

华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券
投资基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 8 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 17 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 18 |
| 6.1 资产负债表..... | 18 |
| 6.2 利润表..... | 19 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 20 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| §7 投资组合报告..... | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 43 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 43 |
| 7.3 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..... | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 45 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 45 |
| 7.7 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..... | 46 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 46 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 46 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 46 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 48 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 48 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 48 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 49 |
| §10 重大事件揭示..... | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 50 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 50 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 50 |
| 10.8 其他重大事件..... | 52 |
| §11 备查文件目录..... | 53 |
| 11.1 备查文件目录..... | 53 |

| | |
|----------------|----|
| 11.2 存放地点..... | 53 |
| 11.3 查阅方式..... | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------|
| 基金名称 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝新回报混合 |
| 基金主代码 | 004281 |
| 交易代码 | 004281 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 3 月 23 日 |
| 基金管理人 | 华宝兴业基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 302,138,144.04 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、债券投资策略</p> <p>首先，本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合的久期。</p> <p>其次，债券投资组合的构建与调整是一个自下而上的过程，需综合评价个券收益率、波动性、到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素。同时，本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险，通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合较高的回报。</p> <p>4、权证投资策略 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 本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。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 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×30% +上证国债指数收益率×70%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益低于股票型基金，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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘月华 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、 021-38924558 | 95588 |
| 传真 | | 021-38505777 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验 | 北京市西城区复兴门内大街 55 |

| | | |
|-------|--------------------------------------|-------------------|
| | 区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 | 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 55 号 |
| 邮政编码 | 200120 | 100140 |
| 法定代表人 | 郑安国 | 易会满 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fsfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 本基金半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 |
|--------|-------|--------------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年3月23日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 2,209,165.77 |
| 本期利润 | 2,677,921.89 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0089 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.88% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.89% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 2,209,165.77 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0073 |
| 期末基金资产净值 | 304,816,065.93 |
| 期末基金份额净值 | 1.0089 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.89% |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

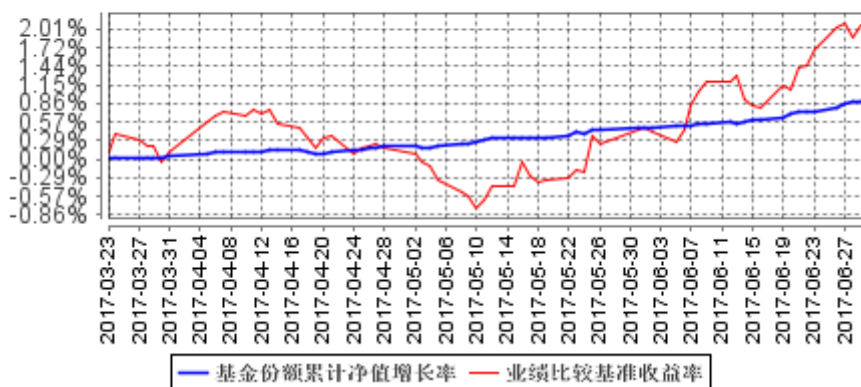
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.41% | 0.02% | 1.59% | 0.20% | -1.18% | -0.18% |
| 过去三个月 | 0.85% | 0.02% | 1.92% | 0.19% | -1.07% | -0.17% |
| 自基金合同生效日起至 | 0.89% | 0.02% | 2.05% | 0.19% | -1.16% | -0.17% |

| | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 今 | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|

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

(2017 年 3 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2017 年 3 月 23 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------------------------------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | 2017 年 3 月 23 日 | - | 14 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， |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | <p>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、华宝新活力混合、华宝新起点混合、华宝新动力混合、华宝新飞跃混合、华宝新优选混合、华宝新优享混合基金经理</p> | | | <p>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。2017年1月兼任华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年2月兼任华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年3月兼任华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金和华宝兴业新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年6月任华宝兴业新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业新回报一年定期开放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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 1-6 月份，固定资产累计投资完成额同比增长 8.6%，1 季度累计增速反弹，2 季度略有回落。其中，制造业投资同比增长 5.5%，增速比 1-5 月份提高 0.4 个百分点；房地产开发投资同比名义增长 8.5%，比 1-5 月份累计值回落 0.3 个百分点；基础设施投资同比增长 21.1%，比前值提高 0.2 个百分点。1-6 月份出口金额累计同比增长 8.5%，出口受益于海外经济好转而上升；

1-6 月份进口金额累计同比上升 18.9%。1-6 月份社会消费品零售总额累计同比增长 10.4%，增速小幅提升。物价水平呈现分化，CPI 水平较为温和，PPI 明显上升，PPI 向 CPI 的传导仍不畅。1-6 月份 CPI 累计同比增长 1.4%，6 月份同比增长 1.5%，延续温和上行；1-6 月份 PPI 累计同比增速 6.6%，5 月份 PPI 同比增速为 5.5%，增速在 2 季度逐月小幅回落。上半年经济增长情况好于市场预期，其中地产投资增速高于预期、消费中汽车和地产产业链增速高于预期、出口情况较好是整体经济增速好于预期的主要原因。1 季度政策整体从紧，央行提高了公开市场操作利率，2 季度初期监管机构开始出台去杠杆政策。去杠杆政策背景下，企业债融资大幅萎缩，信贷投放较为稳定且社会融资总量中，信贷的占比始终处于高位。2 季度末期，去杠杆政策的协调性加强，央行出手稳定流动性。

1 季度央行提高了公开市场操作利率，债券市场下跌；2 季度初金融去杠杆政策频出，债券市场继续大幅下跌。直到 6 月份，随着监管机构去杠杆政策的协调加强、央行维持流动性的稳定、债券收益率大幅上升之后，债券市场迎来了难得的反弹。

上半年股票市场分化较为明显，上证 50、沪深 300 表现明显优于中小板和创业板。1 季度股票市场上涨，4 月份以来股票市场下跌，5-6 月份在上证 50 的带领下，股票市场持续反弹。整体来说，市场偏好低估值稳定增长品种，抛弃高估值、业绩增速不高的品种。

1-5 月份可转债整体以下跌为主，可转债大幅扩容压缩了存量转债的估值水平，金融去杠杆政策出台后转债也持续下跌。在金融去杠杆政策协调性加强且央行维稳流动性之后，可转债整体迎来了大幅反弹。总体来说，转债也是结构性行情，选择品种非常重要。

2 季度债券部分采取了稳健的投资策略，初期以存款和回购为主，6 月份之后加大了债券的配置力度。股票部分始终较为谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期基金份额净值增长率为 0.89%，业绩比较基准收益率为 2.05%，基金表现落后业绩比较基准-1.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年经济增长情况持续好于预期，其中地产、消费、出口数据都非常好。地产的销售增速在下滑，但是房地产行业的固定资产投资增速较为稳定，并没有出现持续快速的下滑，预计下半年房地产行业的固定资产投资增速仍可能较为稳定。受益于海外经济复苏，出口情况较好，

净出口对 GDP 增长的贡献转正。制造业投资增速低位企稳。下半年需要关注基建的投资增速，基建资金来源可能受到政策抑制。总体来说，下半年经济增长有惯性，4 季度经济增速可能小幅下滑，但是不影响全年经济增长的大局。物价水平总体稳定温和。信贷和社会融资总量增速较为稳定，金融去杠杆政策将持续，但是影响已经大大降低。

下半年债券市场总体较为稳定，因经济增长情况好于市场预期，债券收益率曲线可能呈现陡峭化走势。债券市场的投资机会主要来自于预期差，若 4 季度经济增速下行或者经济数据低于预期，长久期利率债才可能存在交易性机会，在此之前债券投资以中短久期、中高等级为主。信用债的投资始终需要关注信用风险。经济增长情况好于预期叠加供给侧改革，近期周期性行业以及新能源汽车行业表现较好，股票市场以结构性投资机会为主，选择好行业和个股及其重要。可转债的投资机会和股票市场一样，以结构性行情为主，选择好个券及其重要。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华宝兴业新回报一年定期开放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的有关规定，不存在任何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，华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金的管理人——华宝兴业基金管理有限公司在华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华宝兴业基金管理有限公司编制和披露的华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 537,019.53 |
| 结算备付金 | | 5,442,500.00 |
| 存出保证金 | | 6,749.17 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 271,912,103.50 |
| 其中：股票投资 | | 8,220,000.00 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 263,692,103.50 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 24,500,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 515,041.10 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,326,120.63 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 305,239,533.93 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 149,935.30 |
| 应付托管费 | | 37,483.83 |
| 应付销售服务费 | | 149,935.30 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 33,296.57 |

| | | |
|---------------|----------|----------------|
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 52,817.00 |
| 负债合计 | | 423,468.00 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 302,138,144.04 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 2,677,921.89 |
| 所有者权益合计 | | 304,816,065.93 |
| 负债和所有者权益总计 | | 305,239,533.93 |

注：1. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0089 元，基金份额总额 302138144.04 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 3,889,942.56 |
| 1.利息收入 | | 3,349,342.89 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,484,634.91 |
| 债券利息收入 | | 711,281.47 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,153,426.51 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 71,843.55 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 150,660.24 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -78,816.69 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.1 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 468,756.12 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | - |

| | | |
|----------------------------|------------|--------------|
| 减：二、费用 | | 1,212,020.67 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 493,304.82 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 123,326.19 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 493,304.82 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 43,034.26 |
| 5. 利息支出 | | 338.17 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 338.17 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 58,712.41 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,677,921.89 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,677,921.89 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|---|--------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 302,138,144.04 | - | 302,138,144.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,677,921.89 | 2,677,921.89 |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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 | 302,138,144.04 | 2,677,921.89 | 304,816,065.93 |

| | | | |
|------|--|--|--|
| 金净值) | | | |
|------|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|--------------|-------------|--------------|
| _____ 黄小慧 | _____ 向辉 | _____ 张幸骏 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业新回报一年定期开放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[2017] 115 号《关于准予华宝兴业新回报一年定期开放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《华宝兴业新回报一年定期开放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 301,960,600.00 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(17)第 00040 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 302,138,144.04 份基金份额,其中认购资金利息折合 177,544.04 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业新回报一年定期开放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)、债券(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)等)、资产支持证券和货币市场工具(包括质押式及买断式回购、银行存款、同业存单等)、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)。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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 70%,投资于股票的比例不高于基金资产的 30%,每个开放期开始前一个月至开放期结束后一个月内不受前述比例限制;开放期内,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×30% + 上证国债指数收益率×70%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业新回报一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、销售服务费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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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) 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计字[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。

(2) 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，

金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 537,019.53 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 537,019.53 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
|---------------|-------|----------------|----------------|------------|
| 股票 | | 8,297,968.00 | 8,220,000.00 | -77,968.00 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 31,267,565.67 | 31,290,103.50 | 22,537.83 |
| | 银行间市场 | 231,877,813.71 | 232,402,000.00 | 524,186.29 |
| | 合计 | 263,145,379.38 | 263,692,103.50 | 546,724.12 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 271,443,347.38 | 271,912,103.50 | 468,756.12 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2017年6月30日 | |
|-----------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所买入返售证券 | 24,500,000.00 | - |
| 合计 | 24,500,000.00 | - |

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 973.12 |
| 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 | 2,449.10 |
| 应收债券利息 | 2,332,722.81 |
| 应收买入返售证券利息 | -10,027.40 |
| 应收申购款利息 | - |

| | |
|------------|--------------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 3.00 |
| 合计 | 2,326,120.63 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 27,311.90 |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,984.67 |
| 合计 | 33,296.57 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 52,817.00 |
| 合计 | 52,817.00 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 302,138,144.04 | 302,138,144.04 |
| 本期申购 | | |
| 本期赎回(以“-”号填列) | | |
| 本期末 | 302,138,144.04 | 302,138,144.04 |

注：1、本基金自2017年1月23日至2017年3月17日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币301,960,600.00元，折算为基金份额301,960,600.00份；根据《华宝兴业新回报一年定期开放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 177,544.04 元，在本基金成立后，折算为基金份额 177,544.04 份，划入基金份额持有人账户。

2、 本基金以定期开放的方式运作。即以封闭期和开放期相结合的方式运作。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至基金合同生效日所对应的下一年度对日的前一日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至首个开放期结束之日次日所对应的下一年度对日的前一日，以此类推。本基金自每个封闭期结束后第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日，具体时间由基金管理人在每个开放期前在指定媒介上予以公告。

6.4.7.10 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 | 2,209,165.77 | 468,756.12 | 2,677,921.89 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,209,165.77 | 468,756.12 | 2,677,921.89 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入 | 48,348.47 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 1,416,416.65 |
| 结算备付金利息收入 | 19,855.81 |
| 其他 | 13.98 |
| 合计 | 1,484,634.91 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017 年6月30日 |
|------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 10,589,660.24 |
| 减：卖出股票成本总额 | 10,439,000.00 |
| 买卖股票差价收入 | 150,660.24 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年 6月30日 |
|-------------------------------|--|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -78,816.69 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -78,816.69 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年 6月30日 |
|-------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,391,440.00 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,078,816.69 |
| 减：应收利息总额 | 391,440.00 |
| 买卖债券差价收入 | -78,816.69 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017 年6月30日 |
|------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 468,756.12 |
| ——股票投资 | -77,968.00 |
| ——债券投资 | 546,724.12 |
| ——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 | 468,756.12 |

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017 年6月30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 40,534.26 |
| 银行间市场交易费用 | 2,500.00 |
| 合计 | 43,034.26 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017 |
|----|--------------------------------|
|----|--------------------------------|

| | 年 6 月 30 日 |
|-------|------------|
| 审计费用 | 17,606.00 |
| 信息披露费 | 35,211.00 |
| 其他手续费 | 400.00 |
| 银行费用 | 5,495.41 |
| 合计 | 58,712.41 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

根据中国证监会于 2017 年 7 月 21 日发布的《关于核准华宝兴业基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可（2017）1321 号），中国证监会已核准“领先资产管理有限公司”将持有的我公司 49% 的股权转让给 Warburg Pincus Asset Management, L.P.。我公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜，敬请投资者知悉。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--|---------------------|
| 华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华宝信托有限责任公司（“华宝信托”） | 基金管理人的股东 |
| 领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.) | 基金管理人的股东 |
| 中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”） | 华宝信托的最终控制人 |
| 华宝证券有限责任公司（“华宝证券”） | 受宝武集团控制的公司 |

| | |
|----------------------|------------|
| 华宝投资有限公司(“华宝投资”) | 受宝武集团控制的公司 |
| 宝钢集团财务有限责任公司(“宝钢财务”) | 受宝武集团控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 493,304.82 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 315,196.22 |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 123,326.19 |

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 工商银行 | 407,936.79 |
| 华宝兴业 | 85,363.14 |
| 合计 | 493,299.93 |
| 获得销售服务费 各关联方名称 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.6%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×0.6%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|---|
| 基金合同生效日（2017 年 3 月 23 日）持有的基金份额 | 200,000.00 |
| 期初持有的基金份额 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - |
| 期末持有的基金份额 | 200,000.00 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.07% |

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联 方名 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| | |

| 称 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 |
|----------|---------------|----------------------|
| 华宝 投资 | 50,000,000.00 | 16.55% |

6.4.10.5 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 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日 | |
|-----------|--------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 537,019.53 | 48,348.47 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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经营管理及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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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 2017年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1 | 40,062,000.00 |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 108,290,000.00 |
| 合计 | 148,352,000.00 |

注：未评级债券为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。

6.4.13.2.2 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 2017年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA | 75,372,200.00 |
| AAA 以下 | 39,967,903.50 |
| 未评级 | - |
| 合计 | 115,340,103.50 |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 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

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 2017 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|----------------|---------------|------------|--------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 537,019.53 | - | - | - | 537,019.53 |
| 结算备付金 | 5,442,500.00 | - | - | - | 5,442,500.00 |
| 存出保证金 | 6,749.17 | - | - | - | 6,749.17 |
| 交易性金融资产 | 201,782,400.00 | 61,615,000.00 | 294,703.50 | 8,220,000.00 | 271,912,103.50 |
| 买入返售金融资产 | 24,500,000.00 | - | - | - | 24,500,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 515,041.10 | 515,041.10 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,326,120.63 | 2,326,120.63 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---------------|------------|---------------|----------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 232,268,668.70 | 61,615,000.00 | 294,703.50 | 11,061,161.73 | 305,239,533.93 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 149,935.30 | 149,935.30 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 37,483.83 | 37,483.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 149,935.30 | 149,935.30 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 33,296.57 | 33,296.57 |
| 其他负债 | - | - | - | 52,817.00 | 52,817.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 423,468.00 | 423,468.00 |
| 利率敏感度缺口 | 232,268,668.70 | 61,615,000.00 | 294,703.50 | 10,637,693.73 | 304,816,065.93 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

6.4.13.4.1.2 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（2017年6月30日） |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 680,125.72 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -676,600.89 |

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金投资组合中债券投资比例不低于基金资产 70%，股票投资比例不高于基金资产的 30%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 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 | 8,220,000.00 | 2.70 |
| 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 | 8,220,000.00 | 2.70 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 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 2.70%，因此除市场利率和外汇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。

6.4.14 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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 8,220,000.00 元，属于第二层次的余额为 263,692,103.50 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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 8,220,000.00 | 2.69 |
| | 其中：股票 | 8,220,000.00 | 2.69 |
| 2 | 固定收益投资 | 263,692,103.50 | 86.39 |
| | 其中：债券 | 263,692,103.50 | 86.39 |
| | 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 | 24,500,000.00 | 8.03 |
| | 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 | 5,979,519.53 | 1.96 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,847,910.90 | 0.93 |
| 8 | 合计 | 305,239,533.93 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 8,220,000.00 | 2.70 |
| K | 房地产业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 8,220,000.00 | 2.70 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600016 | 民生银行 | 1,000,000 | 8,220,000.00 | 2.70 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 601988 | 中国银行 | 9,111,000.00 | 2.99 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 8,297,968.00 | 2.72 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 1,328,000.00 | 0.44 |

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 601988 | 中国银行 | 9,250,000.00 | 3.03 |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 1,339,660.24 | 0.44 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 18,736,968.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 10,589,660.24 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 35,077,400.00 | 11.51 |
| 5 | 企业短期融资券 | 100,248,000.00 | 32.89 |
| 6 | 中期票据 | 79,968,000.00 | 26.23 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 294,703.50 | 0.10 |
| 8 | 同业存单 | 48,104,000.00 | 15.78 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 263,692,103.50 | 86.51 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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 | 111714189 | 17 江苏银行 CD189 | 300,000 | 29,004,000.00 | 9.52 |
| 2 | 101454014 | 14 中金集 MTN001 | 200,000 | 20,416,000.00 | 6.70 |
| 3 | 011753037 | 17 义乌国资 | 200,000 | 20,082,000.00 | 6.59 |

| | | | | | |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| | | SCP002 | | | |
| 4 | 1382160 | 13 北排水 MTN1 | 200,000 | 20,080,000.00 | 6.59 |
| 5 | 011752025 | 17 皖出版 SCP002 | 200,000 | 20,056,000.00 | 6.58 |

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,749.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | 515,041.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,326,120.63 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,847,910.90 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 2,248 | 134,403.09 | 50,200,000.00 | 16.61% | 251,938,144.04 | 83.39% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 305,227.19 | 0.1010% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017年3月23日）基金份额总额 | 302,138,144.04 |
| 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 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - |
| 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 | 302,138,144.04 |

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2017 年 6 月 9 日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,副总经理任志强先生因个人原因,自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,董事长郑安国先生因个人原因,自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务,由孔祥清先生接任公司董事长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:本基金合同生效之日(2017 年 3 月 23 日)起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰君安 | 1 | 29,326,628.24 | 100.00% | 27,311.90 | 100.00% | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |

注：基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，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. 本基金本报告期券商交易单元均为新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 31,012,565.67 | 100.00% | 3,296,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金份额发售公告 | 上海证券报和基金管理人网站 | 2017年1月19日 |
| 2 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同 | 基金管理人网站 | 2017年1月19日 |
| 3 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同摘要 | 上海证券报和基金管理人网站 | 2017年1月19日 |
| 4 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金托管协议 | 基金管理人网站 | 2017年1月19日 |
| 5 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书 | 基金管理人网站 | 2017年1月19日 |
| 6 | 华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金增加平安银行股份有限公司为代销机构的公告 | 上海证券报和基金管理人网站 | 2017年2月10日 |
| 7 | 华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金延长募集期的公告 | 上海证券报和基金管理人网站 | 2017年2月25日 |
| 8 | 华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 上海证券报和基金管理人网站 | 2017年3月24日 |
| 9 | 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首次申购最低金额、追加申购最低金额、定期定额申购最低金额、单笔最低赎回份额、赎回后最低保有份额及基金转换份额限制的公告 | 上海证券报和基金管理人网站 | 2017年5月15日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同；

华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书；

华宝兴业新回报一年定期开放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。

11.2 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。

11.3 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8月25日