

# 华宝兴业新活力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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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，德勤华永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 9 月 7 日（基金合同生效日）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.....	7
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	44

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 .....	44
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 .....	44
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
8.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	46
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
11.4 基金投资策略的改变 .....	47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
11.8 其他重大事件 .....	48
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新活力混合
基金主代码	003154
交易代码	003154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月7日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	566,334,436.78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，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</p> <p>本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、其他金融工具投资策略</p> <p>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	沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	罗菲菲
	联系电话	021-38505888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95568
传真		021-38505777	010-58560798
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 2 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 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		郑安国	洪崎

## 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	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所	上海市延安东路 222 号 30 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 9 月 7 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,718,947.92
本期利润	-6,083,741.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0105
本期加权平均净值利润率	-1.05%
本期基金份额净值增长率	-1.07%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	-6,036,693.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0107
期末基金资产净值	560,297,742.83
期末基金份额净值	0.9893
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-1.07%

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
过去三个月	-1.16%	0.13%	0.92%	0.36%	-2.08%	-0.23%
自基金合同生效日起至今	-1.07%	0.12%	-0.28%	0.36%	-0.79%	-0.24%

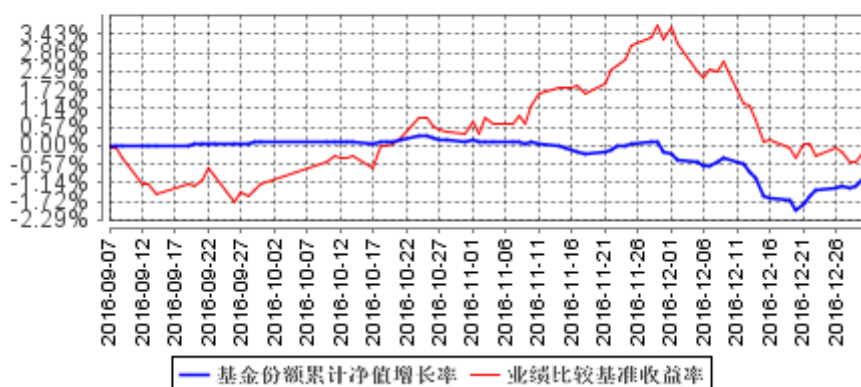
注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%

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

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2016 年 9 月 7 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



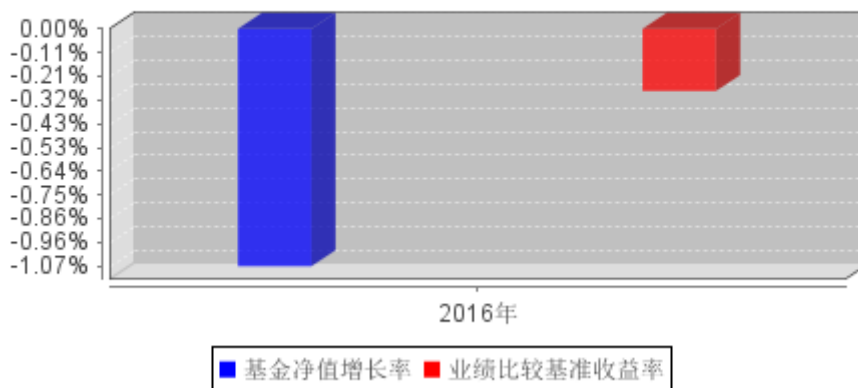
注：1、本基金基金合同生效于 2016 年 9 月 7 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。



### 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 2016 年 9 月 7 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 2016 年 9 月 7 日，成立至今尚未实施利润分配。

## § 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 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		
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、华宝新价值混合、华宝兴业可转债债券、华宝宝鑫债券、华宝新起点混合基金经理	2016年9月7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（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。

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。

## 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、《华宝兴业新活力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。

基金成立之后配置了股票和债券，4 季度不断提高股票的配置比例，由于债券投资部分久期略长，4 季度债券大跌拖累基金净值表现。基金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，本报告期内本基金份额净值增长率为-1.07%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%，基金表现落后业绩比较基准 0.79%。

#### 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《个人声明书》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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

#### 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，本基金托管人在对华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人—华宝兴业基金管理有限公司在华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

由华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金管理人—华宝兴业基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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	德师报(审)字(17)第 P00224 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	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：
引言段	我们审计了后附的华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华宝新活力混合”)的财务报表，包括 2016 年 12



	月 31 日的资产负债表，2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、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	编制和公允列报财务报表是华宝新活力混合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：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(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而导致的重大错报。
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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为，华宝新活力混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了华宝新活力混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	曾浩   吴凌志
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼 邮政编码 200002
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：华宝兴业新活力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
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	7, 228, 013. 51
结算备付金		618, 449. 96
存出保证金		25, 268. 07
交易性金融资产	7.4.7.2	546, 006, 687. 99
其中: 股票投资		61, 540, 907. 59
基金投资		-
债券投资		484, 465, 780. 40
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	7, 101, 559. 40
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		560, 979, 978. 93
<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>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		9, 878. 00
应付管理人报酬		285, 944. 46
应付托管费		71, 486. 11
应付销售服务费		119, 143. 50
应付交易费用	7.4.7.7	65, 784. 03
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	130, 000. 00
负债合计		682, 236. 10
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	566, 334, 436. 78
未分配利润	7.4.7.10	-6, 036, 693. 95
所有者权益合计		560, 297, 742. 83

负债和所有者权益总计		560,979,978.93
------------	--	----------------

注：

1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9893 元，基金份额总额 566,334,436.78 份。

2、本基金合同于 2016 年 9 月 7 日生效，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-4,041,033.84
1. 利息收入		4,703,327.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,450,231.85
债券利息收入		3,106,016.70
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		147,079.01
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,057,841.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,057,841.45
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-9,802,688.96
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	486.11
<b>减：二、费用</b>		2,042,707.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,095,078.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	273,769.59
3. 销售服务费		456,282.64
4. 交易费用	7.4.7.19	76,193.10
5. 利息支出		7,390.89
其中：卖出回购金融资产支出		7,390.89
6. 其他费用	7.4.7.20	133,992.51

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,083,741.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,083,741.04

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）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）	593,079,676.11	-	593,079,676.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,083,741.04	-6,083,741.04
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）	-26,745,239.33	47,047.09	-26,698,192.24
其中：1. 基金申购款	2,362,101.38	-131.30	2,361,970.08
2. 基金赎回款	-29,107,340.71	47,178.39	-29,060,162.32
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）	566,334,436.78	-6,036,693.95	560,297,742.83

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：

<u>黄小慧</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

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝兴

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》、《华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2016]1593号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 593,079,676.11 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第 0242 号的验资报告。基金合同于 2016 年 9 月 7 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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(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)、资产支持证券等)和货币市场工具(包括质押及买断式回购、银行存款等)、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为 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,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 50% + 上证国债指数收益率 $\times$ 50%。

#### 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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,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 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他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。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或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。贷款及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。

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，贷款及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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，

不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### - 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### - 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率逐日计提。



本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率逐日计提。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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**

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、

国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税。

2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 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
活期存款	7,228,013.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,228,013.51

### 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	61,136,560.45	61,540,907.59	404,347.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	14,188,220.46	13,902,780.40
	银行间市场	480,484,596.04	470,563,000.00
	合计	494,672,816.50	484,465,780.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	555,809,376.95	546,006,687.99	-9,802,688.96

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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
应收活期存款利息	1,769.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	306.13
应收债券利息	7,099,468.61
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.25
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.43
合计	7,101,559.40

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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
交易所市场应付交易费用	62,639.03
银行间市场应付交易费用	3,145.00
合计	65,784.03

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	130,000.00
合计	130,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	593,079,676.11	593,079,676.11
本期申购	2,362,101.38	2,362,101.38
本期赎回(以“-”号填列)	-29,107,340.71	-29,107,340.71
本期末	566,334,436.78	566,334,436.78

注：

- 1、本期申购含转换入份(金)额，本年赎回含转换出份(金)额。
- 2、本基金自 2016 年 8 月 29 日至 2016 年 9 月 5 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 人民币 593,024,404.21 元，折算为基金份额 593,024,404.21 份；根据《华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金认购款项在募集期间产生的利息人民币 55,271.90 元，在本基金成立后，折算为基金份额 55,271.90 份，划入基金份额持有人账户。

**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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,718,947.92	-9,802,688.96	-6,083,741.04
本期基金份额交易产生的变动数	-70,671.32	117,718.41	47,047.09
其中：基金申购款	3,199.41	-3,330.71	-131.30
基金赎回款	-73,870.73	121,049.12	47,178.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,648,276.60	-9,684,970.55	-6,036,693.95

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	149,502.31
定期存款利息收入	1,287,305.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,315.82
其他	108.17
合计	1,450,231.85

**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 2016年9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	4,432,882.56
减：卖出股票成本总额	3,375,041.11
买卖股票差价收入	1,057,841.45

**7.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期间无债券投资收益。

**7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期间无股利收益。

#### 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9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-9,802,688.96
——股票投资	404,347.14
——债券投资	-10,207,036.10
——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	-9,802,688.96

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	230.01
转换费收入	256.10
合计	486.11

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
----	--------------------------------------

交易所市场交易费用	73,118.10
银行间市场交易费用	3,075.00
合计	76,193.10

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	80,000.00
银行汇划费用	3,592.51
开户费	400.00
合计	133,992.51

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部和国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日和 2017 年 1 月 6 日联合颁布的《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)和《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)的有关规定，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，按照规定缴纳增值税。

#### 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(以下简称“华宝兴业”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)	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

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:

- 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

本基金本报告期内未发生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 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,095,078.47
其中:支付销售机构的客户维护费	60,930.79

注:支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×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 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	273,769.59

注:支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。



**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2016年9月7日(基金合同生效日)至2016年12 月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
华宝兴业基金管理有限公司	393,286.01	
民生银行	58,846.13	
合计	452,132.14	

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日销售服务费=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**

本基金本报告期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**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**

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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9月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	7,228,013.51	149,502.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，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**

本基金本报告期间未发生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**

本基金本报告期间未发生其他关联方交易事项。

**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	-

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末持有的债券中无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

## 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、货币型基金。本基金在投资运作活动中涉及到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通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约

风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	111,525,400.00
合计	111,525,400.00

注：未评级债券为国债、政策性金融和超短期融资券。上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 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
AAA	331,617,380.40
AAA 以下	41,323,000.00
未评级	-
合计	372,940,380.40

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要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和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，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，其余于 2016 年 12 月 31 日均能及时变现。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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内。可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

### 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，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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面临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。

##### 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	7,228,013.51	-	-	-	7,228,013.51
结算备付金	618,449.96	-	-	-	618,449.96
存出保证金	25,268.07	-	-	-	25,268.07
交易性金融资产	143,524,780.40	340,941,000.00	-	61,540,907.59	546,006,687.99
应收利息	-	-	-	7,101,559.40	7,101,559.40
资产总计	151,396,511.94	340,941,000.00	-	68,642,466.99	560,979,978.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,878.00	9,878.00
应付管理人报酬	-	-	-	285,944.46	285,944.46
应付托管费	-	-	-	71,486.11	71,486.11
应付销售服务费	-	-	-	119,143.50	119,143.50
应付交易费用	-	-	-	65,784.03	65,784.03
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	682,236.10	682,236.10
利率敏感度缺口	151,396,511.94	340,941,000.00	-	67,960,230.89	560,297,742.83

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规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）
	市场利率上升 25 个基点	-4,722,998.71
	市场利率下降 25 个基点	4,810,711.96

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金通过投资组合的分散降低其他价格风险。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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	61,540,907.59	10.98
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	61,540,907.59	10.98

##### 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，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资

产净值的影响。

#### 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) 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。

##### (b) 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的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 61,303,212.58 元，属于第二层次的余额为人民币 484,703,475.41 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

对于本基金投资的证券，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，本基金分别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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	61,540,907.59	10.97
	其中：股票	61,540,907.59	10.97
2	固定收益投资	484,465,780.40	86.36
	其中：债券	484,465,780.40	86.36
	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	7,846,463.47	1.40
7	其他各项资产	7,126,827.47	1.27
8	合计	560,979,978.93	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	11,158,913.46	1.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	41,678,901.90	7.44
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	8,687,500.00	1.55
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	61,540,907.59	10.98



## 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	2,652,590	11,697,921.90	2.09
2	000001	平安银行	1,210,000	11,011,000.00	1.97
3	000858	五粮液	310,000	10,688,800.00	1.91
4	601988	中国银行	2,780,000	9,563,200.00	1.71
5	601288	农业银行	3,000,000	9,300,000.00	1.66
6	000069	华侨城 A	1,250,000	8,687,500.00	1.55
7	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
8	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
9	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
10	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
11	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
12	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.01
13	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
14	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
15	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
16	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
17	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
18	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
19	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
20	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
21	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	11,851,500.00	2.12

2	601398	工商银行	11,775,973.70	2.10
3	000858	五粮液	11,276,351.99	2.01
4	601988	中国银行	10,287,000.00	1.84
5	601288	农业银行	9,420,000.00	1.68
6	000069	华侨城 A	8,957,166.58	1.60
7	600909	华安证券	256,169.24	0.05
8	601375	中原证券	106,780.00	0.02
9	002831	裕同科技	81,592.63	0.01
10	603877	太平鸟	67,734.00	0.01
11	603298	杭叉集团	46,131.47	0.01
12	603218	日月股份	39,482.80	0.01
13	603878	武进不锈	29,740.00	0.01
14	603585	苏利股份	27,888.39	0.00
15	603928	兴业股份	27,020.40	0.00
16	603035	常熟汽饰	24,179.04	0.00
17	603886	元祖股份	22,768.56	0.00
18	603033	三维股份	20,358.00	0.00
19	300582	英飞特	20,181.15	0.00
20	603239	浙江仙通	20,180.16	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	970,000.00	0.17
2	601988	中国银行	885,000.00	0.16
3	000858	五粮液	858,354.60	0.15
4	600909	华安证券	575,481.60	0.10
5	000069	华侨城 A	368,719.14	0.07
6	002831	裕同科技	183,070.50	0.03
7	603660	苏州科达	94,237.65	0.02
8	603928	兴业股份	89,845.50	0.02
9	603585	苏利股份	70,843.55	0.01
10	603033	三维股份	69,820.80	0.01
11	603878	武进不锈	63,880.00	0.01
12	603036	如通股份	56,443.80	0.01

13	603559	中通国脉	51,502.52	0.01
14	603389	亚振家居	48,540.08	0.01
15	002828	贝肯能源	47,142.82	0.01

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	64,511,601.56
卖出股票收入（成交）总额	4,432,882.56

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	1,997,400.00	0.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,706,000.00	7.09
	其中：政策性金融债	29,955,000.00	5.35
4	企业债券	11,905,380.40	2.12
5	企业短期融资券	79,573,000.00	14.20
6	中期票据	351,284,000.00	62.70
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	484,465,780.40	86.47

### 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	101553006	15 铁道 MTN001	500,000	51,840,000.00	9.25
2	1282329	12 中石油 MTN4	500,000	50,750,000.00	9.06
3	011698597	16 泸州窖 SCP002	500,000	49,725,000.00	8.87
4	101652015	16 三峡 MTN001	500,000	48,905,000.00	8.73
5	101651045	16 华侨城	500,000	48,785,000.00	8.71

		MTN003			
--	--	--------	--	--	--

### 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	25,268.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,101,559.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,126,827.47

### 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	0.02	新股锁定
2	603877	太平鸟	67,734.00	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
476	1,189,778.23	500,045,000.00	88.30%	66,289,436.78	11.71%

### 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	5,000.00	0.0009%

持有本基金		
-------	--	--

### 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	0
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（2016年9月7日）基金份额总额	593,079,676.11
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,362,101.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	29,107,340.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	566,334,436.78

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

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。

### 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

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 50,000.00 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：本基金合同生效之日（2016 年 9 月 7 日）起至本报告期末。

### 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	
中信证券	2	68,000,874.83	100.00%	62,639.03	100.00%	-

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：资历雄厚，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、本报告期新增交易单元为 中信证券。

## 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
中信证券	14,208,510.87	100.00%	1,575,100,000.00	100.00%	-	-

## 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	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016年8月24日
2	华宝兴业新活力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8月24日
3	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016年8月24日
4	华宝兴业新活力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8月24日
5	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016年8月24日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016年9月1日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016年9月5日



	告		
8	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016 年 9 月 8 日
9	华宝兴业新活力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》和基金管理人网站	2016 年 9 月 13 日
10	华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016 年 9 月 13 日
11	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》和基金管理人网站	2016 年 9 月 19 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；  
 华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同；  
 华宝兴业新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；  
 华宝兴业新活力灵活配置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办公场所备投资者查阅。

### 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