

# 华宝兴业资源优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	华宝兴业资源优选混合型证券投资基金
基金简称	华宝资源优选混合
基金主代码	240022
交易代码	240022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 21 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	292,824,065.43 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握资源相关行业的投资机会，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对资源相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享资源稀缺性所带来的行业高回报。本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据、以捕捉市场机会，提高基金资产的使用效率。
业绩比较基准	80%×中证内地资源主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
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	6,477,024.75
本期利润	24,216,691.09
加权平均基金份额本期利润	0.0739
本期加权平均净值利润率	5.75%
本期基金份额净值增长率	6.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	22,118,503.31
期末可供分配基金份额利润	0.0755
期末基金资产净值	386,933,434.86
期末基金份额净值	1.321
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	32.10%

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、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、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资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.66%	0.82%	5.59%	0.69%	2.07%	0.13%
过去三个月	1.38%	0.93%	-0.99%	0.83%	2.37%	0.10%
过去六个月	6.02%	0.90%	3.86%	0.76%	2.16%	0.14%

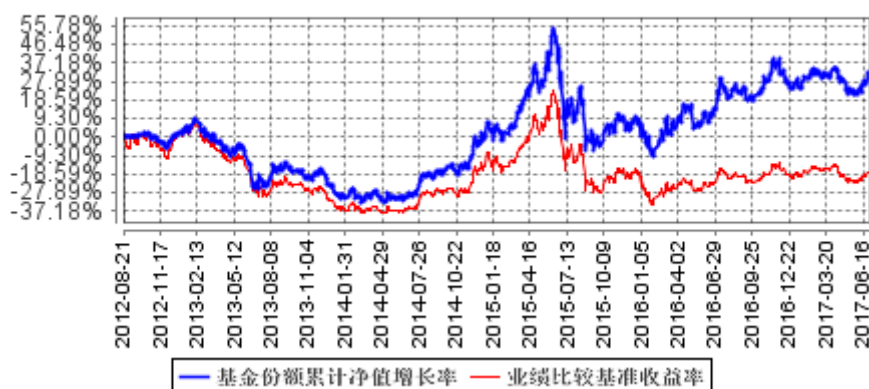
过去一年	16.70%	1.11%	7.26%	0.86%	9.44%	0.25%
过去三年	87.11%	1.91%	29.14%	1.67%	57.97%	0.24%
自基金合同生效日起至 今	32.10%	1.68%	-17.33%	1.52%	49.43%	0.16%

注：1、本基金业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证内地资源主题指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率。  
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

(2012年8月21日至2017年6月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 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 2013 年 2 月 21 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2017 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、中国互联网基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来产业主导基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金及新优享基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 122,557,514,320.78 元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡目荣	国内投资部副总经理、本基金基金经理、华宝兴业多策略基金经理	2012 年 8 月 21 日	-	14 年	硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作，2008 年 6 月进入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理和交易员的职务。2012 年 8 月起任华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金经理。

					2015 年 6 月至 2017 年 3 月任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 11 月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起任国内投资部副总经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业资源优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。

## 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，国内经济在房地产投资和基建投资带动下继续向好。始于 2016 年三季度末的房地产调控在 2017 年上半年不断升级，房地产销售受监管政策影响而低迷，尤其是一线城市成交量明显下滑，导致市场在二季度就对国内经济发展有所担忧。同时二季度监管部门持续推动的金融监管及金融去杠杆抬高了市场利率水平，加剧市场对未来经济下滑的担忧。但从已经披露的宏观数据看，在一季度经济数据较好情况下，二季度国内经济表现还是明显超出市场预期。美国就业市场就业数据以及经济增长数据良好，美联储 6 月份再次启动了加息 25 个基点，但加息幅度和时间点符合市场预期。欧元区制造业和服务业 PMI 呈现出明显的上升趋势，预示着欧元区经济开始进入复苏阶段。受益于日元贬值以及出口增长，日本一季度 GDP 增长超出市场预期，4、5 月份日本制造业和服务业 PMI 继续保持较好水平。整体而言，国内外经济上半年均保持了良好发展势头。

A 股市场上半年走势明显分化，从风格上看创业板指数下跌较多，上证指数小幅上涨，而中小板指数涨幅较好，上证 50 和沪深 300 指数大幅上涨。上半年市场表现较好的行业是家电、食品饮料和煤炭，而计算机、农林牧渔和纺织服装表现较差。上半年上证指数涨幅 2.86%，深成指涨幅 3.46%，创业板指数涨幅-7.34%，上证 50 和沪深 300 涨幅分别为 11.5%和 10.78%，内地资源指数跌幅 4.64%，煤炭指数涨幅 5.51%，有色指数跌幅 3.62%。

资源板块上半年表现基本上为市场平均水平，一季度表现较好，主要原因是 2015 年底我国政府开始启动供给侧改革有利于化解上游行业产能严重供应过剩的局面；另外，国内经济企稳回升也增加了上游行业的投资吸引力。二季度资源板块表现一般，主要是因为国内房地产行业受调控影响而出现销量下滑势头，市场担心销量下滑会影响到后续地产投资，进而影响资源板块下游需求。同时二季度国内进行的金融监管和金融去杠杆导致资金市场利率不断抬高，也引发了市场对未来经济增长的担忧，对作为投资品的资源板块表现影响负面。由于对市场整体偏谨慎，本基金上半年维持了中等偏低仓位，明显超配的行业是煤炭和电解铝。

### 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 6.02%，同期业绩比较基准收益率为 3.86%，基金表现领先于比较基准 2.16%。

#### 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，在房地产行业去库存较好的情况下，虽然地产销售有所下滑，但预计房地产投资下半年也会保持较高水平；基础设施投资由于 PPP 推进，预计投资增速也会保持；制造业投资方面，因为传统行业由于供给侧改革等导致行业盈利回升，同时距离上一轮设备投资高峰期也有 8-9 年时间，预计设备更新需求将会较为旺盛。由于 2017 年下半年将会召开十九大，预计相关改革将会再次受到市场关注，国企改革进展依然值得期待。从国外看，预计 2017 年美国还会继续维持复苏，美联储加息态度已经出现弱化，未来其货币紧缩力度和进程值得密切跟踪。欧洲目前经济恢复较好，欧央行货币政策紧缩下半年也会逐步提上日程。全球主要央行货币紧缩政策对全球资产配置影响值得密切关注。

对于 A 股市场来说，经过 2 年多调整后，中小市值股票估值较高的压力得到部分缓解，但其估值水平依然不低，因此 2017 年下半年预计还难以有全面上涨的机会，但个股机会预计会增多。由于中国居民资产配置股市依然很低，同时国内经济处于底部，未来股市部分行业和板块依然具有一定的投资机会。未来本基金配置上继续偏向于投资资源行业里面景气处于上升周期，相关公司盈利可以大幅回升的子行业；同时重点关注未来有望受益于新经济发展方向的自然资源，受益于环保监管加强带来供给约束的资源类子行业，另外我们也会密切关注供给侧改革和国企改革为上市公司带来的投资机会。2017 年我们将努力寻找自然资源领域新的投资机会，为投资人创造良好的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末进行利润分配，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”）在对华宝兴业资源优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：华宝兴业资源优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
<b>资产：</b>			
银行存款		33,172,458.32	75,264,758.28
结算备付金		241,030.27	1,392,769.17
存出保证金		54,439.29	126,982.49
交易性金融资产		318,880,630.78	322,003,600.34
其中：股票投资		318,880,630.78	322,003,600.34
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		39,658,416.54	-
应收利息		-14,037.80	19,202.45
应收股利		-	-
应收申购款		425,444.86	1,321,693.71
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		392,418,382.26	400,129,006.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	452,852.12
应付赎回款		3,962,796.40	1,552,939.15
应付管理人报酬		466,573.87	548,516.75
应付托管费		77,762.31	91,419.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		777,323.66	598,005.07

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		200,491.16	200,000.00
负债合计		5,484,947.40	3,443,732.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		292,824,065.43	318,494,628.24
未分配利润		94,109,369.43	78,190,645.68
所有者权益合计		386,933,434.86	396,685,273.92
负债和所有者权益总计		392,418,382.26	400,129,006.44

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.321 元，基金份额总额 292,824,065.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业资源优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
<b>一、收入</b>		28,994,847.19	5,148,053.78
1.利息收入		400,837.23	102,749.67
其中：存款利息收入		298,464.49	102,749.67
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		102,372.74	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,324,846.01	2,895,601.83
其中：股票投资收益		9,518,539.30	2,653,478.72
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		806,306.71	242,123.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		17,739,666.34	1,190,379.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		529,497.61	959,322.58
<b>减：二、费用</b>		4,778,156.10	1,566,830.95

1. 管理人报酬		3,131,548.24	971,714.64
2. 托管费		521,924.74	161,952.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,048,226.68	359,002.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		76,456.44	74,161.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		24,216,691.09	3,581,222.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		24,216,691.09	3,581,222.83

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业资源优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）	318,494,628.24	78,190,645.68	396,685,273.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,216,691.09	24,216,691.09
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）	-25,670,562.81	-8,297,967.34	-33,968,530.15
其中：1.基金申购款	141,049,200.64	41,397,330.82	182,446,531.46
2.基金赎回款	-166,719,763.45	-49,695,298.16	-216,415,061.61
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）	292,824,065.43	94,109,369.43	386,933,434.86

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
一、期初所有者权益(基金净值)	70,374,041.17	5,029,171.76	75,403,212.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,581,222.83	3,581,222.83
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)	95,252,499.32	13,260,083.06	108,512,582.38
其中：1.基金申购款	238,431,404.92	21,920,391.14	260,351,796.06
2.基金赎回款	-143,178,905.60	-8,660,308.08	-151,839,213.68
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)	165,626,540.49	21,870,477.65	187,497,018.14

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

华宝兴业资源优选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业资源优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”)证监许可[2012]第 685 号《关于核准华宝兴业资源优选混合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《华宝兴业资源优选混合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 502,951,385.57 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字



(2012)第 316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 502,977,780.46 份基金份额,其中认购资金利息折合 26,394.89 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》,华宝兴业资源优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资源优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《华宝兴业资源优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,包括国内依法发行上市的 A 股股票(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、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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于资源相关股票的比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-40%,其中,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:  $80\% \times \text{中证内地资源主题指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

#### 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》、《华宝兴业资源优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 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售

股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

## 6.4.7 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	3,131,548.24	971,714.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,194,763.53	329,608.53

注：支付基金管理人 华宝兴业 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	521,924.74	161,952.38

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

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.8.3 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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 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	33,172,458.32	288,157.83	36,606,256.68	98,079.97

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月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	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.9.2 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
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项停牌	23.48	-	-	990,000	15,668,003.48	23,245,200.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 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 06 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 295,511,747.68 元，属于第二层次的余额为 23,368,883.10 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 321,551,458.19 元，第二层次 452,142.15 元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于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 06 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（2015 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	318,880,630.78	81.26
	其中：股票	318,880,630.78	81.26
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	33,413,488.59	8.51
7	其他各项资产	40,124,262.89	10.22
8	合计	392,418,382.26	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	194,223,130.11	50.20
C	制造业	98,722,512.62	25.51
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	25,927,348.43	6.70
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	318,880,630.78	82.41

### 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	601088	中国神华	990,000	23,245,200.00	6.01
2	601600	中国铝业	4,377,900	19,788,108.00	5.11
3	000983	西山煤电	2,235,601	19,606,220.77	5.07
4	600180	瑞茂通	1,230,818	17,280,684.72	4.47
5	601899	紫金矿业	5,017,605	17,210,385.15	4.45
6	601699	潞安环能	1,901,000	14,865,820.00	3.84
7	600348	阳泉煤业	2,183,888	14,806,760.64	3.83
8	000807	云铝股份	1,916,400	13,836,408.00	3.58
9	000630	铜陵有色	4,350,000	12,354,000.00	3.19
10	000603	盛达矿业	905,200	12,292,616.00	3.18

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](http://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	002155	湖南黄金	16,130,196.98	4.07
2	000937	冀中能源	13,569,219.34	3.42
3	601001	大同煤业	13,201,762.67	3.33
4	601600	中国铝业	12,114,333.00	3.05
5	600348	阳泉煤业	10,970,307.93	2.77
6	600547	山东黄金	10,794,280.00	2.72
7	600028	中国石化	10,480,939.00	2.64
8	600219	南山铝业	10,290,800.00	2.59
9	600392	盛和资源	9,917,107.00	2.50
10	000960	锡业股份	9,762,888.20	2.46
11	600362	江西铜业	9,592,965.21	2.42
12	600188	兖州煤业	9,410,015.00	2.37
13	600259	广晟有色	9,287,184.00	2.34
14	600256	广汇能源	8,949,009.00	2.26
15	002182	云海金属	8,305,598.50	2.09
16	601699	潞安环能	7,807,848.00	1.97
17	002378	章源钨业	7,736,363.40	1.95
18	600516	方大炭素	7,577,733.88	1.91
19	600549	厦门钨业	7,525,115.97	1.90
20	600123	兰花科创	7,509,949.95	1.89

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	000937	冀中能源	24,964,725.27	6.29
2	600123	兰花科创	18,277,203.02	4.61
3	000060	中金岭南	15,266,910.37	3.85
4	002203	海亮股份	14,422,320.68	3.64
5	600348	阳泉煤业	13,918,638.49	3.51
6	601001	大同煤业	13,121,436.23	3.31
7	000960	锡业股份	12,569,461.35	3.17
8	600259	广晟有色	11,964,554.39	3.02

9	600110	诺德股份	11,272,739.79	2.84
10	601699	潞安环能	9,823,090.36	2.48
11	002182	云海金属	9,650,385.81	2.43
12	600256	广汇能源	9,066,409.83	2.29
13	600547	山东黄金	9,040,096.03	2.28
14	600111	北方稀土	9,009,475.62	2.27
15	600395	盘江股份	8,994,350.98	2.27
16	600028	中国石化	8,624,808.22	2.17
17	600362	江西铜业	8,523,287.50	2.15
18	600366	宁波韵升	8,421,646.59	2.12
19	002378	章源钨业	7,651,377.77	1.93
20	000709	河钢股份	7,326,476.33	1.85

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	327,334,779.69
卖出股票收入（成交）总额	357,715,954.89

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

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

### 7.12.2

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	54,439.29
2	应收证券清算款	39,658,416.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-14,037.80
5	应收申购款	425,444.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,124,262.89

**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**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601088	中国神华	23,245,200.00	6.01	重大事项停牌

## § 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
15,903	18,413.13	45,403,373.22	15.51%	247,420,692.21	84.49%

### 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	439,349.59	0.1500%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月21日）基金份额总额	502,977,780.46
本报告期期初基金份额总额	318,494,628.24
本报告期基金总申购份额	141,049,200.64
减：本报告期基金总赎回份额	166,719,763.45
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	292,824,065.43

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

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：本基金合同生效之日（2012 年 8 月 21 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	
长江证券	1	107,789,487.71	15.81%	100,385.29	15.93%	-
海通证券	2	100,980,619.31	14.81%	92,588.96	14.70%	-
中泰证券	1	84,668,218.29	12.42%	78,850.84	12.52%	-
华创证券	2	82,660,275.67	12.12%	76,268.02	12.11%	-
兴业证券	2	73,842,513.21	10.83%	67,337.82	10.69%	-
广发证券	2	73,550,374.29	10.79%	68,397.23	10.86%	-
国金证券	2	32,389,296.34	4.75%	29,774.27	4.73%	-
国信证券	1	27,822,162.76	4.08%	25,910.57	4.11%	-
国泰君安	1	25,574,030.63	3.75%	23,816.92	3.78%	-
安信证券	2	25,425,712.84	3.73%	23,170.56	3.68%	-
申万宏源	2	14,081,913.00	2.07%	13,113.99	2.08%	-
招商证券	1	11,104,699.57	1.63%	10,119.70	1.61%	-
国海证券	2	7,234,466.05	1.06%	6,737.37	1.07%	-
西藏东方财富	1	4,351,284.27	0.64%	3,965.31	0.63%	-
浙商证券	2	3,935,407.08	0.58%	3,665.09	0.58%	-
中信建投	1	3,301,600.06	0.48%	3,074.81	0.49%	-
中金国际	2	2,993,066.12	0.44%	2,727.58	0.43%	-
光大证券	1	134,745.44	0.02%	122.79	0.02%	-
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：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

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如下：

申万宏源证券，宏信证券，华宝证券，安信证券。

### 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
长江证券	-	-	91,700,000.00	25.59%	-	-
海通证券	-	-	76,800,000.00	21.43%	-	-
中泰证券	-	-	44,400,000.00	12.39%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	28,800,000.00	8.04%	-	-
广发证券	-	-	36,800,000.00	10.27%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	40,500,000.00	11.30%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	39,400,000.00	10.99%	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
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