存款           | 10,164,192.55 |
| 定期存款           | —             |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | —             |
| 其他存款           | —             |
| 合计：            | 10,164,192.55 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |                |              |
|---------------|------------------------|----------------|--------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            | 554,072,838.18         | 561,979,786.28 | 7,906,948.10 |
| 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            | 554,072,838.18         | 561,979,786.28 | 7,906,948.10 |

#### 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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,592.37               |
| 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  | 144.10   |
| 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         | 22.40    |
| 合计         | 1,758.87 |

#### 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<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 984,044.75        |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 984,044.75        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 343,479.70        |
| 应付指数使用费     | 50,000.00         |
| 应付替代款       | 6,420.29          |
| 可退替代款       | 860,505.30        |
| 合计          | 1,260,405.29      |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                  |
|------|----------------------------|------------------|
|      | 基金份额（份）                    | 账面金额             |
| 上年度末 | 342,528,726.00             | 1,000,591,414.30 |
| 本期申购 | 2,223,500,000.00           | 6,495,265,478.21 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,443,500,000.00 | -7,137,927,230.15 |
| 本期末           | 122,528,726.00    | 357,929,662.36    |

#### 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           | 260,728,830.49    | 99,450,678.43   | 360,179,508.92    |
| 本期利润           | 162,599,342.79    | -65,110,884.09  | 97,488,458.70     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -209,799,374.60   | -24,698,144.00  | -234,497,518.60   |
| 其中：基金申购款       | 2,960,344,293.34  | 137,194,607.87  | 3,097,538,901.21  |
| 基金赎回款          | -3,170,143,667.94 | -161,892,751.87 | -3,332,036,419.81 |
| 本期已分配利润        | -                 | -               | -                 |
| 本期末            | 213,528,798.68    | 9,641,650.34    | 223,170,449.02    |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 28,302.89                  |
| 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 | 6,832.22                   |
| 其他        | 310.17                     |
| 合计        | 35,445.28                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 14,523,714.17              |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 143,979,075.70             |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                          |
| 合计               | 158,502,789.87             |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 166,850,658.46                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 152,326,944.29                        |
| 买卖股票差价收入   | 14,523,714.17                         |

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 10,469,963,649.96                     |
| 减：现金支付赎回款总额 | 200,808,949.96                        |
| 减：赎回股票成本总额  | 10,125,175,624.30                     |
| 赎回差价收入      | 143,979,075.70                        |

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,854,394.82                          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 4,854,394.82                          |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -65,110,884.09                        |
| ——股票投资     | -65,110,884.09                        |
| ——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         | -65,110,884.09                        |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                     |
| 替代损益    | 1,966,825.90                          |
| 合计      | 1,966,825.90                          |

注：替代损益指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 544,148.03                            |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 544,148.03                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 34,712.18                             |
| 信息披露费 | 119,014.74                            |



|        |            |
|--------|------------|
| 上市年费   | 29,752.78  |
| 指数使用费  | 105,376.15 |
| 银行汇划费用 | 294.00     |
| 合计     | 289,149.85 |

#### 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。

##### 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     |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）                                    | 基金托管人            |
| 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         |
| 宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）                                        | 华宝信托的最终控制人       |
| 华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）                                      | 受宝钢集团控制的公司       |
| 华宝投资有限公司（“华宝投资”）                                        | 受宝钢集团控制的公司       |
| 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（“华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接”） | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,605,679.36                    | 2,012,114.91                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                               |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 321,135.84                            | 402,423.00                                 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本期及上年度可比期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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

份额单位：份

| 关联方名称                         | 本期末<br>2015年6月30日 |                              | 上年度末<br>2014年12月31日 |                              |
|-------------------------------|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
|                               | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 |
| 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 | 62,933,303.00     | 51.36%                       | 115,807,603.00      | 33.81%                       |

#### 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<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |          |
|--------|----------------------------|-----------|---------------------------------|----------|
|        | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 中国工商银行 | 10,164,192.55              | 28,302.88 | 4,708,224.15                    | 9,981.26 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 | 复牌日期 | 复牌开盘单 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|-------|------|-------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|-------|------|-------|-------|--------|--------|----|

|        |      |            |        | 价     |   | 价 |         |               |               |   |
|--------|------|------------|--------|-------|---|---|---------|---------------|---------------|---|
| 600886 | 国投电力 | 2015年6月24日 | 重大事项停牌 | 14.87 | - | - | 124,573 | 1,695,902.32  | 1,852,400.51  | - |
| 600900 | 长江电力 | 2015年6月13日 | 重大事项停牌 | 14.35 | - | - | 786,801 | 11,001,484.69 | 11,290,594.35 | - |
| 600153 | 建发股份 | 2015年6月29日 | 重大事项停牌 | 17.51 | - | - | 30,000  | 587,784.92    | 525,300.00    | - |

### 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ETF基金，采用完全复制策略，跟踪上证180价值指数。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工商银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与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,违约风险发生的可能性很小。

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 2015 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券。

#### **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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除 6.4.12 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。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有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<br>2015 年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年<br>以上 | 不计息 | 合计            |
|------------------------|---------------|-------|-----------|-----|---------------|
| 资产                     |               |       |           |     |               |
| 银行存款                   | 10,164,192.55 | -     | -         | -   | 10,164,192.55 |
| 结算备付金                  | 320,244.43    | -     | -         | -   | 320,244.43    |
| 存出保证金                  | 49,731.17     | -     | -         | -   | 49,731.17     |

|                     |               |      |      |                  |                  |
|---------------------|---------------|------|------|------------------|------------------|
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 561,979,786.28   | 561,979,786.28   |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -    | 11,038,989.54    | 11,038,989.54    |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 1,758.87         | 1,758.87         |
| 其他资产                | -             | -    | -    | -                | -                |
| 资产总计                | 10,534,168.15 | -    | -    | 573,020,534.69   | 583,554,702.84   |
| 负债                  |               |      |      |                  |                  |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 175,117.87       | 175,117.87       |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 35,023.55        | 35,023.55        |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 984,044.75       | 984,044.75       |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 1,260,405.29     | 1,260,405.29     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 2,454,591.46     | 2,454,591.46     |
| 利率敏感度缺口             | 10,534,168.15 | -    | -    | 570,565,943.23   | 581,100,111.38   |
| 上年度末<br>2014年12月31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                  |               |      |      |                  |                  |
| 银行存款                | 7,141,416.81  | -    | -    | -                | 7,141,416.81     |
| 结算备付金               | 109,659.28    | -    | -    | -                | 109,659.28       |
| 存出保证金               | 16,828.94     | -    | -    | -                | 16,828.94        |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 1,353,341,719.29 | 1,353,341,719.29 |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -    | 1,767,137.55     | 1,767,137.55     |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 2,778.52         | 2,778.52         |
| 其他资产                | -             | -    | -    | 218,281.51       | 218,281.51       |
| 资产总计                | 7,267,905.03  | -    | -    | 1,355,329,916.87 | 1,362,597,821.90 |
| 负债                  |               |      |      |                  |                  |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 458,166.77       | 458,166.77       |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 91,633.33        | 91,633.33        |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 631,784.51       | 631,784.51       |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 645,314.07       | 645,314.07       |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 1,826,898.68     | 1,826,898.68     |
| 利率敏感度缺口             | 7,267,905.03  | -    | -    | 1,353,503,018.19 | 1,360,770,923.22 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金未持有交易性债券（2014年12月31日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014年12月31日：同）。

#### 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。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为 180 价值指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 95%。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<br>2015 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 561,979,786.28         | 96.71         | 1,353,341,719.29         | 99.45         |
| 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            | 561,979,786.28         | 96.71         | 1,353,341,719.29         | 99.45         |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                                                                                                                           |                             |                  |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|------------------|
| 假设 | 本基金管理人运用系统风险系数 Beta 历史回归的方法对本基金的市场价格价格风险进行分析。该方法是假设本基金的净值变动程度与跟踪基准的收益率变动的敏感性(beta)保持不变，我们通过假设跟踪基准收益率(市场价格)的变动来测量本基金净值的变动。 |                             |                  |
| 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（2015 年 6 月              | 上年度末（2014 年 12 月 |



|  |         |                |                |
|--|---------|----------------|----------------|
|  |         | 30 日 )         | 31 日 )         |
|  | 比较基准+5% | 28,756,604.85  | 68,034,763.22  |
|  | 比较基准-5% | -28,756,604.85 | -68,034,763.22 |

#### 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 2015 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 548,311,491.42 元，属于第二层次的余额为 13,668,294.86 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 1,353,341,719.29 元，无第二层级的余额，无第三层级的余额)。于 2015 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负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

##### (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。

## § 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              | 561,979,786.28 | 96.30         |
|    | 其中：股票             | 561,979,786.28 | 96.30         |
| 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      | 10,484,436.98  | 1.80          |
| 7  | 其他各项资产            | 11,090,479.58  | 1.90          |
| 8  | 合计                | 583,554,702.84 | 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              | 29,193,073.17  | 5.02          |
| C  | 制造业              | 42,612,084.26  | 7.33          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 39,603,571.15  | 6.82          |
| E  | 建筑业              | 52,441,693.13  | 9.02          |
| F  | 批发和零售业           | 2,621,699.40   | 0.45          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 28,463,901.72  | 4.90          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 8,240,847.79   | 1.42          |
| J  | 金融业              | 341,755,026.37 | 58.81         |
| K  | 房地产业             | 17,044,592.82  | 2.93          |
| L  | 租赁和商务服务业         | —              | —             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —              | —             |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 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            | 561,976,489.81 | 96.71 |

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

## 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 | 784,952   | 64,318,966.88 | 11.07        |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 2,187,418 | 40,948,464.96 | 7.05         |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 3,932,443 | 39,088,483.42 | 6.73         |
| 4  | 600000 | 浦发银行 | 1,990,900 | 33,765,664.00 | 5.81         |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 3,666,900 | 30,215,256.00 | 5.20         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 1,513,652 | 26,110,497.00 | 4.49         |
| 7  | 601668 | 中国建筑 | 1,993,470 | 16,565,735.70 | 2.85         |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 3,084,354 | 15,082,491.06 | 2.60         |
| 9  | 601169 | 北京银行 | 1,121,000 | 14,931,720.00 | 2.57         |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 2,647,751 | 14,191,945.36 | 2.44         |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 3,521,024 | 13,062,999.04 | 2.25         |
| 12 | 601601 | 中国太保 | 416,265   | 12,562,877.70 | 2.16         |
| 13 | 601390 | 中国中铁 | 905,309   | 12,393,680.21 | 2.13         |
| 14 | 600900 | 长江电力 | 786,801   | 11,290,594.35 | 1.94         |
| 15 | 601006 | 大秦铁路 | 791,807   | 11,116,970.28 | 1.91         |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 436,300   | 10,091,619.00 | 1.74         |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 439,035   | 9,922,191.00  | 1.71         |
| 18 | 600028 | 中国石化 | 1,396,100 | 9,856,466.00  | 1.70         |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 854,474   | 9,758,093.08  | 1.68         |
| 20 | 600795 | 国电电力 | 1,308,577 | 9,120,781.69  | 1.57         |
| 21 | 601939 | 建设银行 | 1,271,696 | 9,067,192.48  | 1.56         |
| 22 | 600015 | 华夏银行 | 589,094   | 8,960,119.74  | 1.54         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 23 | 600050 | 中国联通 | 1,124,263 | 8,240,847.79 | 1.42 |
| 24 | 600011 | 华能国际 | 547,132   | 7,676,261.96 | 1.32 |
| 25 | 601857 | 中国石油 | 649,449   | 7,358,257.17 | 1.27 |
| 26 | 600029 | 南方航空 | 465,200   | 6,764,008.00 | 1.16 |
| 27 | 601899 | 紫金矿业 | 1,262,000 | 6,461,440.00 | 1.11 |
| 28 | 601186 | 中国铁建 | 410,668   | 6,418,740.84 | 1.10 |
| 29 | 601669 | 中国电建 | 552,263   | 6,262,662.42 | 1.08 |
| 30 | 601009 | 南京银行 | 268,200   | 6,114,960.00 | 1.05 |
| 31 | 600690 | 青岛海尔 | 199,746   | 6,058,296.18 | 1.04 |
| 32 | 600585 | 海螺水泥 | 265,715   | 5,699,586.75 | 0.98 |
| 33 | 601088 | 中国神华 | 264,600   | 5,516,910.00 | 0.95 |
| 34 | 600221 | 海南航空 | 791,059   | 5,054,867.01 | 0.87 |
| 35 | 601618 | 中国中冶 | 650,688   | 4,704,474.24 | 0.81 |
| 36 | 600177 | 雅戈尔  | 211,138   | 3,855,379.88 | 0.66 |
| 37 | 601018 | 宁波港  | 431,600   | 3,815,344.00 | 0.66 |
| 38 | 600005 | 武钢股份 | 534,000   | 3,754,020.00 | 0.65 |
| 39 | 600383 | 金地集团 | 296,263   | 3,747,726.95 | 0.64 |
| 40 | 600023 | 浙能电力 | 362,605   | 3,597,041.60 | 0.62 |
| 41 | 601800 | 中国交建 | 200,100   | 3,513,756.00 | 0.60 |
| 42 | 601998 | 中信银行 | 420,463   | 3,241,769.73 | 0.56 |
| 43 | 601991 | 大唐发电 | 395,200   | 3,153,696.00 | 0.54 |
| 44 | 600741 | 华域汽车 | 140,238   | 2,994,081.30 | 0.52 |
| 45 | 600027 | 华电国际 | 261,942   | 2,912,795.04 | 0.50 |
| 46 | 600660 | 福耀玻璃 | 189,200   | 2,701,776.00 | 0.46 |
| 47 | 600219 | 南山铝业 | 264,000   | 2,663,760.00 | 0.46 |
| 48 | 601117 | 中国化学 | 264,074   | 2,582,643.72 | 0.44 |
| 49 | 600060 | 海信电器 | 101,967   | 2,507,368.53 | 0.43 |
| 50 | 600362 | 江西铜业 | 114,162   | 2,455,624.62 | 0.42 |
| 51 | 600827 | 百联股份 | 100,740   | 2,096,399.40 | 0.36 |
| 52 | 600886 | 国投电力 | 124,573   | 1,852,400.51 | 0.32 |
| 53 | 600717 | 天津港  | 114,257   | 1,712,712.43 | 0.29 |
| 54 | 600325 | 华发股份 | 89,934    | 1,627,805.40 | 0.28 |
| 55 | 600376 | 首开股份 | 51,300    | 989,577.00   | 0.17 |
| 56 | 600823 | 世茂股份 | 70,713    | 921,390.39   | 0.16 |
| 57 | 600153 | 建发股份 | 30,000    | 525,300.00   | 0.09 |

### 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

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

## 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  | 601299 | 中国北车   | 20,329,583.12 | 1.49           |
| 2  | 601318 | 中国平安   | 19,806,687.46 | 1.46           |
| 3  | 600000 | 浦发银行   | 13,607,683.00 | 1.00           |
| 4  | 601988 | 中国银行   | 12,444,427.00 | 0.91           |
| 5  | 601169 | DR 北京银 | 10,136,326.71 | 0.74           |
| 6  | 600016 | 民生银行   | 10,125,070.43 | 0.74           |
| 7  | 601390 | 中国中铁   | 9,693,750.00  | 0.71           |
| 8  | 601688 | 华泰证券   | 9,305,007.78  | 0.68           |
| 9  | 601328 | 交通银行   | 8,677,813.04  | 0.64           |
| 10 | 600048 | 保利地产   | 6,668,355.78  | 0.49           |
| 11 | 600028 | 中国石化   | 6,380,602.52  | 0.47           |
| 12 | 601186 | 中国铁建   | 5,859,862.80  | 0.43           |
| 13 | 601601 | XD 中国太 | 5,099,952.20  | 0.37           |
| 14 | 601618 | 中国中冶   | 4,994,603.00  | 0.37           |
| 15 | 600050 | 中国联通   | 4,606,117.74  | 0.34           |
| 16 | 600036 | 招商银行   | 4,545,204.67  | 0.33           |
| 17 | 601166 | 兴业银行   | 4,457,798.00  | 0.33           |
| 18 | 600029 | 南方航空   | 4,288,099.35  | 0.32           |
| 19 | 601857 | 中国石油   | 4,193,754.50  | 0.31           |
| 20 | 600153 | 建发股份   | 3,879,308.00  | 0.29           |

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  | 601766 | 中国中车 | 38,513,825.57 | 2.83           |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 10,196,137.71 | 0.75           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 9,635,394.80  | 0.71           |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 5,734,167.75  | 0.42           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5  | 600839 | 四川长虹 | 5,248,781.33 | 0.39 |
| 6  | 601088 | 中国神华 | 4,761,500.34 | 0.35 |
| 7  | 600266 | 北京城建 | 4,490,727.99 | 0.33 |
| 8  | 600383 | 金地集团 | 4,239,418.06 | 0.31 |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 3,892,942.30 | 0.29 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 3,496,392.04 | 0.26 |
| 11 | 600157 | 永泰能源 | 3,324,181.80 | 0.24 |
| 12 | 601668 | 中国建筑 | 3,166,081.83 | 0.23 |
| 13 | 600900 | 长江电力 | 2,935,793.07 | 0.22 |
| 14 | 601800 | 中国交建 | 2,864,419.60 | 0.21 |
| 15 | 601186 | 中国铁建 | 2,620,995.61 | 0.19 |
| 16 | 601899 | 紫金矿业 | 2,301,333.50 | 0.17 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 2,250,440.00 | 0.17 |
| 18 | 601390 | 中国中铁 | 2,008,044.84 | 0.15 |
| 19 | 601818 | 光大银行 | 1,969,541.20 | 0.14 |
| 20 | 600325 | 华发股份 | 1,891,862.30 | 0.14 |

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 | 257,919,730.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 166,850,658.46 |

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 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。

#### 7.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金未投资股指期货。

### **7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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**

### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金未投资国债期货。

### **7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金未投资国债期货。

## **7.12 投资组合报告附注**

### **7.12.1**

招商银行于 2014 年 8 月 4 日中国银行间市场交易商协会公告的交易商协会自律处分信息中，因自身工作操作疏忽导致其主承的大冶有色金属集团控股有限公司 2013 年报及 2014 年一季报未能按期披露，受到诫勉谈话处分。

中国平安控股公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于 2014-12-8 收到《中国证监会行政处罚决定书》（2014）103 号。处罚原因是平安证券出具的保荐书存在虚假记载，且未审慎核查海联讯公开发行人募集文件的真实性和准确性。中国证券监督管理委员会决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2,867 万元，并处以 440 万元罚款。

北京银行于 2014-7-28 收到上海证券交易所《关于对北京银行股份有限公司予以通报批评的决定》。处罚原因是公司在股东大会召开当日现场提出不对议案进行审议表决，未能满足在股东大会召开日前 2 个工作日延期或取消提案的时限要求。同时公司取消网络投票表决结果的行为，损害了参与网络投票的股东行使表决权的利益。上海证券交易所决定对北京银行股份有限公司予以通报批评，并记入上市公司诚信档案。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在

上证 180 价值指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本报告期内，本基金投资的前十名证券的其余七只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   | 49,731.17     |
| 2  | 应收证券清算款 | 11,038,989.54 |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 1,758.87      |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 11,090,479.58 |

### 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指数投资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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

## § 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<br>(户) | 户均持有的基金份<br>额 | 持有人结构            |            |                  |                |                  |            |
|--------------|---------------|------------------|------------|------------------|----------------|------------------|------------|
|              |               | 机构投资者            |            | 个人投资者            |                | 180 价值联接基金       |            |
|              |               | 持有份额             | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 1, 156       | 96, 931. 74   | 49, 119, 789. 00 | 40. 09%    | 10, 475, 634. 00 | 8. 55%         | 62, 933, 303. 00 | 51. 36%    |

## 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<br>比例 |
|----|----------------------------------|------------------|--------------|
| 1  | 新华人寿保险股份有限公司                     | 10, 000, 000. 00 | 8. 16%       |
| 2  | 北京千石创富－光大银行－千石资本一道冲套利 11 号资产管理计划 | 9, 279, 500. 00  | 7. 57%       |
| 3  | 北京千石创富－光大银行－千石资本一道冲套利 9 号资产管理计划  | 7, 875, 500. 00  | 6. 43%       |
| 4  | 北京千石创富－光大银行－千石资本一道冲套利 5 号资产管理计划  | 6, 500, 000. 00  | 5. 30%       |
| 5  | 北京千石创富－光大银行－千石资本一道冲套利 10 号资产管理计划 | 5, 982, 500. 00  | 4. 88%       |
| 6  | 新华人寿保险股份有限公司                     | 5, 722, 182. 00  | 4. 67%       |
| 7  | 中信证券股份有限公司                       | 3, 327, 307. 00  | 2. 72%       |
| 8  | 徐孚                               | 1, 346, 400. 00  | 1. 10%       |
| 9  | 明廷江                              | 296, 700. 00     | 0. 24%       |
| 10 | 成树芬                              | 270, 000. 00     | 0. 22%       |
| 11 | 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  | 62, 933, 303. 00 | 51. 36%      |

## 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 | 0. 00     | 0. 0000% |

## 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（2010 年 4 月 23 日）基金份额总额 | 2,109,182,935.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 342,528,726.00   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 2,223,500,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 2,443,500,000.00 |
| 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                   | 122,528,726.00   |

## § 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

报告期内，基金管理人、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

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（2010 年 4 月 23 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

1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况  
因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年 11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、报告期内，基金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 |    |
| 中信证券 | 1      | 386,927,172.10 | 100.00%      | 352,260.24 | 100.00%    | -  |
| 光大证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 申银万国 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

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：资质雄厚，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、本期交易单元无变动。

### 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 |
| 中信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |

## 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  | 关于调降华宝兴业网上交易汇款交易方式申购基金优惠费率至一折的公告                                        | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站 | 2015 年 4 月 9 日  |
| 2  | 华宝兴业基金管理有限公司关于上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金增加一级交易商的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站 | 2015 年 3 月 18 日 |
| 3  | 关于上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告                                   | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站 | 2015 年 1 月 19 日 |
| 4  | 华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告                                                  | 基金管理人网站                         | 2015 年 1 月 1 日  |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；

华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数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。

### 11.2 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。

### 11.3 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  
2015 年 8 月 28 日