

# 上证 180 价值交易型开放式指数证券投资 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 01 月 01 日起至 06 月 30 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>6</b>
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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	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.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	42
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.....	46
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.....	46
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.8 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
7.9 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
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	54
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证 180 价值 ETF
场内简称	价值 ETF
基金主代码	510030
交易代码	510030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 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	47,528,726.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 5 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	上证 180 价值指数
风险收益特征	本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

### 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
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 中国保险大厦 36 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1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	5,952,615.87
本期利润	23,603,271.63
加权平均基金份额本期利润	0.6541
本期加权平均净值利润率	15.57%
本期基金份额净值增长率	14.86%
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	38,186,611.68
期末可供分配基金份额利润	0.8034
期末基金资产净值	217,121,229.54
期末基金份额净值	4.568
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	56.39%

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、期末可供分配利润采用期末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。

4、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）。

#### 3.2 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	4.58%	0.71%	3.35%	0.79%	1.23%	-0.08%
过去三个月	9.83%	0.70%	8.26%	0.73%	1.57%	-0.03%
过去六个月	14.86%	0.62%	13.62%	0.64%	1.24%	-0.02%
过去一年	27.46%	0.66%	24.24%	0.68%	3.22%	-0.02%
过去三年	104.57%	1.72%	90.05%	1.74%	14.52%	-0.02%



自基金合同生效日起至今	56.39%	1.53%	36.22%	1.53%	20.17%	0.00%
-------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

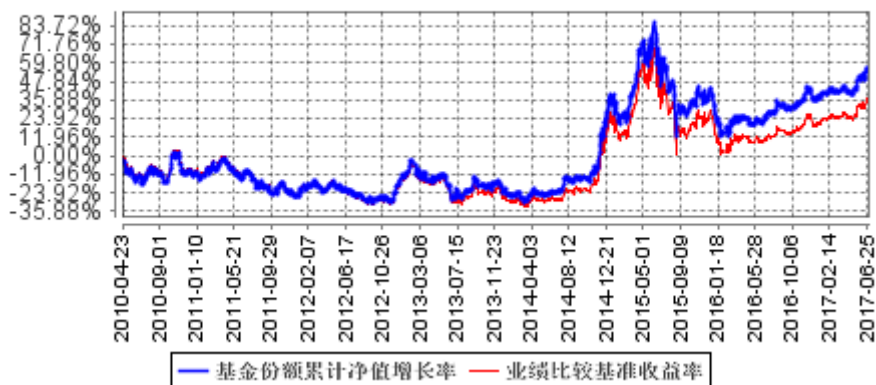
注：1、本基金业绩比较基准为：上证 180 价值指数。

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

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

(2010 年 4 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：基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，截至 2010 年 5 月 28 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 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		
丰晨成	本基金基金经理、华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接、华宝兴业中证	2015 年 11 月 13 日	-	8 年	硕士。2009 年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任助理产品经理，数量分析师，投资经理助理，投资经理等职务。2015 年 11 月任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月兼任华宝兴业中证

	全指证 券公司 ETF 基 金经理				全指证券公司交易型开放式指 数证券投资基金基金经理。
张奇	本基金 基金经 理 助 理、华 宝兴业 上 证 180 价 值 ETF 联接、 上 证 180 成 长 ETF、华 宝兴业 上 证 180 成 长 ETF 联接、 华宝兴 业中证 医疗指 数 分 级、华 宝兴业 中 证 1000 指数分 级、华 宝兴业 中证军 工 ETF 基金经 理助理	2015 年 4 月 7 日	-	7 年	本科。曾先后在毕博管理咨询 有限公司、德邦证券从事咨询 顾问及董事副总经理的工作。 2014 年 10 月加入华宝兴业基 金管理有限公司担任高级数量 分析师的职务。2015 年 4 月起 兼任华宝兴业上证 180 价值交 易型开放式指数证券投资基金、 华宝兴业上证 180 价值交 易型开放式指数证券投资基金 联接基金基金经理助理，2015 年 5 月起兼任上证 180 成长交 易型开放式指数证券投资基金、 华宝兴业上证 180 成长交 易型开放式指数证券投资基金 联接基金基金经理助理，2017 年 4 月起任华宝兴业中证医疗 指数分级证券投资基金、华宝 兴业中证 1000 指数分级证券 投资基金、华宝兴业中证军工 交易型开放式指数证券投资基 金基金经理助理

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金

法》及其各项实施细则、《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和指数成分股的调整，上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金出现了持有不属于 180 价值指数的成分股及其备选股的情况；发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，国内经济在经济结构调整和供给侧改革的新常态下，经济呈现出稳中向好的迹象。PMI 指数连续位于荣枯线上方，资本市场整体上维持区间振荡，大小盘股票表现的分化尤为明显。价值风格在 16 年后继续引领市场主题，上半年的投资脉络围绕着不同特征的价值股轮动接力：银

行、保险、食品饮料、煤炭有色建材钢铁等板块交替表现，市场在找寻有确定性盈利的低估值股票的过程中，表征大盘蓝筹价值股的 180 价值指数，区间表现领先于上证 50、上证 180、沪深 300 等指数，尤其是 5 月份价值风格的优势明显，表现耀眼。整体上来看，大盘价值股在 2017 年上半年取得了良好的相对收益。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 4.568 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.86%，业绩比较基准收益率为 13.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年以来，伴随世界经济复苏，国内经济最坏的时候正在过去，供给侧改革取得初步成效，企业盈利从去年以来出现明显改善，经济结构由外向转内需、内需由投资转消费。经济稳中求进态势进一步显现，基础进一步牢靠。年初以来 PPI 数据的持续上升，上游资源价格传导至下游工业品，工业企业利润的增厚，提升制造业景气度。在经济逐步转好情况下，金融防风险和严监管的态势仍将延续，在十九大召开前夕，各项改革举措有望加快推进，实体去杠杆，僵尸企业清理、国企改革等有望加快突破。资本市场直接融资功能的发挥，新股发行的常态化、打击操纵市场、内幕交易行为等的措施，有助于进一步深化市场价值投资的理念和信心。从 15 年下半年开始的价值股回归势头在今年得到了越来越多投资者的承认，“是金子总会发光的”，我们乐观看待以低估值、高分红蓝筹为特征的 180 价值指数成分股对于资金的长期配置价值。

作为指数基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对上证 180 价值指数的有效跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

（一）基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金

投资品种进行估值。

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

（三）估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，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，本基金托管人在对上证180价值交易型开放式指数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，上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华宝兴业基金管理有限公司在上证 180 价值交易型开放式指数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。本报告期内，上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

### 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上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金 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：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,457,702.97	508,912.99
结算备付金		5,855.78	-
存出保证金		1,732.48	1,552.87
交易性金融资产	6.4.7.2	211,960,782.73	137,280,721.99
其中：股票投资		211,960,782.73	137,280,721.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		198,380.44	-
应收利息	6.4.7.5	1,047.57	112.81
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		217,625,501.97	137,791,300.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	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		81,067.74	60,254.33
应付托管费		16,213.57	12,050.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	62,856.39	26,803.24



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	344,134.73	380,000.00
负债合计		504,272.43	479,108.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	138,840,428.65	100,864,961.52
未分配利润	6.4.7.10	78,280,800.89	36,447,230.67
所有者权益合计		217,121,229.54	137,312,192.19
负债和所有者权益总计		217,625,501.97	137,791,300.66

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.568 元，基金份额总额 47,528,726.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		24,316,110.89	-20,036,294.91
1.利息收入		6,955.71	10,664.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,915.29	10,664.28
债券利息收入		40.42	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,668,236.39	-881,709.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,302,916.60	-2,754,573.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,176.08	-
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	2,353,143.71	1,872,864.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,650,655.76	-19,165,641.61
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	-9,736.97	392.00

<b>减：二、费用</b>		712,839.26	743,435.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	374,070.02	358,208.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	74,814.03	71,641.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	59,410.48	63,476.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	204,544.73	250,108.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		23,603,271.63	-20,779,730.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		23,603,271.63	-20,779,730.28

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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）	100,864,961.52	36,447,230.67	137,312,192.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,603,271.63	23,603,271.63
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）	37,975,467.13	18,230,298.59	56,205,765.72
其中：1. 基金申购款	48,199,631.36	22,878,690.54	71,078,321.90
2. 基金赎回款	-10,224,164.23	-4,648,391.95	-14,872,556.18
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）	138,840,428.65	78,280,800.89	217,121,229.54

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	128,616,264.41	49,942,922.78	178,559,187.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,779,730.28	-20,779,730.28
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）	-14,605,948.88	-3,302,043.76	-17,907,992.64
其中：1. 基金申购款	18,987,733.57	4,341,024.68	23,328,758.25
2. 基金赎回款	-33,593,682.45	-7,643,068.44	-41,236,750.89
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）	114,010,315.53	25,861,148.74	139,871,464.27

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：

_____ 黄小薏	_____ 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

华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]227 号《关于核准华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》的核准,由华宝兴业基金管理有限公司作为管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,109,157,136.00 元,业经安永华明(2010)验字第 60737318\_B04 号

验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,109,182,935.00 份基金份额,其中认购资金利息折合为 25,799.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括上证 180 价值指数的成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券,以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 95%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%;本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金业绩比较基准为上证 180 价值指数。

#### 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》、《上证 180 价值交易型开放式指数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于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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的转让收入免征增值税，对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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，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	5,457,702.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,457,702.97

### 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	188,497,376.87	211,960,782.73	23,463,405.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	188,497,376.87	211,960,782.73	23,463,405.86

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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	1,044.17
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	2.60
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.80
合计	1,047.57

### 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	62,856.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	62,856.39

### 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	294,134.73
应付指数使用费	50,000.00
合计	344,134.73

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,528,726.00	100,864,961.52
本期申购	16,500,000.00	48,199,631.36
本期赎回(以“-”号填列)	-3,500,000.00	-10,224,164.23
本期末	47,528,726.00	138,840,428.65

### 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
上年度末	22,801,093.02	13,646,137.65	36,447,230.67
本期利润	5,952,615.87	17,650,655.76	23,603,271.63
本期基金份额交易产生的变动数	9,432,902.79	8,797,395.80	18,230,298.59
其中：基金申购款	11,897,925.38	10,980,765.16	22,878,690.54
基金赎回款	-2,465,022.59	-2,183,369.36	-4,648,391.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,186,611.68	40,094,189.21	78,280,800.89

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日



活期存款利息收入	6,672.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	233.31
其他	9.15
合计	6,915.29

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,097,958.87
股票投资收益——赎回差价收入	1,204,957.73
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	4,302,916.60

##### 6.4.7.12.2 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1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	19,921,916.63
减：卖出股票成本总额	16,823,957.76
买卖股票差价收入	3,097,958.87

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	14,872,556.18
减：现金支付赎回款总额	321,179.18
减：赎回股票成本总额	13,346,419.27
赎回差价收入	1,204,957.73

### 6.4.7.13 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1月1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	473,216.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	461,000.00
减：应收利息总额	40.42
买卖债券差价收入	12,176.08

#### 6.4.7.13.1 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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,353,143.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,353,143.71

#### 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1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	17,650,655.76
——股票投资	17,650,655.76
——债券投资	-
——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	17,650,655.76

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-9,736.97
合计	-9,736.97

注：替代损益指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	59,410.48
银行间市场交易费用	-
合计	59,410.48

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	44,629.17
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	210.00
其他费用	200.00
合计	204,544.73

## 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、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
华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	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管理费	374,070.02	358,208.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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管理费划款指令，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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	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托管费	74,814.03	71,641.79

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 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

本基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 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

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
华宝兴业上证 180 价值交易 型开放式指数 证券投资基金 联接基金	42,934,041.00	90.33%	29,291,637.00	84.83%

#### 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1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,457,702.97	6,672.83	3,128,224.83	10,201.11

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

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 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。

### 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

金额单位：人民币元

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
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事項停牌	7.47	-	-	325,763	1,930,462.92	2,433,449.61
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事	3.60	-	-	542,677	2,057,673.35	1,953,637.20

		日	项 停 牌						
600100	同方 股份	2017 年 4 月 21 日	重 大 事 项 停 牌	14.12	-	-	67,400	1,005,366.27	951,688.00
601088	中国 神华	2017 年 6 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	22.29	-	-	91,600	1,504,015.11	2,041,764.00

### 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

本基金为 ETF 基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 价值指数。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以上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与跟踪指数相同的风险收益目标。

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主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征,通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所交易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。

于 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有债券投资。

### 6.4.13.3 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 2017 年 6 月 30 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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低，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。

### 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、结算备付金及存出保证金等。

### 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	5,457,702.97	-	-	-	5,457,702.97
结算备付金	5,855.78	-	-	-	5,855.78
存出保证金	1,732.48	-	-	-	1,732.48
交易性金融资产	-	-	-	211,960,782.73	211,960,782.73
应收证券清算款	-	-	-	198,380.44	198,380.44
应收利息	-	-	-	1,047.57	1,047.57
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,465,291.23	-	-	212,160,210.74	217,625,501.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	81,067.74	81,067.74
应付托管费	-	-	-	16,213.57	16,213.57
应付交易费用	-	-	-	62,856.39	62,856.39
其他负债	-	-	-	344,134.73	344,134.73
负债总计	-	-	-	504,272.43	504,272.43
利率敏感度缺口	5,465,291.23	-	-	211,655,938.31	217,121,229.54
上年度末 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	508,912.99	-	-	-	508,912.99
存出保证金	1,552.87	-	-	-	1,552.87
交易性金融资产	-	-	-	137,280,721.99	137,280,721.99
应收利息	-	-	-	112.81	112.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	510,465.86	-	-	137,280,834.80	137,791,300.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	60,254.33	60,254.33
应付托管费	-	-	-	12,050.90	12,050.90

应付交易费用	-	-	-	26,803.24	26,803.24
其他负债	-	-	-	380,000.00	380,000.00
负债总计	-	-	-	479,108.47	479,108.47
利率敏感度缺口	510,465.86	-	-	-136,801,726.33	137,312,192.19

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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，以复制、跟踪 180 价值指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑)，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为 180 价值指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于上证 180 价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 95%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。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		上年度末 2016 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	211,960,782.73	97.62	137,280,721.99	99.98
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	211,960,782.73	97.62	137,280,721.99	99.98

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用系统风险系数 Beta 历史回归的方法对本基金的市场价格价格风险进行分析。该方法是假设本基金的净值变动程度与跟踪基准的收益率变动的敏感性(beta)保持不变，我们通过假设跟踪基准收益率(市场价格)的变动来测量本基金净值的变动。		
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)	上年度末(2016年12月31日)
	比较基准+5%	10,542,750.11	6,745,410.64
比较基准-5%	-10,542,750.11	-6,745,410.64	

### 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 204,530,670.13 元，属于第二层次的余额为 7,430,112.60 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 135,968,791.99 元，第二层级 1,311,930.00 元，无第三层级的余额)。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负债均属于第一层次(2016 年 12 月 31 日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(2) 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	211,960,782.73	97.40
	其中：股票	211,960,782.73	97.40
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,463,558.75	2.51
7	其他各项资产	201,160.49	0.09
8	合计	217,625,501.97	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,507,256.00	2.54
C	制造业	23,868,424.64	10.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,621,738.58	4.89
E	建筑业	22,277,842.64	10.26
F	批发和零售业	2,549,043.25	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	7,871,871.71	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,433,449.61	1.12
J	金融业	127,524,772.66	58.73
K	房地产业	9,082,784.55	4.18



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	211,737,183.64	97.52

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	223,599.09	0.10
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	-	-
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	223,599.09	0.10

### 7.2.3 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

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	460,206	22,830,819.66	10.52
2	600036	招商银行	573,435	13,710,830.85	6.31
3	601166	兴业银行	692,852	11,681,484.72	5.38
4	600016	民生银行	1,314,343	10,803,899.46	4.98
5	601328	交通银行	1,527,500	9,409,400.00	4.33
6	601668	中国建筑	833,770	8,070,893.60	3.72
7	600000	浦发银行	624,827	7,904,061.55	3.64
8	601288	农业银行	2,125,224	7,480,788.48	3.45
9	601398	工商银行	1,199,100	6,295,275.00	2.90
10	601169	北京银行	676,384	6,202,441.28	2.86
11	600104	上汽集团	194,735	6,046,521.75	2.78
12	601601	中国太保	174,804	5,920,611.48	2.73
13	600900	长江电力	366,801	5,641,399.38	2.60
14	601211	国泰君安	250,700	5,141,857.00	2.37
15	601988	中国银行	1,171,654	4,335,119.80	2.00
16	600048	保利地产	395,574	3,943,872.78	1.82
17	601390	中国中铁	414,500	3,593,715.00	1.66
18	601818	光大银行	885,351	3,585,671.55	1.65
19	600028	中国石化	584,400	3,465,492.00	1.60
20	600019	宝钢股份	491,600	3,298,636.00	1.52
21	600015	华夏银行	356,368	3,285,712.96	1.51
22	601186	中国铁建	255,868	3,078,092.04	1.42
23	601006	大秦铁路	330,607	2,773,792.73	1.28
24	600690	青岛海尔	169,492	2,550,854.60	1.17
25	600585	海螺水泥	111,115	2,525,643.95	1.16
26	600050	中国联通	325,763	2,433,449.61	1.12
27	601939	建设银行	373,296	2,295,770.40	1.06
28	601009	南京银行	202,200	2,266,662.00	1.04

29	600089	特变电工	208,134	2,150,024.22	0.99
30	600741	华域汽车	87,638	2,124,345.12	0.98
31	601088	中国神华	91,600	2,041,764.00	0.94
32	601669	中国电建	255,200	2,021,184.00	0.93
33	600795	国电电力	542,677	1,953,637.20	0.90
34	601607	上海医药	64,100	1,851,208.00	0.85
35	600886	国投电力	226,373	1,788,346.70	0.82
36	600068	葛洲坝	153,700	1,727,588.00	0.80
37	600029	南方航空	195,200	1,698,240.00	0.78
38	600066	宇通客车	73,800	1,621,386.00	0.75
39	601618	中国中冶	297,700	1,491,477.00	0.69
40	600383	金地集团	125,463	1,439,060.61	0.66
41	600816	安信信托	101,280	1,376,395.20	0.63
42	601800	中国交建	84,900	1,349,061.00	0.62
43	600023	浙能电力	226,805	1,238,355.30	0.57
44	600177	雅戈尔	119,393	1,208,257.16	0.56
45	600221	海航控股	365,459	1,176,777.98	0.54
46	600018	上港集团	180,400	1,143,736.00	0.53
47	601111	中国国航	110,700	1,079,325.00	0.50
48	600208	新湖中宝	239,100	1,075,950.00	0.50
49	601998	中信银行	170,363	1,071,583.27	0.49
50	600219	南山铝业	308,600	1,046,154.00	0.48
51	600100	同方股份	67,400	951,688.00	0.44
52	600170	上海建工	247,600	945,832.00	0.44
53	601229	上海银行	36,700	937,318.00	0.43
54	601633	长城汽车	67,100	891,759.00	0.41
55	600266	北京城建	52,200	758,988.00	0.35
56	600704	物产中大	95,725	697,835.25	0.32
57	600060	海信电器	43,600	661,412.00	0.30
58	600376	首开股份	57,400	656,656.00	0.30
59	600919	江苏银行	70,500	654,945.00	0.30
60	600926	杭州银行	22,500	334,125.00	0.15

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
2	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
3	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
4	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
5	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
6	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
7	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
8	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
9	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
10	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601211	国泰君安	4,097,205.52	2.98
2	601318	中国平安	2,037,957.00	1.48
3	600019	宝钢股份	1,692,185.56	1.23
4	600208	新湖中宝	983,953.00	0.72
5	600170	上海建工	759,428.00	0.55
6	601229	上海银行	757,559.00	0.55
7	600919	江苏银行	562,602.00	0.41
8	600816	安信信托	505,149.52	0.37
9	600036	招商银行	491,812.00	0.36
10	600089	特变电工	445,434.78	0.32
11	601601	中国太保	417,248.00	0.30
12	600104	上汽集团	393,110.49	0.29
13	600016	民生银行	378,256.00	0.28
14	601166	兴业银行	372,686.00	0.27
15	600741	华域汽车	370,519.00	0.27
16	601328	交通银行	341,898.00	0.25

17	600926	杭州银行	302,118.00	0.22
18	601668	中国建筑	297,203.00	0.22
19	600000	浦发银行	293,871.70	0.21
20	601169	北京银行	285,774.00	0.21

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	6,739,100.00	4.91
2	601857	中国石油	1,726,378.82	1.26
3	600674	川投能源	977,009.00	0.71
4	600153	建发股份	913,258.34	0.67
5	601166	兴业银行	762,344.00	0.56
6	600649	城投控股	748,618.40	0.55
7	600315	上海家化	696,350.40	0.51
8	600816	安信信托	534,471.40	0.39
9	601200	上海环境	515,541.56	0.38
10	600325	华发股份	499,457.16	0.36
11	600064	南京高科	376,282.20	0.27
12	600036	招商银行	310,782.00	0.23
13	600016	民生银行	259,882.00	0.19
14	600089	特变电工	239,580.00	0.17
15	601328	交通银行	226,530.00	0.16
16	601111	中国国航	206,696.00	0.15
17	601668	中国建筑	195,294.00	0.14
18	600000	浦发银行	193,288.00	0.14
19	601952	苏垦农发	152,467.00	0.11
20	601288	农业银行	149,209.00	0.11

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	19,840,951.27
卖出股票收入（成交）总额	19,921,916.63

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

## 7.9 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	1,732.48
2	应收证券清算款	198,380.44
3	应收股利	-
4	应收利息	1,047.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,160.49

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五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

#### 8.1.1 本基金的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
760	62,537.80	42,937,516.00	90.34%	4,591,210.00	9.66%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	刘群	238,700.00	0.50%
2	聂秀梅	188,361.00	0.40%
3	白红霞	169,794.00	0.36%
4	岳韧锋	145,319.00	0.31%
5	明廷江	121,400.00	0.26%
6	方平	70,403.00	0.15%
7	朱燕	68,465.00	0.14%
8	史文仪	68,465.00	0.14%
9	杜彬	67,781.00	0.14%
10	陈秋瑚	62,100.00	0.13%
11	中国工商银行—华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金	42,934,041.00	90.33%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 4 月 23 日）基金份额总额	2,109,182,935.00
本报告期期初基金份额总额	34,528,726.00
本报告期基金总申购份额	16,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	47,528,726.00

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

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:会计事务所变更之日(2015 年 12 月 15 日)起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,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	
申万宏源	1	38,712,994.62	100.00%	36,053.15	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资质雄厚，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、本期交易单元无变动。

### 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
申万宏源	473,216.50	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	华宝兴业基金公司关于旗下部分开放式基金增加宏信证券为一级交易商的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 5 月 12 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接基金	1	20170103~20170630	29,291,637.00	37,214,888.00	23,572,484.00	42,934,041.00	90.33

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

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

## 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 8 月 25 日