

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金 2017 年半年度报告（摘要）

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝大盘精选混合 |
| 基金主代码 | 240011 |
| 交易代码 | 240011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008 年 10 月 7 日 |
| 基金管理人 | 华宝兴业基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 56,356,657.64 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。 |
| 投资策略 | 本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘月华 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 010-66594896 |

| | | | |
|--------|------|-------------------------------|----------------------|
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、 021-38924558 | 95566 |
| 传真 | | 021-38505777 | 010-66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|----------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fsfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§ 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 | -3,011,444.89 |
| 本期利润 | 5,048,156.10 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0883 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.43% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.46% |
| 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 | 39,579,891.93 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.7023 |
| 期末基金资产净值 | 95,936,549.57 |
| 期末基金份额净值 | 1.7023 |
| 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 | 97.47% |

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 | 6.33% | 0.81% | 4.01% | 0.54% | 2.32% | 0.27% |
| 过去三个月 | 3.07% | 0.84% | 4.90% | 0.49% | -1.83% | 0.35% |
| 过去六个月 | 5.46% | 0.77% | 8.65% | 0.45% | -3.19% | 0.32% |
| 过去一年 | -1.49% | 0.75% | 13.30% | 0.54% | -14.79% | 0.21% |
| 过去三年 | 33.39% | 2.03% | 59.07% | 1.40% | -25.68% | 0.63% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 97.47% | 1.61% | 72.79% | 1.33% | 24.68% | 0.28% |

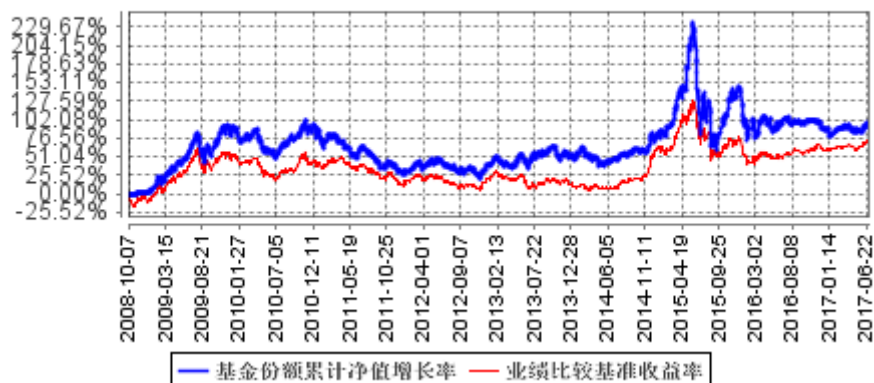
注：1、本基金比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

(2008 年 10 月 7 日至 2017 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2009 年 4 月 7 日，本基金已达到基金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 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 | | |
| 夏林锋 | 本基金基金经理、华宝生态中国混合、华宝未来主导混合基金经理 | 2014 年 10 月 22 日 | - | 7 年 | 硕士。曾在上海高压电器研究所从事研究工作。2010 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任分析师，2012 年 10 月至 2014 年 10 月担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经理助理，2014 年 10 月起担任华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金经 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理, 2015 年 2 月兼任华宝兴生态中国混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 6 月至 2017 年 3 月兼任华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月起兼任华宝兴业未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业大盘精选混合型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，大盘精选混合型证券投资基金在短期内出现过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

2017 年上半年，市场维持震荡，风格持续分化。政策方面，中央经济工作会议定调 2017 年稳字当头，定调积极财政政策和稳健中性的货币政策，并强调持续推进供给侧改革，尤其在 5 月中旬市场预期极低之时的监管表态保持了“稳”的基调。流动性方面，信贷投放较为充裕，人民币汇率稳中有升，但 MPA 考核及金融去杠杆等推进较为坚决，监管当局开正门、堵偏门的思路明确，同时央行两次上调 OMO 和 MLF 利率，进一步强化稳健中性的政策基调，从而导致整体流动性环境中性偏紧。经济形势方面，行业景气延续 2016 年以来的较好态势，基建、地产均有拉动，即使面临流动性偏紧、地产调控等约束，但经济韧性较强，呈现淡季不淡、旺季较旺的态势，中观数据持续好于预期。海外市场方面，美国加息预期兑现，美元指数较为疲弱，新兴市场压力减缓，油价处于较低位置，资源输入型通胀压力不大。

在上述背景下，2017 年上半年行情较为震荡，同时风格分化较为明显。本基金在上半年维持中性仓位，并持续进行结构调整、优化，持续重视大盘价值与大盘成长之间的轮换。

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 5.46%，同期业绩比较基准收益率为 8.65%，基金表现落后于比较基准 3.19%。

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 2017 年下半年，政策方面，考虑十九大即将召开，预计仍将维持“稳”字当头的核心思路，坚持稳中求进的工作基调，继续采取积极的财政政策和稳健的货币政策；流动性方面，预期整体仍将中性偏紧，金融去杠杆仍是大方向，不过预期最差的阶段可能已经过去，但利率上行是否对实体经济产生影响还需跟踪观察；经济形势方面，从目前数据及草根情况来看，经济韧性持续超预期，但在流动性收紧、地产调控约束之下，其持续性的确存在较大不确定性；企业盈利方面，结合目前流动性和经济景气来看，整体较为平稳，但结构分化较大，周期股业绩恢复最为明显，价值股维持平稳，成长股整体内生一般且外延受阻导致情况较差；海外市场方面，川普新政进度低于预期，美联储加息节奏略有放缓，美元指数较为疲弱，油价较难大幅上涨，整体冲击可能不大。

综上判断，预估 2017 年下半年仍将维持震荡态势。一方面，稳定预期之下，市场较难大起大落，出现超预期下跌的风险不大；另一方面，金融去杠杆叠加地产调控背景之下，经济持续性仍需观察。本基金计划在 2017 年下半年采取谨慎乐观的操作思路，维持中性略高仓位，持续重视结构调整，并在契约规定的范围内进一步优化大盘价值与大盘成长之间的配置，持续挖掘低估值蓝筹个股及能够穿越周期的优质成长股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 20,255,725.20 | 17,510,132.74 |
| 结算备付金 | | 735,593.57 | 520,533.88 |
| 存出保证金 | | 50,724.66 | 33,648.13 |
| 交易性金融资产 | | 76,280,452.48 | 76,203,811.07 |
| 其中：股票投资 | | 76,280,452.48 | 76,203,811.07 |
| 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 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 1,391,207.18 |
| 应收利息 | | 3,719.69 | 3,957.97 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 8,400.70 | 741.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 97,334,616.30 | 95,664,032.60 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 108,727.59 | 43,798.19 |
| 应付管理人报酬 | | 114,762.80 | 122,286.48 |
| 应付托管费 | | 19,127.14 | 20,381.09 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 890,894.08 | 1,471,446.71 |

| | | | |
|---------------|--|---------------|---------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 264,555.12 | 350,000.00 |
| 负债合计 | | 1,398,066.73 | 2,007,912.47 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 56,356,657.64 | 58,019,099.76 |
| 未分配利润 | | 39,579,891.93 | 35,637,020.37 |
| 所有者权益合计 | | 95,936,549.57 | 93,656,120.13 |
| 负债和所有者权益总计 | | 97,334,616.30 | 95,664,032.60 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7023 元，基金份额总额 56,356,657.64 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

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 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----|--|---|
| 一、收入 | | 7,192,158.15 | -20,305,224.93 |
| 1.利息收入 | | 76,866.95 | 80,904.51 |
| 其中：存款利息收入 | | 75,808.73 | 75,664.08 |
| 债券利息收入 | | - | 12.78 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,058.22 | 5,227.65 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -956,188.75 | -17,010,587.33 |
| 其中：股票投资收益 | | -1,229,317.15 | -17,394,200.50 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | 9,120.56 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 273,128.40 | 374,492.61 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 8,059,600.99 | -3,384,326.22 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 11,878.96 | 8,784.11 |

| | | | |
|----------------------------|--|--------------|----------------|
| 减：二、费用 | | 2,144,002.05 | 1,906,428.44 |
| 1. 管理人报酬 | | 691,109.02 | 788,164.35 |
| 2. 托管费 | | 115,184.91 | 131,360.75 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 1,251,597.69 | 891,009.94 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 86,110.43 | 95,893.40 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 5,048,156.10 | -22,211,653.37 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 5,048,156.10 | -22,211,653.37 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

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） | 58,019,099.76 | 35,637,020.37 | 93,656,120.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 5,048,156.10 | 5,048,156.10 |
| 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） | -1,662,442.12 | -1,105,284.54 | -2,767,726.66 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,376,060.55 | 2,059,569.35 | 5,435,629.90 |
| 2.基金赎回款 | -5,038,502.67 | -3,164,853.89 | -8,203,356.56 |
| 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 | 56,356,657.64 | 39,579,891.93 | 95,936,549.57 |

| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| | 金净值) | | |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 60,069,045.59 | 77,435,924.76 | 137,504,970.35 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -22,211,653.37 | -22,211,653.37 |
| 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) | 1,411,181.89 | 868,874.75 | 2,280,056.64 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,825,508.81 | 5,342,735.02 | 13,168,243.83 |
| 2.基金赎回款 | -6,414,326.92 | -4,473,860.27 | -10,888,187.19 |
| 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) | - | -11,330,676.83 | -11,330,676.83 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 61,480,227.48 | 44,762,469.31 | 106,242,696.79 |

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：

黄小慧

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]第956号《关于核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》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《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币489,953,207.92元,业经安永华明会计师事务所有限公司安永永明(2008)验字第60469025_B01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》于2008年10月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为490,050,880.11份基金份额,其中认购资金利息折合97,672.19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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金于2015年7月22日公告后更名为华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业大盘精选混合型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,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资比例为基金资产净值的60%-95%,其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于80%,权证投资比例为基金资产净值的0%-3%,资产支持证券比例为基金资产净值的0%-20%,债券及现金投资比例为基金资产净值的5%-40%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

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》、《华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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 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

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 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 Management S.A.) | 基金管理人的股东 |
| 中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”） | 华宝信托的最终控制人 |
| 华宝证券有限责任公司（“华宝证券”） | 受宝武集团控制的公司 |
| 华宝投资有限公司（“华宝投资”） | 受宝武集团控制的公司 |
| 宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”） | 受宝武集团控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月 30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 691,109.02 | 788,164.35 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 123,010.27 | 139,802.05 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 115,184.91 | 131,360.75 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 期初持有的基金份额 | 134,626.57 | 207,455.83 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 134,626.57 | 207,455.83 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.24% | 0.34% |

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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|-----------|--|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 20,255,725.20 | 69,972.25 | 25,295,814.70 | 70,603.03 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600136 | 当代明诚 | 2017 年 2 月 13 日 | 重大事项停牌 | 15.07 | - | - | 125,182 | 2,307,396.97 | 1,886,492.74 | - |

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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 74,393,959.74 元，属于第二层次的余额为 1,886,492.74 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 64,590,849.07 元，第二层次 11,612,962.00 元，无第三层次)。

(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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

价值相差很小。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

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

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 76,280,452.48 | 78.37 |
| | 其中：股票 | 76,280,452.48 | 78.37 |
| 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 | 20,991,318.77 | 21.57 |
| 7 | 其他各项资产 | 62,845.05 | 0.06 |
| 8 | 合计 | 97,334,616.30 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 | 1,000,657.00 | 1.04 |
| C | 制造业 | 54,430,545.28 | 56.74 |
| 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 | 1,984,978.46 | 2.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,880,644.20 | 1.96 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,424,505.00 | 1.48 |
| J | 金融业 | 11,757,641.98 | 12.26 |
| K | 房地产业 | 205,794.00 | 0.21 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 1,500,951.82 | 1.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 208,242.00 | 0.22 |
| 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 | 1,886,492.74 | 1.97 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 76,280,452.48 | 79.51 |

7.2.2 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前十名股票投资明细

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 | 002456 | 欧菲光 | 306,735 | 5,573,374.95 | 5.81 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 133,700 | 3,909,388.00 | 4.07 |
| 3 | 000050 | 深天马 A | 153,609 | 3,159,737.13 | 3.29 |
| 4 | 002236 | 大华股份 | 134,025 | 3,057,110.25 | 3.19 |
| 5 | 601231 | 环旭电子 | 194,000 | 3,047,740.00 | 3.18 |
| 6 | 300083 | 劲胜精密 | 315,600 | 2,916,144.00 | 3.04 |
| 7 | 601997 | 贵阳银行 | 182,548 | 2,886,083.88 | 3.01 |
| 8 | 002273 | 水晶光电 | 134,450 | 2,773,703.50 | 2.89 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 106,300 | 2,523,562.00 | 2.63 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 42,702 | 2,118,446.22 | 2.21 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 的半年度报告正文。

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 | 600110 | 诺德股份 | 9,238,325.40 | 9.86 |
| 2 | 601628 | 中国人寿 | 6,878,579.89 | 7.34 |
| 3 | 600525 | 长园集团 | 6,630,502.25 | 7.08 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 6,563,017.19 | 7.01 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 6,271,760.00 | 6.70 |
| 6 | 600977 | 中国电影 | 5,786,398.95 | 6.18 |
| 7 | 002460 | 赣锋锂业 | 5,722,247.88 | 6.11 |
| 8 | 000063 | 中兴通讯 | 5,623,512.00 | 6.00 |
| 9 | 002466 | 天齐锂业 | 5,588,306.00 | 5.97 |
| 10 | 000049 | 德赛电池 | 5,260,000.00 | 5.62 |
| 11 | 600808 | 马钢股份 | 5,119,926.00 | 5.47 |
| 12 | 300164 | 通源石油 | 5,109,938.55 | 5.46 |
| 13 | 000980 | 众泰汽车 | 4,874,815.00 | 5.21 |
| 14 | 002739 | 万达电影 | 4,752,986.49 | 5.07 |
| 15 | 601997 | 贵阳银行 | 4,661,123.00 | 4.98 |
| 16 | 000423 | 东阿阿胶 | 4,642,546.00 | 4.96 |
| 17 | 002353 | 杰瑞股份 | 4,476,316.53 | 4.78 |
| 18 | 000898 | 鞍钢股份 | 4,236,048.00 | 4.52 |
| 19 | 002273 | 水晶光电 | 4,149,022.98 | 4.43 |
| 20 | 300630 | 普利制药 | 4,072,183.36 | 4.35 |

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 | 600110 | 诺德股份 | 8,678,634.87 | 9.27 |
| 2 | 002353 | 杰瑞股份 | 7,277,496.18 | 7.77 |
| 3 | 300164 | 通源石油 | 6,981,484.17 | 7.45 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 5,945,059.48 | 6.35 |
| 5 | 002460 | 赣锋锂业 | 5,881,250.41 | 6.28 |
| 6 | 600977 | 中国电影 | 5,611,298.44 | 5.99 |
| 7 | 600525 | 长园集团 | 5,574,102.48 | 5.95 |
| 8 | 000049 | 德赛电池 | 5,341,795.26 | 5.70 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9 | 601628 | 中国人寿 | 5,296,649.47 | 5.66 |
| 10 | 600808 | 马钢股份 | 5,082,642.82 | 5.43 |
| 11 | 000423 | 东阿阿胶 | 5,026,106.90 | 5.37 |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 4,904,157.36 | 5.24 |
| 13 | 002294 | 信立泰 | 4,638,535.99 | 4.95 |
| 14 | 002739 | 万达电影 | 4,574,171.64 | 4.88 |
| 15 | 000422 | 湖北宜化 | 4,456,528.58 | 4.76 |
| 16 | 002236 | 大华股份 | 4,203,363.45 | 4.49 |
| 17 | 000898 | 鞍钢股份 | 4,043,650.03 | 4.32 |
| 18 | 600690 | 青岛海尔 | 4,043,304.50 | 4.32 |
| 19 | 300630 | 普利制药 | 3,985,308.76 | 4.26 |
| 20 | 000630 | 铜陵有色 | 3,978,218.72 | 4.25 |

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 | 410,377,737.36 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 417,131,379.79 |

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前十名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

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

大盘精选基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的劲胜精密（300083）于 2016 年 7 月 22 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局《关于收到中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书》。因公司存在部分融资租赁事项决策程序不规范、信息披露内部不真实等问题，对劲胜精密和王九全、王琼予以警示。

大盘精选基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的中兴通讯（000063）于 2017 年 3 月 8 日收到美国商务部工业与安全局、美国司法部、美国财政部海外资产管理办公室对公司实施出口限制措施的决定。因公司违反了美国出口管制法律，并在调查过程中因提供信息及其他行为违反了相关美国法律法规，公司已同意认罪并支付合计 892,360,064 美元罚款。此外，BIS 还对本公司处以暂缓执行的 3 亿美元罚款，在本公司于七年暂缓期内履行与 BIS 达成的协议要求的事项

后将被豁免支付。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和析，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 | 50,724.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,719.69 |
| 5 | 应收申购款 | 8,400.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 62,845.05 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 |
| 6,237 | 9,035.86 | 246,163.73 | 0.44% | 56,110,493.91 | 99.56% |

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 | 36,099.61 | 0.0641% |

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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2008年10月7日）基金份额总额 | 490,050,880.11 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 58,019,099.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,376,060.55 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,038,502.67 |
| 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 | 56,356,657.64 |

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

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强先生因个人原因，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

本基金自 2015 年 12 月 15 日起更换会计师事务所，由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2015 年 12 月 15 日起本报告期末。

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 | 158,883,369.21 | 19.20% | 145,446.43 | 19.11% | - |
| 华创证券 | 2 | 106,153,223.25 | 12.83% | 97,035.48 | 12.75% | - |
| 广发证券 | 2 | 90,222,861.49 | 10.90% | 83,497.18 | 10.97% | - |
| 国金证券 | 2 | 84,219,025.22 | 10.18% | 76,913.55 | 10.11% | - |
| 长江证券 | 1 | 64,454,820.83 | 7.79% | 60,027.24 | 7.89% | - |
| 兴业证券 | 2 | 56,120,578.29 | 6.78% | 51,161.23 | 6.72% | - |
| 国信证券 | 1 | 50,848,256.98 | 6.14% | 47,354.97 | 6.22% | - |
| 中泰证券 | 1 | 50,219,137.68 | 6.07% | 46,769.21 | 6.15% | - |
| 安信证券 | 2 | 48,613,641.41 | 5.87% | 44,301.20 | 5.82% | - |
| 西藏东方财富 | 1 | 21,001,472.75 | 2.54% | 19,138.68 | 2.51% | - |
| 申万宏源 | 2 | 20,940,076.75 | 2.53% | 19,501.57 | 2.56% | - |
| 国泰君安 | 1 | 19,562,866.38 | 2.36% | 18,218.69 | 2.39% | - |
| 光大证券 | 1 | 16,015,694.25 | 1.94% | 14,594.97 | 1.92% | - |
| 招商证券 | 1 | 12,229,104.59 | 1.48% | 11,144.60 | 1.46% | - |
| 中信建投 | 1 | 10,312,811.58 | 1.25% | 9,604.31 | 1.26% | - |
| 国海证券 | 2 | 7,051,226.94 | 0.85% | 6,566.81 | 0.86% | - |
| 中金国际 | 2 | 6,098,769.28 | 0.74% | 5,557.84 | 0.73% | - |
| 浙商证券 | 2 | 4,537,021.68 | 0.55% | 4,225.32 | 0.56% | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信金通 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 宏信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 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、本基金本报告期新增券商交易单元信息如下：

安信证券, 申万宏源, 华宝证券, 宏信证券

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 | - | - | 7,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金国际 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信金通 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日