

# 华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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 3 月 28 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 3 月 24 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52

8.8 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 .....	52
8.9 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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
9.3 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 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
11.2 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 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新价值混合
基金主代码	001324
交易代码	001324
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月1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	894,347,481.41份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益类投资工具，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股</p>

	<p>指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。</p> <p>7、其他金融工具投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标,制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p>
业绩比较基准	1 年期银行定期存款基准利率(税后)+3%
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
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		郑安国	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道100号环球金融中心58楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年 6 月 1 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	37,122,513.27	29,825,955.85
本期利润	24,258,597.00	36,089,641.45
加权平均基金份额本期利润	0.0331	0.0128
本期加权平均净值利润率	3.21%	1.28%
本期基金份额净值增长率	3.70%	1.45%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	46,495,755.31	24,764,411.79
期末可供分配基金份额利润	0.0520	0.0108
期末基金资产净值	940,843,236.72	2,335,710,920.34
期末基金份额净值	1.0520	1.0145
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	5.20%	1.45%

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
过去三个月	0.13%	0.10%	1.13%	0.02%	-1.00%	0.08%
过去六个月	1.40%	0.08%	2.27%	0.01%	-0.87%	0.07%
过去一年	3.70%	0.07%	4.51%	0.01%	-0.81%	0.06%
自基金合同生效日起至 今	5.20%	0.06%	7.33%	0.01%	-2.13%	0.05%

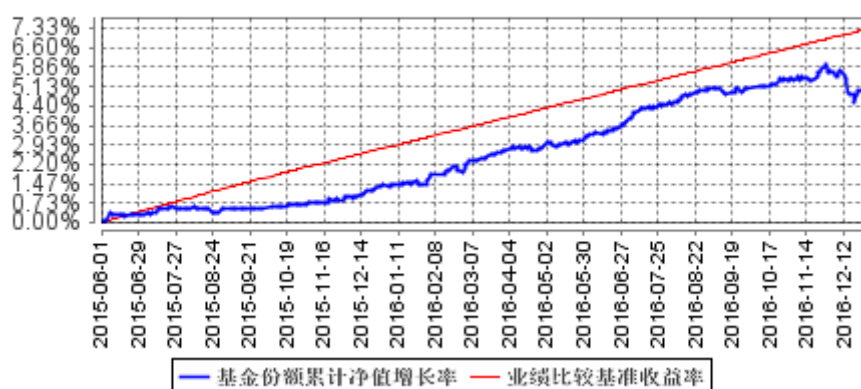
注：1、本基金业绩比较基准为：1年期银行定期存款基准利率（税后）+3%。

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

(2015年6月1日至2016年12月31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

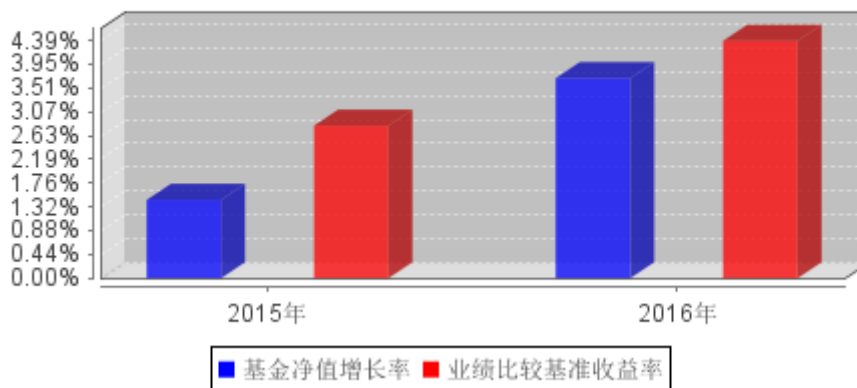


注：按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 1 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 6 月 1 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于 2015 年 6 月 1 日，基金成立至今未进行利润分配。

## § 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（2016 年 12 月 31 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、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、未来产业主导基金和新起点基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 119,691,851,523.98 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		
夏林锋	本基金基金经理、华宝大盘精选混合、华宝生态中国混合、华宝未来主导混合基金经理	2015年6月1日	-	6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月兼任华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金经理，2015年6月起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。
李栋梁	固定收益部副总经理。本基金基金经理、华宝兴业宝康债券、华宝兴业增强收益债券、华宝新机遇混合、华宝兴业可转债债券、华宝宝鑫债券、华宝新活力混合、华宝新起点	2015年10月16日	-	13年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资，2010年9月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师，2010年12月至2011年6月任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理助理，2011年6月起担任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理，2014年10月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015年10月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金

	混合基金 经理				(LOF) 和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 4 月兼任华宝兴业宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016 年 5 月任固定收益部副总经理。2016 年 6 月兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月兼任华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林昊	本基金基金经理助理、华宝添益、华宝兴业现金宝货币、华宝新机遇混合基金经理助理	2016 年 5 月 23 日	-	10 年	本科。2006 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任渠道经理、市场支持经理、行政经理、交易员、高级交易员等职务。2014 年 6 月任华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理助理。2016 年 5 月任华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。
梅峻玺	本基金基金经理助理、华宝兴业增强收益债券、华宝新机遇混合基金经理助理	2015 年 6 月 4 日	2016 年 8 月 4 日	6 年	硕士。曾在长江证券研究部从事研究工作。2011 年 2 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任研究部高级分析师。2015 年 3 月至 2016 年 8 月担任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 8 月兼任华宝兴业新机遇灵活配

					置混合型证券投资基金（LOF）和华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
王炜	本基金基金经理助理、华宝新机遇混合基金经理助理	2015年6月4日	-	4年	本科。2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任机构投资部投资经理、研究部分析师。2015年6月任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）和华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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。

3、基金管理人于2017年3月17日发布公告，增聘林昊先生为本基金基金经理，夏林锋先生不再担任本基金基金经理。

## 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、《华宝兴业新价值灵活配置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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策

的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 1-12 月份，固定资产投资完成额同比增长 8.1%，1 季度固定资产投资增速微幅反弹，2-3 季度固定资产投资增速持续下滑，4 季度固定资产投资增速企稳。分行业来看，制造业投资完成额同比增速年初以来持续下滑，4 季度小幅反弹至 4.2%，房地产开发投资完成额同比增速大幅上升提升至 6.9%，1 季度房地产开发投资增速持续上升，2 季度后期房地产开发投资增速转为下降，3-4 季度相对稳定；基建投资增速维持在 20%左右，4 季度基建投资增速略有下滑。1-12 月份出口金额同比下降 7.7%，出口增速依然无起色；1-12 月份进口金额同比下滑 5.5%，进口增速 4 季度有所改观，和国内经济 4 季度企稳较一致。1-12 月份社会消费品零售总额同比增长 10.4%，名义和实际消费增速略有下滑。物价水平 1 季度上升，2-3 季度下降，4 季度再度上升，12 月份 CPI 为 2.1%，1-12 月份物价水平上涨 2.0%。上半年央行维持相对宽松的货币政策，3 季度开始央行货币政策出现收紧的信号，4 季度央行货币政策开始收紧，尤其是中央经济工作会议明确 2017 年的重要任务是防风险、去杠杆后，央行将利率走廊的利率平均提升了 10 个 BP。在经济数据企稳的情况下，央行为了降低资金在金融体系空转套利带来的潜在风险，开始针对金融体系进行去杠杆的操作，央行去杠杆、防风险的措施和力度是后期影响债券市场的重要因素。前 3 个季度货币信贷、社会融资总量较为稳定，4 季度信贷和社会融资总量超过预期，其中房贷总量依然维持在高位，而表外融资也有恢复的迹象，这和经济数据较为一致。

2016 年债券市场波动较大，1 季度债券市场小幅上涨；4 月份，随着违约的不断增多以及税收的相关传闻，高风险债券收益率大幅上行，投资者撤离债券市场导致所有债券收益率短期出现快速上行；6 月份到 3 季度末，债券市场再度走牛，其中低等级信用债表现最好；10 月底，货币市场收益率开始上行，央行货币政策也开始转向，债券市场持续下跌，尤其是 12 月份中旬，资金紧张叠加代持事件引发的信任危机，债券再度大跌。全年来看，因债券收益率上升较多，债券基金业绩都较为惨淡。

2016 年股票市场波动也非常大，年初股票快速下跌叠加熔断的虹吸效应，股票大幅快速下跌，期间虽然经历几次反弹，但是 1-2 月份股票下跌幅度非常惊人。3 月份及以后，股票市场的波动大幅下降，市场慢慢修复，各种主题类股票轮流表现，3 月份到年底股票整体表现还不错，其中受益于供给侧改革的部分行业表现不错，期间其他行业也有表现，总体来看，各个行业的持续性均不是太强，主板股票表现好于中小板和创业板。

可转债和股市的表现一样，年初可转债因存量较少，估值都非常高，随着股票的持续下跌和新增供给的放量，可转债大幅下跌。2 季度可转债也没有好的表现，3 季度到 12 月份中，可转债整体表现才跟随股票开始好转，年末受到债券大跌的影响，可转债作为流动性较好的品种，短期也快速下跌，转债估值快速压缩至历史平均水平。

2016 年新价值混合型基金不断提高股票的配置比例，4 季度降低了债券的投资比例，降低了债券下跌带来的不利影响。2016 年新价值混合型基金始终积极参与新股网下申购来提高收益。本基金始终坚持绝对收益的投资目标。

#### 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 3.70%，同期业绩比较基准收益率为 4.51%，基金表现落后业绩比较基准 0.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期经济出现企稳信号，但是隐忧仍然存在。从拉动经济增长的三驾马车来看，受益于全球经济边际改善，净出口 2017 年有望改善，从而减少对 GDP 的拖累。国内消费和投资均有隐忧。汽车消费增速可能大幅下降，同时居民收入增速放缓也会拖累实际消费增速。地产调控之后房地产销售增速可能再度下滑，从而影响房地产固定资产投资增速，制造业增速短期有所反弹，但持续性存疑；基建增速依赖政府。从政策来看，央行提高公开市场操作利率导致债券收益率大幅度上行，这会降低债券融资净规模，同时提高融资成本；持续紧缩的货币政策也可能滞后影响实体经济。2017 年经济增速可能前高后低，总体增速可能微幅下降。从物价水平来看，供给侧改革导致大宗商品价格大涨，PPI 大幅上升，但是终端消费品价格上升较小，2017 年物价水平中枢可能较去年小幅上行。

债券市场自 2016 年 10 月底以来大幅调整，各品种、期限收益率上升 120 个 BP 左右。从基本面情况来看，2017 年经济仍无起色、通胀水平不高，因此债券收益率缺乏继续大幅上行的基础，债券市场的调整接近尾声。对债券市场来说，不确定的是央行到底还会采取何种措施来去杠杆，措施实施的时间和力度如何；若去杠杆的措施非常激烈，也可能导致债券市场继续出现短期快速调整。对于投资人来说，需要高度关注经济基本面的信息，若经济再度下行，相应的央行紧缩政策的力度也会降低，这将带来债券交易性机会。对于信用类债券，仍然需要防止信用风险的发生，投资人需要仔细对个券进行甄别。股票市场的波动太大，行业波动也很大，投资人需要根据市场变化调整股票投资策略。可转债的估值回到了历史平均水平，从绝对价格来看，可转债的安全性

还不算高，攻击性也不算强，因此个券的选择和时机的选择更加重要。总得来说市场依然存在不确定性，我们会高度关注经济和政策的变化，分析其对大类资产配置的影响，以改善业绩。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人承诺书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2016 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、根据监管要求开展了涉及投资、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.9 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”）在华宝兴业新价值灵活配置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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20032 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华宝兴业新价值基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是华宝兴业新价值基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政</p>

	策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。	
	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述华宝兴业新价值基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了华宝兴业新价值基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	曹阳
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 邮政编码 200120	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	69,405,522.20	275,827,225.28
结算备付金		986,363.64	53,145,238.10
存出保证金		20,597.99	48,575.57
交易性金融资产	7.4.7.2	489,769,190.29	640,407,000.69
其中：股票投资		82,205,913.29	38,626,000.69
基金投资		-	-
债券投资		407,563,277.00	601,781,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	376,552,214.83	815,800,000.00
应收证券清算款		11,656.53	569,613,277.88
应收利息	7.4.7.5	5,190,092.99	3,934,195.24

应收股利		-	-
应收申购款		-	9.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		941,935,638.47	2,358,775,522.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		32,681.21	20,916,729.13
应付管理人报酬		296,208.87	1,200,939.93
应付托管费		123,420.33	500,391.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	150,091.34	181,626.53
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	490,000.00	264,915.19
负债合计		1,092,401.75	23,064,602.41
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	894,347,481.41	2,302,398,630.69
未分配利润	7.4.7.10	46,495,755.31	33,312,289.65
所有者权益合计		940,843,236.72	2,335,710,920.34
负债和所有者权益总计		941,935,638.47	2,358,775,522.75

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0520 元，基金份额总额 894,347,481.41 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月1日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日
一、收入		31,354,417.41	53,192,272.45

1. 利息收入		20,226,283.00	21,963,580.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,983,199.50	9,418,124.47
债券利息收入		16,956,342.89	1,144,086.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,286,740.61	11,401,369.53
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,743,221.65	14,993,263.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	20,685,801.88	12,900,999.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	242,020.37	955,862.68
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	815,399.40	1,136,401.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-12,863,916.27	6,263,685.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,248,829.03	9,971,742.55
<b>减：二、费用</b>		7,095,820.41	17,102,631.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,550,600.54	12,249,388.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,896,083.49	4,141,522.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	166,526.99	296,137.88
5. 利息支出		101,112.57	132,494.27
其中：卖出回购金融资产支出		101,112.57	132,494.27
6. 其他费用	7.4.7.20	381,496.82	283,088.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		24,258,597.00	36,089,641.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		24,258,597.00	36,089,641.45

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	2,302,398,630.69	33,312,289.65	2,335,710,920.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,258,597.00	24,258,597.00
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）	-1,408,051,149.28	-11,075,131.34	-1,419,126,280.62
其中：1. 基金申购款	396,487,006.24	20,222,632.76	416,709,639.00
2. 基金赎回款	-1,804,538,155.52	-31,297,764.10	-1,835,835,919.62
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）	894,347,481.41	46,495,755.31	940,843,236.72
项目	上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31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）	1,951,656,311.50	-	1,951,656,311.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,089,641.45	36,089,641.45
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）	350,742,319.19	-2,777,351.80	347,964,967.39
其中：1. 基金申购款	2,850,831,207.87	8,789,478.31	2,859,620,686.18
2. 基金赎回款	-2,500,088,888.68	-11,566,830.11	-2,511,655,718.79
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）	2,302,398,630.69	33,312,289.65	2,335,710,920.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]第 799 号《关于准予华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华宝兴业新价值灵活配置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 1,951,610,868.52 元,业经安永华明中天会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 60737318\_B22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,951,656,311.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 45,442.98 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《华宝兴业新价值灵活配置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股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益品种和货币市场工具(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、大额存单等)、股指期货、权证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相关规定)。本基金的股票投资比例不低于基金资产的 0%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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:1 年期银行定期存款基准利率(税后)+3%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 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》、《华宝兴业新价值灵活配置混合

型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。



#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	29,405,522.20	75,827,225.28
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	40,000,000.00	200,000,000.00
合计：	69,405,522.20	275,827,225.28

注：其他存款为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	83,373,548.59	82,205,913.29	-1,167,635.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,969,940.20	8,806,277.00
	银行间市场	404,025,932.17	398,757,000.00
	合计	412,995,872.37	407,563,277.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	496,369,420.96	489,769,190.29	-6,600,230.67
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	33,047,001.50	38,626,000.69	5,578,999.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	652,000.00	652,000.00
	银行间市场	600,444,313.59	601,129,000.00
	合计	601,096,313.59	601,781,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	634,143,315.09	640,407,000.69	6,263,685.60

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	20,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	356,552,214.83	-
合计	376,552,214.83	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	815,800,000.00	-
合计	815,800,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	2,878.53	221,111.36
应收定期存款利息	396,800.00	144,444.48
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	488.29	26,306.94
应收债券利息	4,702,608.50	3,199,333.91
应收买入返售证券利息	69,307.48	342,974.46
应收申购款利息	17,999.96	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	10.23	24.09
合计	5,190,092.99	3,934,195.24

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	140,627.24	175,288.83
银行间市场应付交易费用	9,464.10	6,337.70
合计	150,091.34	181,626.53

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	14,915.19
预提费用	490,000.00	250,000.00
合计	490,000.00	264,915.19

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,302,398,630.69	2,302,398,630.69
本期申购	396,487,006.24	396,487,006.24
本期赎回（以“-”号填列）	-1,804,538,155.52	-1,804,538,155.52
本期末	894,347,481.41	894,347,481.41

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,764,411.79	8,547,877.86	33,312,289.65
本期利润	37,122,513.27	-12,863,916.27	24,258,597.00
本期基金份额交易	-8,236,110.71	-2,839,020.63	-11,075,131.34



产生的变动数			
其中：基金申购款	23,485,316.54	-3,262,683.78	20,222,632.76
基金赎回款	-31,721,427.25	423,663.15	-31,297,764.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,650,814.35	-7,155,059.04	46,495,755.31

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	439,552.70	4,366,309.27
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,435,011.07	4,113,194.48
结算备付金利息收入	89,623.21	858,547.34
其他	19,012.52	80,073.38
合计	1,983,199.50	9,418,124.47

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	42,680,427.86	91,512,893.38
减：卖出股票成本总额	21,994,625.98	78,611,893.62
买卖股票差价收入	20,685,801.88	12,900,999.76

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,413,486,908.73	5,670,163.88
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	1,396,563,353.59	4,712,000.00

减：应收利息总额	16,681,534.77	2,301.20
买卖债券差价收入	242,020.37	955,862.68

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	815,399.40	1,136,401.40
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	815,399.40	1,136,401.40

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-12,863,916.27	6,263,685.60
——股票投资	-6,746,634.49	5,578,999.19
——债券投资	-6,117,281.78	684,686.41
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-12,863,916.27	6,263,685.60

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,241,206.32	8,686,381.99
转换费收入	7,622.71	1,285,360.56
合计	2,248,829.03	9,971,742.55

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于 30 日的投资人的赎回费全额计入基金资产，对持续持有期少于 3 个月的投资人，应将不低于赎回费总额 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，应将不低于赎回费总额 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	154,801.99	292,837.88
银行间市场交易费用	11,725.00	3,300.00
合计	166,526.99	296,137.88

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	240,000.00	170,000.00

银行汇划费用	25,496.82	29,688.07
债券帐户维护费	36,000.00	3,000.00
开户费	-	400.00
合计	381,496.82	283,088.07

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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》(财税[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。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。

## 7.4.9 关联方关系

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	受宝武集团控制的公司

务”)	
-----	--

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、宝武集团由原宝钢集团有限公司和武汉钢铁(集团)公司联合重组而成，于 2016 年 12 月 1 日正式成立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 1 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,550,600.54	12,249,388.19
其中：支付销售机构的客户维护费	616,153.04	899,264.56

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 0.60%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 X 0.60% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 1 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,896,083.49	4,141,522.59

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	254,800,000.00	117,082.69

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年6月1日(基金合同生效日)至2015年12月31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	29,405,522.20	439,552.70	75,827,225.28

注：本基金的活期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。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比较期均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

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。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和监察稽核部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估



测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行；定期存款存放在具有基金托管资格的江苏银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	30,033,000.00	120,500,000.00
A-1 以下	-	480,629,000.00
未评级	159,575,000.00	-
合计	189,608,000.00	601,129,000.00

注：未评级债券为政策性金融债券、同业存单和超短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	159,207,000.00	-
AAA 以下	8,806,277.00	652,000.00
未评级	49,942,000.00	-
合计	217,955,277.00	652,000.00

注：未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不

计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	69,405,522.20	-	-	-	69,405,522.20
结算备付金	986,363.64	-	-	-	986,363.64
存出保证金	20,597.99	-	-	-	20,597.99
交易性金融资产	247,584,002.00	159,979,275.00	-	82,205,913.29	489,769,190.29
买入返售金融资产	376,552,214.83	-	-	-	376,552,214.83
应收证券清算款	-	-	-	11,656.53	11,656.53
应收利息	-	-	-	5,190,092.99	5,190,092.99
资产总计	694,548,700.66	159,979,275.00	-	87,407,662.81	941,935,638.47
负债					

应付赎回款	-	-	-	32,681.21	32,681.21
应付管理人报酬	-	-	-	296,208.87	296,208.87
应付托管费	-	-	-	123,420.33	123,420.33
应付交易费用	-	-	-	150,091.34	150,091.34
其他负债	-	-	-	490,000.00	490,000.00
负债总计	-	-	-	1,092,401.75	1,092,401.75
利率敏感度缺口	694,548,700.66	159,979,275.00	-	86,315,261.06	940,843,236.72
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	275,827,225.28	-	-	-	275,827,225.28
结算备付金	53,145,238.10	-	-	-	53,145,238.10
存出保证金	48,575.57	-	-	-	48,575.57
交易性金融资产	601,129,000.00	-	652,000.00	38,626,000.69	640,407,000.69
买入返售金融资产	815,800,000.00	-	-	-	815,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	569,613,277.88	569,613,277.88
应收利息	-	-	-	3,934,195.24	3,934,195.24
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
资产总计	1,745,950,038.95	-	652,000.00	612,173,483.80	2,358,775,522.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,916,729.13	20,916,729.13
应付管理人报酬	-	-	-	1,200,939.93	1,200,939.93
应付托管费	-	-	-	500,391.63	500,391.63
应付交易费用	-	-	-	181,626.53	181,626.53
其他负债	-	-	-	264,915.19	264,915.19
负债总计	-	-	-	23,064,602.41	23,064,602.41
利率敏感度缺口	1,745,950,038.95	-	652,000.00	589,108,881.39	2,335,710,920.34

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 市场利率下降 25个基点	1,645,829.83	-
2. 市场利率上升 25个基点	-1,631,683.96	-	

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算利率风险对基金资产净值的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	82,205,913.29	8.74	38,626,000.69	1.65
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	82,205,913.29	8.74	38,626,000.69	1.65

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 8.74% (2015 年 12 月 31 日：1.65%)，因此除市场利率和外汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14 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 12 月 31 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 81,968,218.28 元，第二层次的余额为 407,800,972.01 元，无属于第三层次的余额 (2015 年 12 月 31 日：第一层次 26,363,400.69 元，第二层次 614,043,600.00 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 2016 年 12 月 31 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) 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	82,205,913.29	8.73
	其中：股票	82,205,913.29	8.73
2	固定收益投资	407,563,277.00	43.27
	其中：债券	407,563,277.00	43.27
	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	376,552,214.83	39.98
	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	70,391,885.84	7.47
7	其他各项资产	5,222,347.51	0.55
8	合计	941,935,638.47	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,848,513.46	1.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,984,362.60	1.49
E	建筑业	15,592.23	0.00
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	46,900,580.00	4.98
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	9,456,865.00	1.01
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	82,205,913.29	8.74

### 8.2.2 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。

## 8.3 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

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	601398	工商银行	3,280,000	14,464,800.00	1.54
2	600900	长江电力	1,104,610	13,984,362.60	1.49
3	601939	建设银行	2,250,000	12,240,000.00	1.30
4	000858	五粮液	330,000	11,378,400.00	1.21
5	601288	农业银行	3,310,000	10,261,000.00	1.09
6	000001	平安银行	1,080,000	9,828,000.00	1.04
7	000069	华侨城 A	1,360,700	9,456,865.00	1.01
8	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
9	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
10	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
11	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
12	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
13	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
14	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
15	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
16	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
17	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
18	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
19	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
20	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
21	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
22	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600900	长江电力	14,288,249.40	0.61
2	601939	建设银行	11,955,000.00	0.51
3	000001	平安银行	10,851,680.00	0.46
4	601288	农业银行	10,629,000.00	0.46
5	000069	华侨城 A	9,738,534.00	0.42
6	000858	五粮液	6,078,657.50	0.26
7	601398	工商银行	4,450,000.00	0.19

8	600909	华安证券	256,169.24	0.01
9	603858	步长制药	244,195.60	0.01
10	603377	东方时尚	113,750.40	0.00
11	601900	南方传媒	112,559.06	0.00
12	601375	中原证券	106,780.00	0.00
13	601997	贵阳银行	86,097.09	0.00
14	002791	坚朗五金	83,885.73	0.00
15	002831	裕同科技	81,592.63	0.00
16	600977	中国电影	80,065.92	0.00
17	603608	天创时尚	78,341.20	0.00
18	002797	第一创业	77,459.20	0.00
19	603556	海兴电力	75,285.18	0.00
20	603919	金徽酒	72,247.76	0.00

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 8.4.2 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	000002	万科 A	9,668,989.89	0.41
2	000858	五粮液	4,259,056.80	0.18
3	601398	工商银行	3,138,800.00	0.13
4	603508	思维列控	1,812,626.55	0.08
5	300496	中科创达	1,443,200.00	0.06
6	000001	平安银行	1,162,616.14	0.05
7	603996	中新科技	787,768.61	0.03
8	300494	盛天网络	612,598.00	0.03
9	603858	步长制药	605,643.00	0.03
10	600909	华安证券	575,481.60	0.02
11	002782	可立克	516,739.70	0.02
12	603778	乾景园林	506,226.00	0.02
13	300493	润欣科技	494,025.28	0.02
14	603299	井神股份	474,444.81	0.02
15	300497	富祥股份	416,839.81	0.02
16	601611	中国核建	408,474.75	0.02
17	601900	南方传媒	396,619.20	0.02
18	002780	三夫户外	392,260.00	0.02

19	601127	小康股份	383,120.26	0.02
20	600977	中国电影	356,257.44	0.02

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 8.4.3 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	72,321,173.07
卖出股票收入（成交）总额	42,680,427.86

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,693,000.00	6.34
	其中：政策性金融债	49,942,000.00	5.31
4	企业债券	8,806,277.00	0.94
5	企业短期融资券	189,608,000.00	20.15
6	中期票据	149,456,000.00	15.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	407,563,277.00	43.32

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011698568	16 同方 SCP005	500,000	49,780,000.00	5.29
2	101652021	16 中油股 MTN001	500,000	49,325,000.00	5.24
3	101654092	16 津城建 MTN003	500,000	48,735,000.00	5.18
4	101553006	15 铁道 MTN001	300,000	31,104,000.00	3.31
5	011699848	16 国联 SCP006	300,000	30,072,000.00	3.20

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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。

### 8.12.2

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。

**8.12.3 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	20,597.99
2	应收证券清算款	11,656.53
3	应收股利	-
4	应收利息	5,190,092.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,222,347.51

**8.12.4 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。

**8.12.5 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	601375	中原证券	106,780.00	0.01	新股锁定

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 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
2,089	428,122.30	812,534,802.46	90.85%	81,812,678.95	9.15%

**9.2 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	1,087,459.60	0.1216%

### 9.3 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月1日）基金份额总额	1,951,656,311.50
本报告期期初基金份额总额	2,302,398,630.69
本报告期基金总申购份额	396,487,006.24
减：本报告期基金总赎回份额	1,804,538,155.52
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	894,347,481.41

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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)。

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 80,000.00 元人民币。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：本报告期。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
广发证券	2	41,017,874.69	37.06%	37,379.22	36.64%	-
国信证券	1	20,291,538.26	18.33%	18,897.46	18.52%	-
中泰证券	1	14,478,604.96	13.08%	13,484.07	13.22%	-
长江证券	1	11,839,035.25	10.70%	11,025.45	10.81%	-
国金证券	2	5,233,592.12	4.73%	4,831.78	4.74%	-
国海证券	2	4,820,680.80	4.36%	4,489.51	4.40%	-
兴业证券	2	3,024,049.66	2.73%	2,795.12	2.74%	-
海通证券	2	2,217,255.84	2.00%	2,020.58	1.98%	-
浙商证券	2	2,202,409.92	1.99%	2,007.04	1.97%	-
安信证券	1	1,298,673.87	1.17%	1,183.47	1.16%	-
华创证券	2	1,279,377.36	1.16%	1,165.90	1.14%	-
光大证券	1	1,169,725.55	1.06%	1,065.98	1.04%	-

中信建投	1	749,094.17	0.68%	697.62	0.68%	-
国泰君安	1	541,814.93	0.49%	504.65	0.49%	-
申万宏源	2	273,825.72	0.25%	255.03	0.25%	-
招商证券	1	233,995.66	0.21%	213.24	0.21%	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-

未做过半年报的报告的基金写：

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、本年度交易单元新增：浙商证券，海通证券，西藏东方财富。

**11.7.2 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
广发证券	218,750.00	0.09%	60,000,000.00	0.74%	-	-
国信证券	-	-	20,500,000.00	0.25%	-	-
中泰证券	160,499,044.24	66.51%	5,656,700,000.00	70.09%	-	-
长江证券	-	-	212,000,000.00	2.63%	-	-
国金证券	54,531,793.47	22.60%	1,594,200,000.00	19.75%	-	-
国海证券	3,209,812.01	1.33%	110,000,000.00	1.36%	-	-



兴业证券	140,751.62	0.06%	180,000,000.00	2.23%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	30,000,000.00	0.37%	-	-
安信证券	743,280.00	0.31%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	10,732,063.39	4.45%	70,000,000.00	0.87%	-	-
国泰君安	1,005,026.03	0.42%	63,000,000.00	0.78%	-	-
申万宏源	2,017,848.61	0.84%	74,000,000.00	0.92%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	8,226,502.61	3.41%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016年1月4日
2	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2016年1月4日
3	关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年1月6日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国都证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年1月6日

5	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
6	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 1 月 26 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加渤海银行申购及定投申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 1 月 27 日
8	关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 2 月 24 日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 4 月 12 日
10	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加诺亚正行（上海）基金投资顾问有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 4 月 25 日
11	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰资产管理有限公司开通转换、定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 5 月 3 日
12	华宝兴业基金管理有限公司关于	《上海证券报》、《中	2016 年 5 月 31 日

	旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	
13	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年6月24日
14	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2016年7月1日
15	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加兴业证券基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月11日
16	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信证券、中信证券（山东）基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月22日
17	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海万得投顾顾问有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月3日
18	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月26日
19	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年9月2日

		站	
20	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年9月30日
21	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年10月13日
22	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华泰证券股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年10月14日
23	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2016年10月19日
24	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2016年10月19日
25	华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年12月24日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 中国证监会批准基金设立的文件；
- 华宝兴业新价值混合型证券投资基金基金合同；
- 华宝兴业新价值混合型证券投资基金招募说明书；
- 华宝兴业新价值混合型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。

## 12.2 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。

## 12.3 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  
2017年3月28日