# 华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
# 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017年8月25日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 | 华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝兴业中证全指证券公司 ETF |
| 场内简称 | 券商 ETF |
| 基金主代码 | 512000 |
| 交易代码 | 512000 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 8 月 30 日 |
| 基金管理人 | 华宝兴业基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 170,717,683.00 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 | 2016 年 9 月 14 日 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。<br>1、组合复制策略<br>本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。<br>2、替代性策略<br>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。<br>3、债券投资策略<br>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。<br>4、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略<br>在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运 |

| | |
|---|---|
| | 用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。<br>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。<br>本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指证券公司指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。<br>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华宝兴业基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘月华 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、021-38924558 | 010—67595096 |
| 传真 | | 021-38505777 | 010-66275853 |

## 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 | 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。 |

# §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 | -3,933,448.24 |
| 本期利润 | -476,779.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0031 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.33% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.10% |
| 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 | -6,950,584.78 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0407 |
| 期末基金资产净值 | 163,767,098.22 |
| 期末基金份额净值 | 0.9593 |
| 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 | -4.07% |

注：（1）本基金合同生效日为 2016 年 8 月 30 日，至披露时点不满一年。

（2）上述基金财务指标不包括持有人认购和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。

（3）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。

（4）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。

（5）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 | 2.04% | 0.70% | 1.62% | 0.71% | 0.42% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.20% | 0.85% | -1.15% | 0.86% | 1.35% | -0.01% |

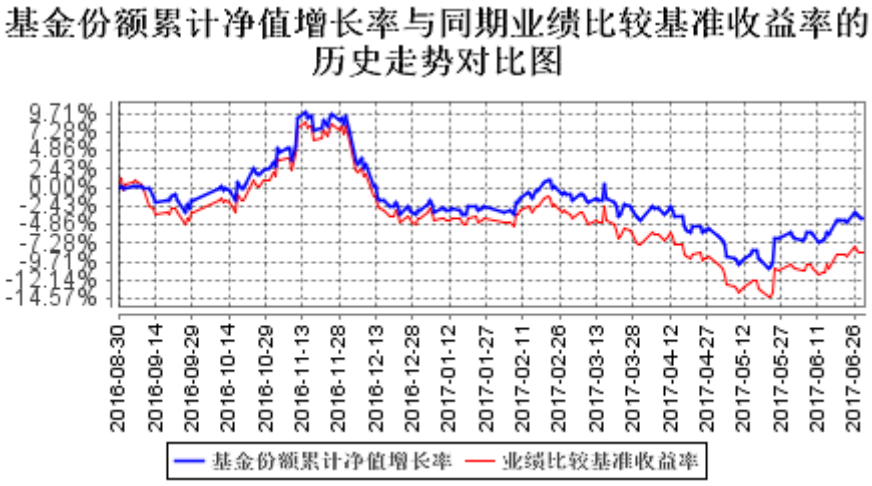
| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | -1.10% | 0.78% | -4.67% | 0.79% | 3.57% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | -4.07% | 0.89% | -8.63% | 0.93% | 4.56% | -0.04% |

注： 1、本基金业绩比较基准为：中证全指证券公司指数。

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

（2016 年 8 月 30 日至 2017 年 6 月 30 日）




注：1、本基金基金合同生效于 2016 年 8 月 30 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2017 年 2 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 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 | | |
| 丰晨成 | 本基金基金经理、华宝兴业上证 180 价值 ETF、华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接基金 | 2016 年 8 月 30 日 | - | 8 年 | 硕士。2009 年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任助理产品经理，数量分析师，投资经理助理，投资经理等职务。2015 年 11 月任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 经理 | | | | 2016 年 8 月兼任华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数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、《华宝兴业中证全指证券公司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。

## 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 年上半年资本市场在服务实体经济、防控风险、守住不发生系统性金融风险底线的要求下继续深化改革，从上半年券商行业业绩数据上看，股基成交量较去年同期有所下降；IPO 常态化、再融资收紧、利率压力下债券发行节奏放缓，导致投行各业务营收占比有所分化；两融规模趋稳，股票质押回购规模大幅增长；受去年同期低基数影响，预计自营业绩同比改善；去杠杆、去通道的严监管环境下预计券商资管规模扩张放缓。整体来看，上半年市场数据喜忧参半，经纪业务承压，自营、资本中介业务同比改善，投行各业务有所分化。本基金跟踪中证全指证券公司指数，该指数在上半年整体呈现出振荡走势。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们遵守基金合同，按照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 0.9593 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.10%，同期业绩比较基准收益率为-4.67%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在金融去杠杆的背景下，强调服务实体经济的能力和水平，对券商行业来说，适应严监管的新常态，资本市场重点是融资功能，券商作为直接融资的实施主体，长期发展空间广阔。伴随着 6 月份 A 股的回升和蓝筹行情，券商自营业务和资管业务受益明显，6 月当月券商营收及净利润情况大幅超预期。这显示出在目前佣金率下滑对于券商经纪业务的边际影响逐渐减弱，市场走势对于自营业务的影响及其弹性可能是下半年影响券商指数表现的重要因素。

作为指数基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照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及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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

# §5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据《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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

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<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | | 2,283,139.00 | 1,465,278.83 |
| 结算备付金 | | 97,497.39 | 619,705.61 |
| 存出保证金 | | 27,001.61 | 166,091.00 |
| 交易性金融资产 | | 162,019,017.57 | 149,516,725.04 |
| 其中：股票投资 | | 162,019,017.57 | 149,516,725.04 |
| 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 | | 634,556.10 | 554,694.00 |
| 应收利息 | | 564.86 | 747.09 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 165,061,776.53 | 152,323,241.57 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2017 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | | 441,217.44 | 581,001.72 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 63,673.11 | 59,368.89 |
| 应付托管费 | | 12,734.62 | 11,873.79 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 490,995.57 | 430,762.48 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 286,057.57 | 187,000.00 |
| 负债合计 | | 1,294,678.31 | 1,270,006.88 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | | 170,717,683.00 | 155,717,683.00 |
| 未分配利润 | | -6,950,584.78 | -4,664,448.31 |
| 所有者权益合计 | | 163,767,098.22 | 151,053,234.69 |
| 负债和所有者权益总计 | | 165,061,776.53 | 152,323,241.57 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9593 元，基金份额总额 170,717,683.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、收入** | | 411,338.78 |
| 1.利息收入 | | 10,942.53 |
| 其中：存款利息收入 | | 10,942.53 |
| 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） | | -3,193,913.32 |
| 其中：股票投资收益 | | -3,967,234.06 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | | - |
| 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 | | 773,320.74 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 3,456,668.27 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 137,641.30 |

| | | |
|---|---|---|
| **减：二、费用** | | 888,118.75 |
| 1．管理人报酬 | | 360,695.62 |
| 2．托管费 | | 72,139.11 |
| 3．销售服务费 | | - |
| 4．交易费用 | | 197,728.11 |
| 5．利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6．其他费用 | | 257,555.91 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | -476,779.97 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -476,779.97 |

注：本基金于 2016 年 8 月 30 日成立，无上年可比期间数据。

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

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<br>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） | 155,717,683.00 | -4,664,448.31 | 151,053,234.69 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -476,779.97 | -476,779.97 |
| 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） | 15,000,000.00 | -1,809,356.50 | 13,190,643.50 |
| 其中：1.基金申购款 | 215,400,000.00 | -8,213,244.80 | 207,186,755.20 |
| 2.基金赎回款 | -200,400,000.00 | 6,403,888.30 | -193,996,111.70 |
| 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 | 170,717,683.00 | -6,950,584.78 | 163,767,098.22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 金净值） | | | |

注：本基金于 2016 年 8 月 30 日成立，无上年可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|---|---|---|
| 黄小薏 | 向辉 | 张幸骏 |
| 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

华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1152 号《关于准予华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 642,017,683.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1061 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 642,017,683.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]230 号核准，本基金于 2016 年 9 月 14 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于中证全指证券公司指数成份股和备选成份股，也可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监

会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数。

### 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》、《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数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 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

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

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

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

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

### 6.4.7 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、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 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

本基金本报告期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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 360,695.62 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：支付基金管理人华宝兴业 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 72,139.11 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

### 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

本基金本报告期未与关联方进行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

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 2,283,139.00 | 8,584.11 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603933 | 睿能科技 | 2017 年 6 月 28 日 | 2017 年 7 月 6 日 | 新股流通受限 | 20.20 | 20.20 | 857 | 17,311.40 | 17,311.40 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017 年 6 月 30 日 | 2017 年 7 月 10 日 | 新股流通受限 | 11.26 | 11.26 | 1,351 | 15,212.26 | 15,212.26 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017 年 6 月 27 日 | 2017 年 7 月 5 日 | 新股流通受限 | 9.63 | 9.63 | 999 | 9,620.37 | 9,620.37 | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017 年 6 月 23 日 | 2017 年 7 月 3 日 | 新股流通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至 2017 年 6 月 30 日未持有被暂时停牌的股票。

#### 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 161,969,443.78 元，属于第二层次的余额为 49,573.79 元，无属于第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日：第一层次 141,593,109.29 元，第二层次 7,923,615.75 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，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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

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

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

# §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 162,019,017.57 | 98.16 |
| | 其中：股票 | 162,019,017.57 | 98.16 |
| 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 | 2,380,636.39 | 1.44 |
| 7 | 其他各项资产 | 662,122.57 | 0.40 |
| 8 | 合计 | 165,061,776.53 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| 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 | 505,905.00 | 0.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 161,250,735.24 | 98.46 |
| K | 房地产业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 161,756,640.24 | 98.77 |

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 223,599.09 | 0.14 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 38,778.24 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 262,377.33 | 0.16 |

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 | 600030 | 中信证券 | 1,260,600 | 21,455,412.00 | 13.10 |
| 2 | 600837 | 海通证券 | 1,299,400 | 19,296,090.00 | 11.78 |
| 3 | 601211 | 国泰君安 | 724,938 | 14,868,478.38 | 9.08 |
| 4 | 601688 | 华泰证券 | 523,800 | 9,376,020.00 | 5.73 |
| 5 | 000776 | 广发证券 | 470,600 | 8,117,850.00 | 4.96 |
| 6 | 600958 | 东方证券 | 499,900 | 6,953,609.00 | 4.25 |
| 7 | 601901 | 方正证券 | 661,400 | 6,567,702.00 | 4.01 |
| 8 | 600999 | 招商证券 | 353,792 | 6,092,298.24 | 3.72 |
| 9 | 601377 | 兴业证券 | 750,900 | 5,579,187.00 | 3.41 |
| 10 | 000166 | 申万宏源 | 959,000 | 5,370,400.00 | 3.28 |

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。

### 7.3.2 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前五名股票投资明细

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 | 603801 | 志邦股份 | 1,406 | 47,522.80 | 0.03 |
| 2 | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.03 |
| 3 | 603316 | 诚邦股份 | 1,824 | 38,778.24 | 0.02 |
| 4 | 603335 | 迪生力 | 2,230 | 24,864.50 | 0.02 |
| 5 | 603679 | 华体科技 | 809 | 21,438.50 | 0.01 |

## 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 | 000776 | 广发证券 | 10,970,759.27 | 7.26 |
| 2 | 002736 | 国信证券 | 7,333,456.74 | 4.85 |
| 3 | 000783 | 长江证券 | 6,999,661.94 | 4.63 |
| 4 | 000166 | 申万宏源 | 6,999,507.25 | 4.63 |
| 5 | 002673 | 西部证券 | 5,733,030.71 | 3.80 |
| 6 | 000728 | 国元证券 | 4,422,853.94 | 2.93 |
| 7 | 000750 | 国海证券 | 3,799,460.45 | 2.52 |
| 8 | 000686 | 东北证券 | 3,313,956.64 | 2.19 |
| 9 | 002500 | 山西证券 | 3,239,368.00 | 2.14 |
| 10 | 600999 | 招商证券 | 2,253,388.45 | 1.49 |
| 11 | 002797 | 第一创业 | 1,730,097.31 | 1.15 |
| 12 | 600909 | 华安证券 | 1,546,123.00 | 1.02 |
| 13 | 000712 | 锦龙股份 | 1,507,280.00 | 1.00 |
| 14 | 601901 | 方正证券 | 1,316,565.00 | 0.87 |
| 15 | 601881 | 中国银河 | 1,279,993.66 | 0.85 |
| 16 | 601375 | 中原证券 | 1,200,325.00 | 0.79 |
| 17 | 002670 | 国盛金控 | 1,036,068.86 | 0.69 |
| 18 | 000987 | 越秀金控 | 578,932.20 | 0.38 |
| 19 | 601211 | 国泰君安 | 508,493.00 | 0.34 |
| 20 | 600030 | 中信证券 | 501,839.00 | 0.33 |

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 | 000776 | 广发证券 | 10,575,720.84 | 7.00 |
| 2 | 002736 | 国信证券 | 7,100,819.64 | 4.70 |
| 3 | 000783 | 长江证券 | 6,872,354.00 | 4.55 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 4 | 000166 | 申万宏源 | 6,307,629.55 | 4.18 |
| 5 | 002673 | 西部证券 | 5,258,396.51 | 3.48 |
| 6 | 000728 | 国元证券 | 4,164,793.52 | 2.76 |
| 7 | 000686 | 东北证券 | 3,241,270.60 | 2.15 |
| 8 | 000750 | 国海证券 | 3,218,783.00 | 2.13 |
| 9 | 002500 | 山西证券 | 2,340,207.56 | 1.55 |
| 10 | 002797 | 第一创业 | 1,765,566.40 | 1.17 |
| 11 | 000712 | 锦龙股份 | 1,441,050.07 | 0.95 |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 829,804.00 | 0.55 |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 723,219.00 | 0.48 |
| 14 | 601211 | 国泰君安 | 713,320.00 | 0.47 |
| 15 | 601212 | 白银有色 | 523,448.90 | 0.35 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 469,277.94 | 0.31 |
| 17 | 600958 | 东方证券 | 313,592.11 | 0.21 |
| 18 | 601099 | 太平洋 | 277,285.00 | 0.18 |
| 19 | 601881 | 中国银河 | 257,641.42 | 0.17 |
| 20 | 601901 | 方正证券 | 214,129.00 | 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 | 71,034,972.10 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 64,425,726.78 |

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。

## 7.9 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

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日前十名证券中的海通证券（600837）于 2016 年 11 月 25 收到中国证监会处罚决定。因公司未按照有关规定对客户的身份信息进行审查和了解，对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得约 2,865 万元，并处以约 8,595 万元罚款。

海通证券（600837）于 2017 年 1 月 18 日收到云南证监局《对海通证券股份有限公司晋宁昆阳街证券营业部采取责令改正措施的决定》。因营业部未及时到证监局换领经营证券期货业务许可证，未在许可证到期前向证监局提交换领许可证的相关申请文件，内控管理不完善，决定对营业部采取责令改正的监督管理措施。

海通证券（600837）于 2017 年 3 月 10 日收到全国中小企业股份转让系统的整改通知。因海通证券在推荐天元宠物挂牌过程中，未披露天元宠物资金往来事项，未披露关联交易事项，决定对海通证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

海通证券（600837）于 2017 年 5 月 25 日收到中国证监会处罚决定。因海通证券涉嫌违法违规，依据《证券公司监督管理条例》拟决定责令海通证券改正，给予警告，没收违法所得 509,653.15 元，并处罚款 2,548,265.75 元。

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

中信证券（600030）于 2017 年 5 月 25 日收到中国证监会处罚决定。在客户开户未满半年的情况下为其开立信用账户，提供融资融券服务，违反了《证券公司融资融券业务管理办法》。责令

中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币 61,655,849.78 元，并处人民币 308,279,248.90 元罚款。

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211)于 2016 年 7 月 26 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局整改通知。因其作为国泰君安新利 6 号集合资产管理计划的资产管理人，投资决策和交易执行环节控制存在不足，发生相关异常交易。公司未能切实履行勤勉尽责的管理人义务，未能采取有效措施防范利益冲突，责令公司增加内部合规检查次数，并及时提交合规检查报告。

国泰君安（601211)于 2016 年 8 月 26 日收到中国证监会警告。因其国泰君安在保荐金徽酒首发项目过程中，向中国证监会提交的会后事项承诺函中未如实说明发行人 2015 年利润分配情况，对发行人实施分红事项，未主动向我会履行告知义务，对国泰君安采取了出具警示函的行政监管措施。

国泰君安（601211)于 2016 年 12 月 27 日收到中国证券监督管理委员会整改通知。因其内核机构履职的独立性存在缺陷，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》。并且在推荐企业进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。拟责令公司改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告。

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的华泰证券（601688)于 2016 年 8 月 23 日收到全国股转公司警示函。因公司在投资者适当性管理过程中存在违规事实，决定对公司采取出具警示函、责令改正的自律监管措施。

华泰证券（601688)于 2017 年 1 月 20 日收到中国证券监督管理委员会整改通知。因公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品，违反相关法规。决定对公司采取责令改正的行政监督管理措施。

华泰证券（601688)于 2017 年 3 月 28 日收到全国中小企业股份转让系统整改通知。因华泰证券作为主办券商未核实对禹州源衡水处理有限公司《行政处罚决定书》的内容差异，导致公开转让说明书披露的处罚金额为叁万元整与上述《行政处罚决定书》金额不符。现决定华泰证券股份

有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

华泰证券（601688)于 2017 年 3 月 28 日收到全国中小企业股份转让系统整改通知。因华泰证券未勤勉履行补充核查义务，现决定华泰证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

华泰证券（601688)于 2017 年 4 月 7 日收到全国中小企业股份转让系统整改通知。因华泰证券未能在知悉或者应当知悉挂牌公司发生违规对外担保之日起十五个转让日内对其进行现场检查,违反了《全国中小企业股份转让系统主办券商持续督导工作指引（试行)》，未能勤勉尽责地履行持续督导义务。现决定华泰证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

华泰证券（601688)于 2017 年 6 月 13 日收到天津证监局警告。因华泰证券营业部员工刘某蕾代客户在《融资融券交易风险揭示书》上抄写“以上《融资融券交易风险揭示书》的全部内容，本人确认已阅读并完全理解，愿意承担融资融券交易的风险和损失”的内容。决定对营业部采取出具警示函的监督管理措施。

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的广发证券（000776)于 2016 年 11 月 24 日收到中国证券监督管理委员会辽宁监管局整改通知。因公司营口学府路证券营业部在代销宝盈新动力 3、7、15 号产品过程中，未能全面、公正、准确地介绍金融产品有关信息，充分说明金融产品的主要风险特征，未能保证金融产品营销人员充分了解所负责推介金融产品的信息，营业部在产品销售过程中的风险揭示不到位，对广发证券股份有限公司营口学府路证券营业部采取责令改正的措施。

广发证券（000776)于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会处罚决定。因公司在未采集上述客户身份识别信息的情况下，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商证券（600999)于 2017 年 4 月 28 日收到深圳证监局整改通知。由于公司在为客户开立 PB 系统账户的时候，对客户的尽职调查不完整，违反了《证券公司监督管理条例》的有关规定。现决定对公司采取责令改正并暂停新开

立 PB 系统账户 3 个月的行政监管措施。同时要求公司应对 PB 系统相关业务开展情况进行全面自查，并自收到决定书之日起 30 日内向深圳证监局提交自查整改报告。

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的兴业证券（601377)于 2016 年 7 月 9 日收到中国证券监督管理委员会处罚决定。因公司涉嫌未按规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，对公司给予警告，没收保荐业务收入 1,200 万元，并处以 2,400 万元罚款；没收承销股票违法所得 2,078 万元，并处以 60 万元罚款。

券商 ETF 基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的方正证券(601901) 于 2016 年 7 月 22 日收到湖南证监局整改通知。因公司在股票质押式回购交易中，未对资金融出方进行前端控制，造成客户金瓯 17 号定向资产管理计划账户出现大额透支。定对公司采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

方正证券(601901) 于 2016 年 10 月 25 日收到湖南证监局警告。因公司研究所员工廖蕾以公司名义通过视频播报方式向投资者推荐中兴通讯股票，公司未对发布研究报告相关人员的资格进行合规审查。同时，此次发布行为未由公司集中统一管理，公司也未履行相关质量控制和合规审查义务。决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施。

方正证券(601901) 于 2016 年 11 月 24 日收到湖南证监局警告。因方正证券邵阳邵水西路证券营业部未将电脑纳入异常交易监控范围，同时未能按公司制度要求妥善处理客户投诉。湖南证监局决定对方正证券邵阳邵水西路证券营业部采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

方正证券(601901) 于 2016 年 11 月 25 日收到中国证监会处罚决定。因公司未按规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第 28 条第 1 款规定。对方正证券责令改正，给予警告，没收违法所得约 786 万元，并处以约 1,572 万元罚款。

方正证券(601901) 于 2016 年 12 月 9 日收到湖南证监局整改通知。因营业部融资融券业务审荐人建议客户通过卖出股票偿还负债的方式将信用账户维持担保比例提升至重点关注线，该建议与营业部关于融资融券业务的内部流程不相符，对客户的交易构成误导。决定对你营业部采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

方正证券(601901) 于 2016 年 12 月 15 日收到全国中小企业股份转让系统警告。因公司在首次信息披露日已知悉公司存在资金占用事项，却仍然组织公司进行首次信息披露及后续挂牌工作，未能履行勤勉尽责义务，未能保证申请挂牌文件信息披露的真实、准确、完整。对方正证券给予出具警示函的自律监管措施。

方正证券(601901) 于 2016 年 12 月 20 日收到中国证监会处罚决定。因公司在信息披露上存在问题，对方正证券责令改正，给予警告，并处以 60 万元罚款。

方正证券(601901) 于 2016 年 12 月 20 日收到湖南证监局公开谴责。因公司在信息披露上存在问题，对方正证券责令改正，给予警告，并处以 60 万元罚款。

方正证券(601901) 于 2016 年 12 月 30 日收到湖南证监局公开谴责。因为部分营业部客户佣金管理不规范，佣金调整无客户确认记录。在向客户提供证券投资顾问服务并收取服务费用的情况下，未按要求与客户签订证券投资顾问协议。决定对公司采取责令限期改正，同时对公司给予谴责。

方正证券(601901) 于 2017 年 5 月 5 日收到中国证监会处罚决定。因为在信息披露违法案件中，方正证券自 IPO 开始并延续多年未如实披露控股股东与其他股东的关联关系，违法情节严重。对其处以 60 万元罚款。

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，按照成份股在中证全指证券公司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两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 | 27,001.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | 634,556.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 564.86 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 662,122.57 |

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

本基金本报告期末积极投资前五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 |
| 4,064 | 42,007.30 | 32,345,761.00 | 18.95% | 138,371,922.00 | 81.05% |

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 南京紫金资产管理有限公司 | 15,165,000.00 | 8.88% |
| 2 | 国金证券－广州农商银行－国金慧睿多策略－国金鑫丰 3 号集合资产管理计划 | 9,614,900.00 | 5.63% |
| 3 | 张晓雷 | 4,343,930.00 | 2.54% |
| 4 | 戴瑞斌 | 2,984,900.00 | 1.75% |
| 5 | 银河金汇证券资管－工商银行－银河金汇慧通股基 FOF 集合资产管理计划 | 2,093,700.00 | 1.23% |
| 6 | 招商证券股份有限公司 | 2,017,361.00 | 1.18% |
| 7 | 魏良中 | 2,000,000.00 | 1.17% |
| 8 | 高晓辉 | 1,810,000.00 | 1.06% |
| 9 | 王兴文 | 1,500,000.00 | 0.88% |
| 10 | 周云鹤 | 1,271,400.00 | 0.74% |

## 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（2016 年 8 月 30 日）基金份额总额 | 642,017,683.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 155,717,683.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 215,400,000.00 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 200,400,000.00 |
| 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 | 170,717,683.00 |

# §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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 2 | 104,580,548.93 | 78.79% | 95,303.92 | 78.42% | - |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | 22,299,738.74 | 16.80% | 20,768.03 | 17.09% | - |
| 第一创业 | 1 | 4,131,834.71 | 3.11% | 3,848.04 | 3.17% | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | 1,680,251.78 | 1.27% | 1,564.87 | 1.29% | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | 41,805.00 | 0.03% | 38.10 | 0.03% | - |

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元无变化。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日