

# 上证 180 成长交易型开放式指数证券投资 基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	41,754,441.00 份
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、法律法规限制等）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。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	517,472.07
2. 本期利润	2,504,751.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0588
4. 期末基金资产净值	55,598,259.84
5. 期末基金份额净值	1.332

注：1. 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。

2. 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。

#### 3.2 基金净值表现

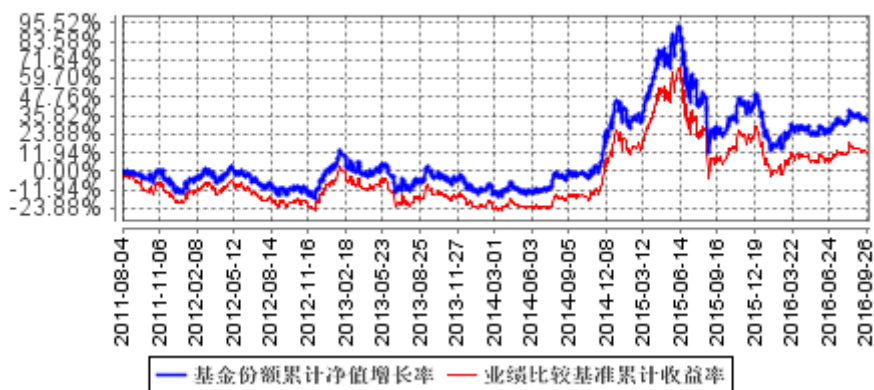
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	4.55%	0.76%	3.67%	0.77%	0.88%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 9 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 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、华宝兴业中证军工 ETF 基金经理	2012 年 10 月 16 日	-	10 年	金融学硕士、量化投资部总经理助理。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 月起任华宝兴业上证 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。2016 年

					8 月起兼任华宝兴业中证军工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。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度国内经济维持弱势筑底态势，8 月发电耗煤量、粗钢生产、高炉开工、房地产销售、汽车销量等保持较好，8 月 PMI 为 50.4 重返荣枯线上方，9 月 PMI 与 8 月保持持平，制造业回暖迹象得到巩固，供给侧改革出阶段性、局部性成果隐约可见。但经济复苏呈现出结构性分化的特征，大型制造企业的生产恢复状况优于中小型企业，经济底部有待进一步夯实。8 月 CPI 同比涨幅 1.3%，低于市场整体预期，但温和的通胀水平也为宽松货币的环境提供支持。美

联储 9 月再次做出不加息的决定，短期国际市场的流动性不会收紧，有助于提升市场对风险资产的偏好。市场表现方面，A 股市场三季度整体呈现窄幅震荡格局，市场波动较小，量能继续维持缩减。指数方面，市场风格分化明显，以沪深 300 和上证 50 指数为代表的大盘蓝筹股指数表现较强，三季度分别上涨了 3.15%和 2.58%，而以创业板和中小板指数为代表的中小市值股票指数表现相对较弱，分别下跌了 3.5%和 1.58%。在本报告期内，上证 180 成长指数累计上涨了 3.67%。

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

#### 4.5 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 1.332 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.55%，同期业绩比较基准收益率为 3.67%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	55,067,970.88	98.01
	其中：股票	55,067,970.88	98.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,117,913.70	1.99
8	其他资产	980.39	0.00

9	合计	56,186,864.97	100.00
---	----	---------------	--------

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	10,777,742.97	19.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	958,797.00	1.72
E	建筑业	1,667,134.00	3.00
F	批发和零售业	213,310.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	631,428.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,770,141.00	3.18
J	金融业	35,678,223.45	64.17
K	房地产业	3,371,194.46	6.06
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	55,067,970.88	99.05

### 5.2.2 报告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。

### 5.2.3 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。

## 5.3 报告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

### 5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	------	-------	---------	---------

					比例 (%)
1	601318	中国平安	168,234	5,746,873.44	10.34
2	600016	民生银行	424,900	3,934,574.00	7.08
3	601166	兴业银行	240,000	3,832,800.00	6.89
4	600036	招商银行	185,518	3,339,324.00	6.01
5	600519	贵州茅台	9,052	2,696,681.32	4.85
6	600000	浦发银行	155,490	2,564,030.10	4.61
7	600837	海通证券	145,400	2,313,314.00	4.16
8	600030	中信证券	141,500	2,280,980.00	4.10
9	601169	北京银行	218,852	1,991,553.20	3.58
10	600887	伊利股份	108,800	1,752,768.00	3.15

### 5.3.2 报告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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

### 5.4 报告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投资。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5.6 报告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。

### 5.7 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投资。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。



## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

上证 180 成长 ETF 基金截至 2016 年 9 月 30 日前十名证券中的中信证券（600030）于 2015 年 11 月 26 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。

中信证券（600030）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，决定营业部采取出具警示函的监督管理措施。

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。

上证 180 成长 ETF 基金截至 2016 年 9 月 30 日前十名证券中的海通证券（600837）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。

上证 180 成长 ETF 基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）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，并于 2016 年 1 月 31 日前，向吉林证监局提交整改情况的书面报告，并等待检查验收。

上证 180 成长 ETF 基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的民生银行（600016）于 2016 年 8 月 11 日收到北京证监局向公司下发监管关注函（京证监发 2016（175））《关于对中国民生银行股份有限公司的监管关注函》，要求民生银行完善公司治理结构，尽快落实独立董事的选举。

民生银行（600016）于 2016 年 7 月 26 日收到上海证券交易所下发监管工作函（上证公函[2016]0879 号）《关于中国民生银行股份有限公司加强规范运作的监管工作函》，对公司加强规范运作事项提出监管要求。

民生银行（600016）于 2016 年 7 月 25 日收到中国证券投资基金业协会向加银资管下发纪律处分决定书（中基协处分〔2016〕5 号），加银资管部分资产管理计划违规开展资金池业务，违反了中国证监会《关于进一步加强基金管理公司及其子公司从事特定客户资产管理业务风险管理的通知》和《证券期货经营机构落实资产管理业务“八条底线”禁止行为细则（2015 年 3 月版）》等相关规定。采取暂停受理加银资管资产管理计划备案 6 个月，并责令清理资金池业务的行政监管措施。

民生银行（600016）于 2016 年 7 月 19 日收到上海证券交易所于向公司下发监管工作函（上证公函[2016]0861 号）《关于中国民生银行股份有限公司股东增持事项的监管工作函》，要求公司督促股东披露增持公司股份有关事项。

民生银行（600016）于 2016 年 5 月 17 日收到中国证监会向加银资管下发行行政监管措施决定书（〔2016〕49 号）《关于对民生加银资产管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，对加银资管部分资产管理计划较高比例投资于非标资产，但却每周开放申购赎回，违反了《基

金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》相关规定。对此 采取责令改正、并暂停办理加银资管特定客户资产管理计划备案 3 个月的行政监管措施。

民生银行（600016）于 2016 年 4 月 18 日收到深圳证监局向加银基金下发行政监管措施决定书（（2016）22 号）《深圳证监局关于对民生加银基金管理有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》，因中国信息安全测评中心出具的《民生加银基金信息系统渗透测试报告》显示加银基金存在多项信息安全漏洞，违反了《证券期货业信息安全保障管理办法》相关规定，深圳证监局决定采取出具警示函的行政监管措施。

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六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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	761.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	219.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	980.39

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600887	伊利股份	1,752,768.00	3.15	临时停牌

#### 5.11.5.2 报告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的股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	43,754,441.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	2,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	41,754,441.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

## 8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

## 8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司  
2016 年 10 月 25 日