

# 上证 180 成长交易型开放式指数证券投资 基金 2016 年半年度报告 （摘要）

2016 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：2016 年 8 月 26 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 2016 年 8 月 23 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 2016 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	上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证 180 成长 ETF
场内简称	成长 ETF
基金主代码	510280
交易代码	510280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 4 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	43,754,441.00 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	2011-10-18

### 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 成长指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，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。

### 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-1,494,378.74
本期利润	-9,526,738.81
加权平均基金份额本期利润	-0.2004
本期加权平均净值利润率	-16.06%
本期基金份额净值增长率	-11.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	12,010,289.61
期末可供分配基金份额利润	0.2745
期末基金资产净值	55,764,730.61
期末基金份额净值	1.274
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	27.40%

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.78%	0.91%	-1.55%	0.95%	0.77%	-0.04%
过去三个月	-0.39%	0.92%	-1.33%	0.94%	0.94%	-0.02%
过去六个月	-11.77%	1.72%	-12.59%	1.74%	0.82%	-0.02%
过去一年	-23.16%	2.20%	-23.89%	2.23%	0.73%	-0.03%
过去三年	42.35%	1.83%	36.02%	1.85%	6.33%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	27.40%	1.65%	8.55%	1.69%	18.85%	-0.04%

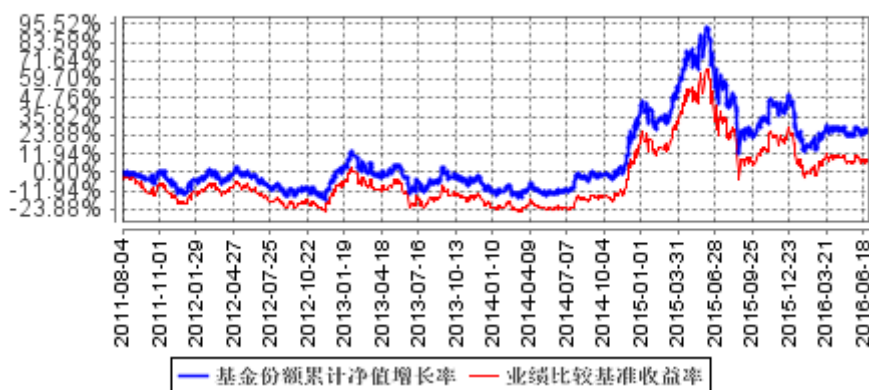
注：1、本基金业绩比较基准为：上证 180 成长指数。

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

（2011 年 8 月 4 日至 2016 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 2012 年 2 月 4 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（2016 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、新兴产业基金、可转债债券、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接、华宝油气基金、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、华宝兴业中国互联网、华宝兴业核心优势、华宝兴业转型升级、华宝标普美国消费、华宝宝鑫纯债及华宝香港中小，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 157,478,315,809.98 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		
胡洁	本基金基金经理、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、华宝兴业中证医疗指数分级、华宝兴业中证 1000 指数分级基金经理	2012 年 10 月 16 日	-	10 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任华宝兴业中证 1000 指数分级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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《上证 180 成长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。

由于股、债市的系统性风险和指数成分股的调整，上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金出现了持有不属于 180 成长成分股及其备选股的情况；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

2016 年上半年，A 股市场先抑后扬。年初由于市场对熔断机制的应对尚不成熟，出现了一轮恐慌性下跌行情，创下股灾来新低；2 月指数震荡筑底；随后在锂电池、白酒等热点板块的带动下，市场在 3 月至 4 月中旬走出一波较为明显的反弹；4 月下旬至 6 月市场进入窄幅震荡阶段。报告期内，锂电池、新能源汽车、白酒等板块表现活跃，军工、有色也走出过阶段性行情。指数方面，大盘蓝筹股指数整体表现强于中小盘股指数。其中以上证 180 成长指数和中证 100 指数为

代表的大盘蓝筹股指数在报告期分别下跌 12.59%和 12.65%，而以中小板指和创业板指为代表的小盘指数跌幅居前，同期跌幅分别为 17.88%和 17.92%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，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 1.274 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.77%，同期业绩比较基准收益率为-12.59%，超额收益率为 0.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年，中国 GDP 同比增长 6.7%，我国经济呈阶段性企稳态势，下半年经济仍有望趋稳。从财政支出、国债发行规模等指标和发改委对基建投资的支持力度看，政府通过积极财政政策维稳经济的意愿明显，社会融资和新增贷款的稳健增长也可以看出稳增长政策背景下，实体经济对信贷的需求有所转暖，而相应信贷政策的支持力度也相当明显。预计下半年国家将继续保持积极的财政政策和稳健的货币政策，其他产业政策也继续利好证券市场的长远发展。其他的风险因素，如美联储加息预期降低、英国脱欧公投的短期风险释放等，将有利于投资者的风险偏好提升。作为大盘蓝筹指数代表的上证 180 成长指数的估值目前处于历史底部区域，成份股具备低估值、高分红和业绩稳定等优势，为资金进入提供了较高的安全边际，将给投资者带来中长期的投资机会。

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 成长指数的有效跟踪。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金（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：上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,154,519.21	1,216,888.08
结算备付金		329.33	7,054.03
存出保证金		283.57	642.89
交易性金融资产		55,079,002.61	76,992,225.16
其中：股票投资		55,079,002.61	76,992,225.16
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		-	-
应收利息		219.45	263.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		56,234,354.17	78,217,073.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		80,942.96	46,628.88
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,725.14	32,191.82
应付托管费		4,545.06	6,438.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		47,855.78	143,872.74

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		313,554.62	355,408.03
负债合计		469,623.56	584,539.85
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		43,754,441.00	53,754,441.00
未分配利润		12,010,289.61	23,878,092.62
所有者权益合计		55,764,730.61	77,632,533.62
负债和所有者权益总计		56,234,354.17	78,217,073.47

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.274 元，基金份额总额 43,754,441.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-9,075,949.24	76,959,721.62
1.利息收入		3,749.36	7,929.00
其中：存款利息收入		3,749.36	7,929.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,047,338.53	135,573,687.53
其中：股票投资收益		-1,762,153.95	134,500,634.20
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		714,815.42	1,073,053.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-8,032,360.07	-58,711,010.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	89,115.75
<b>减：二、费用</b>		450,789.57	1,289,455.25

1. 管理人报酬		147,268.55	727,626.35
2. 托管费		29,453.78	145,525.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		25,380.65	136,396.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		248,686.59	279,907.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,526,738.81	75,670,266.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,526,738.81	75,670,266.37

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	53,754,441.00	23,878,092.62	77,632,533.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,526,738.81	-9,526,738.81
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）	-10,000,000.00	-2,341,064.20	-12,341,064.20
其中：1. 基金申购款	18,000,000.00	4,736,618.37	22,736,618.37
2. 基金赎回款	-28,000,000.00	-7,077,682.57	-35,077,682.57
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）	43,754,441.00	12,010,289.61	55,764,730.61
项目	上年度可比期间 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)	266,754,441.00	113,412,608.80	380,167,049.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,670,266.37	75,670,266.37
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)	-213,000,000.00	-153,715,229.40	-366,715,229.40
其中：1. 基金申购款	240,000,000.00	144,884,122.86	384,884,122.86
2. 基金赎回款	-453,000,000.00	-298,599,352.26	-751,599,352.26
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)	53,754,441.00	35,367,645.77	89,122,086.77

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>黄小薏</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

上证 180 成长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[2011]496 号《关于核准上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司作为管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 成长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 821,736,841.00 元(含募集股票市值)，业经安永华明会计师事务所安永华明(2011)验字第 60737318\_B02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 8 月 4 日生效，基金合同生效日的基金份额总额 821,754,441.00 份基金份额，其中认购资金利息折合为 17,600.00 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 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股(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、权证及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，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：上证 180 成长指数。

#### **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〉》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**

本基金 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

#### 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
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
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 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金	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。

## 6.4.8 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	147,268.55	727,626.35
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 0.5%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×0.5%/当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,453.78	145,525.22

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 0.1%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×0.1%/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自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自有资金投资本基金。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
华宝兴业上证 180 成长交易型 开放式指数证券 投资基金联接基 金	38,859,286.00	88.81%	44,734,686.00	83.22%

### 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国银行股份有限公司	1,154,519.21	3,594.92	1,442,331.29	6,589.17

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（2016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
600649	城投控股	2016年6月20日	重大事项停牌	14.36	-	-	27,900	509,426.57	400,644.00	-

注：本基金截至 2016 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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 54,678,358.61 元，属于第二层次的余额为 400,644.00 元，无属于第三层次的余额(于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 74,562,465.16 元，属于第二层次的余额为 2,429,760.00 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。

(2) 除公允价值外，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	55,079,002.61	97.95
	其中：股票	55,079,002.61	97.95
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	1,154,848.54	2.05
7	其他各项资产	503.02	0.00
8	合计	56,234,354.17	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	10,860,586.51	19.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	984,141.00	1.76
E	建筑业	1,491,196.00	2.67

F	批发和零售业	200,772.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	604,402.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,930,570.50	3.46
J	金融业	35,819,880.84	64.23
K	房地产业	3,187,453.76	5.72
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	55,079,002.61	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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 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	601318	中国平安	194,634	6,236,073.36	11.18
2	600016	民生银行	441,800	3,945,274.00	7.07
3	601166	兴业银行	249,200	3,797,808.00	6.81
4	600036	招商银行	192,718	3,372,565.00	6.05
5	600519	贵州茅台	9,352	2,730,035.84	4.90
6	600000	浦发银行	161,590	2,515,956.30	4.51
7	600030	中信证券	147,100	2,387,433.00	4.28
8	600837	海通证券	151,200	2,331,504.00	4.18

9	601169	北京银行	189,460	1,964,700.20	3.52
10	600887	伊利股份	113,300	1,888,711.00	3.39

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

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	601318	中国平安	1,279,393.00	1.65
2	600000	浦发银行	940,871.00	1.21
3	601377	兴业证券	762,401.20	0.98
4	600958	东方证券	534,191.00	0.69
5	600066	宇通客车	486,858.79	0.63
6	600061	国投安信	356,077.00	0.46
7	600446	金证股份	326,162.00	0.42
8	600074	保千里	247,652.00	0.32
9	601198	东兴证券	235,134.00	0.30
10	601166	兴业银行	220,842.00	0.28
11	600704	物产中大	205,164.00	0.26
12	601872	招商轮船	192,238.00	0.25
13	600036	招商银行	184,196.00	0.24
14	600565	迪马股份	176,368.00	0.23
15	600048	保利地产	172,288.00	0.22
16	600519	贵州茅台	153,209.00	0.20
17	601155	新城控股	153,065.00	0.20
18	600016	民生银行	143,326.78	0.18
19	600837	海通证券	128,138.00	0.17
20	600030	中信证券	127,943.00	0.16

注：买入金额不包括相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601318	中国平安	1,178,073.00	1.52
2	600016	民生银行	947,634.00	1.22
3	600000	浦发银行	703,725.00	0.91
4	601377	兴业证券	566,351.08	0.73
5	600690	青岛海尔	546,516.30	0.70
6	600703	三安光电	468,798.00	0.60
7	600029	南方航空	463,224.50	0.60
8	600383	金地集团	463,025.00	0.60
9	600867	通化东宝	368,800.16	0.48
10	600583	海油工程	290,640.00	0.37
11	600332	白云山	247,690.00	0.32
12	600637	东方明珠	247,167.00	0.32
13	601633	长城汽车	190,667.44	0.25
14	600633	浙报传媒	183,336.00	0.24
15	600325	华发股份	136,860.00	0.18
16	600823	世茂股份	109,807.51	0.14
17	600185	格力地产	96,197.20	0.12
18	600340	华夏幸福	91,650.00	0.12
19	601166	兴业银行	76,246.00	0.10
20	600519	贵州茅台	64,166.65	0.08

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	8,614,820.91
卖出股票收入（成交）总额	8,214,342.84

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

中信证券于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会调查通知书，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查；于 2016 年 3 月 16 日收到中国证券监督管理委员会福建监管局《关于对中信证券股份有限公司泉州宝洲路证券营业部采取出具警示函措施的决定》，因公司营业部存在员工违规为客户融资提供便利的问题，决定对营业部采取出具警示函的监督管理措施。

海通证券于 2015 年 8 月 24 日收到中国证券监督管理委员会调查通知书，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证

监会决定对公司进行立案调查，于 2015 年 9 月 10 日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书，给予警告并责令其改正，没收违法所得同时处以罚款；于 2015 年 9 月 12 日收到中国证监会行政处罚事先告知书，因公司对第三方交易终端软件未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，未按要求采集客户交易终端信息，情节严重，决定对相关责任人以及公司予以警告处罚，并进行罚款；于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会调查通知书。因公司因在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

招商银行于 2016 年 1 月 9 日收到吉林证监局《关于对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定》。由于吉林省分行在从业人员的资格，销售材料，业务流程等多项内容上存在问题，现要求对上述行为进行改正。

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 成长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	283.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	219.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	503.02

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。



### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票。

## §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		180 成长联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
375	116,678.51	39,629,449.00	90.57%	4,124,992.00	9.43%	38,859,286.00	88.81%

### 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	中信证券股份有限公司	461,272.00	1.05%
2	陈滨	300,000.00	0.69%
3	李晓青	240,000.00	0.55%
4	夏爱萍	198,620.00	0.45%
5	中信证券股份有限公司	148,100.00	0.34%
6	洪长运	122,800.00	0.28%
7	北京康维安管理咨询有限公司	113,100.00	0.26%
8	陈偶生	101,000.00	0.23%
9	黄道旭	90,000.00	0.21%
10	刘炜	80,000.00	0.18%
11	华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金	38,859,286.00	88.81%

### 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（2011年8月4日）基金份额总额	821,754,441.00
本报告期期初基金份额总额	53,754,441.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	28,000,000.00
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	43,754,441.00

### §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

本报告期内，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

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：会计事务所变更之日（2015 年 12 月 15 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，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
中泰证券	1	16,829,163.75	100.00%	15,672.94	100.00%	-
国信证券	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，并能为本基金提供全面的信息服；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、本基金本报告期券商交易单元数量未变更。

3、齐鲁证券更名为中泰证券。

### 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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

华宝兴业基金管理有限公司  
2016 年 8 月 26 日