

# 华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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>基金简介</b> .....	<b>6</b>
<b>§2</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.....	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.....	9
<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.....	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.....	12
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.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
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。.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58

<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
11.1 备查文件目录.....	60
11.2 存放地点.....	60
11.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金
基金简称	华宝兴业宝康配置混合
基金主代码	240002
交易代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 15 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	192,404,445.09 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	规避系统风险，降低投资组合波动性，提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略，以债券投资为基础，并把握股市重大投资机会，获取超额回报，同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×65%+沪深 300 指数收益率×35%

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑安国	王洪章

## 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	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1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-13,953,486.83
本期利润	7,979,551.57
加权平均基金份额本期利润	0.0406
本期加权平均净值利润率	2.20%
本期基金份额净值增长率	2.23%
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	171,196,665.91
期末可供分配基金份额利润	0.8898
期末基金资产净值	363,601,111.00
期末基金份额净值	1.8898
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	478.85%

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
过去一个月	3.21%	0.44%	2.43%	0.24%	0.78%	0.20%
过去三个月	2.58%	0.41%	2.29%	0.23%	0.29%	0.18%
过去六个月	2.23%	0.41%	3.77%	0.21%	-1.54%	0.20%
过去一年	0.52%	0.54%	5.99%	0.25%	-5.47%	0.29%
过去三年	50.58%	1.15%	34.35%	0.63%	16.23%	0.52%
自基金合同生效日起至 今	478.85%	1.15%	125.69%	0.62%	353.16%	0.53%

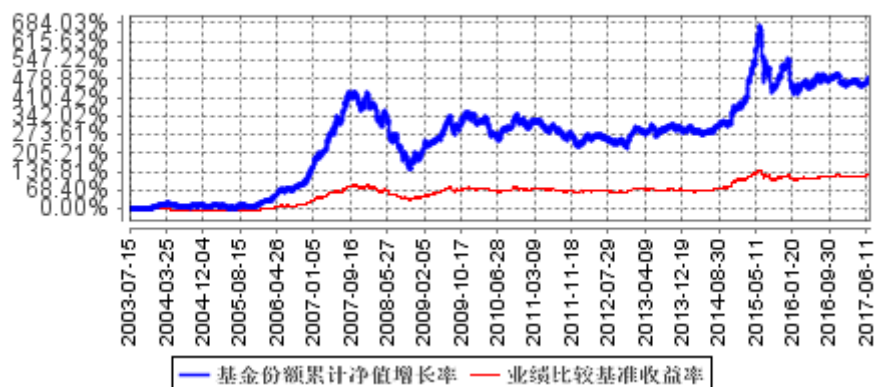
注：1、本基金业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×65%+沪深 300 指数收益率×35%。

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

（2003 年 7 月 15 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：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2004 年 1 月 15 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		
季鹏	本基金基金经理、华宝兴业先进成长混合、华宝第三产业混合基金经理	2013 年 8 月 27 日	-	11 年	硕士，拥有 CFA 资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理等工作。2011 年 4 月加入华宝兴业基金管理有限公司任高级策略分析师兼基金经理助理的职务。2013 年 8 月起任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金

					经理。2015 年 5 月至 2017 年 5 月任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理，2015 年 5 月起兼任华宝兴业先进成长混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 5 月任华宝兴业第三产业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。

## 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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》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申购赎回引起的基金资产规模变化，宝康灵活配置证券投资基金在短期内出现过持有国债市值低于基金资产净值 20%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 年上半年，A 股市场主板和大盘上涨，中小盘指数下跌，行情分化严重。沪深 300 指数上涨 10.78%，上证综指上涨 2.86%，中小板指数上涨 7.33%，创业板指数下跌 7.34%，深圳综指下跌 3.63%。上证指数明显好于创业板，特别是上证 50 表现较好，消费行业表现较好，大市值股票明显好于小市值股票，个股和行业表现分化严重。行业涨幅上，家电、食品饮料、银行、电子行业、煤炭表现较好，都录得较大的幅度正收益；农林牧渔、纺织服装、计算机、传媒等板块表现较差，录得较大负收益。市场出现了比较明显的倾向低估值和业绩趋势较好的大盘股的倾向，而高估值的板块出现了较大的资金流出。由于本基金风格维持了一定的价值股和成长股均衡的策略，总体表现处于市场中游。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 3.77%，基金表现落后于比较基准 1.54%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，预计中国经济增长将继续保持总体平稳，传统周期性行业在供给侧改革和经济回升的带动下出现了较好的盈利恢复，预计下半年这种经济走势仍将延续。股市微观结构上，今年的新股发行速度和数量的大幅提高、以及监管对外延并购等资本运作的收紧都将长期影响国内股票市场中小盘股票的估值水平和投资逻辑。预计市场中期难以出现较大幅度的趋势性变化，资金将更倾向于按照企业盈利趋势较好的行业进行投资，行业结构要比仓位更加重要，选股更加倾向于行业龙头和盈利趋势好转的企业。

就长期而言，我们对中国经济转型所带来的投资前景充满信心，2017 年是过去几年经济形势最好的一年，但是股市的个股表现千差万别，我们将继续保持此前小心谨慎的投资风格，仓位较为灵活；标的选择上将紧密跟踪各行业景气度变化，精选优秀的公司并长期持有，分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，我们将继续勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

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	17,056,036.88	49,383,422.73
结算备付金		231,793.53	195,506.46
存出保证金		64,158.70	92,428.82
交易性金融资产	6.4.7.2	346,555,224.03	321,559,212.48
其中：股票投资		263,116,424.03	239,904,212.48
基金投资		-	-
债券投资		83,438,800.00	81,655,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,204,325.92	1,917,202.58
应收股利		-	-
应收申购款		2,043.05	2,338.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		365,113,582.11	373,150,111.87
<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		69,780.37	261,757.25
应付管理人报酬		382,365.06	418,539.60
应付托管费		73,531.76	80,488.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	266,956.79	168,542.05

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	719,837.13	739,966.00
负债合计		1,512,471.11	1,669,293.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	192,404,445.09	200,956,558.28
未分配利润	6.4.7.10	171,196,665.91	170,524,260.33
所有者权益合计		363,601,111.00	371,480,818.61
负债和所有者权益总计		365,113,582.11	373,150,111.87

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8898 元，基金份额总额 192,404,445.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

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>		11,537,777.39	-57,549,997.22
1.利息收入		1,652,325.06	2,876,137.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	166,828.27	271,361.66
债券利息收入		1,482,558.81	2,604,776.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,937.98	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,084,379.41	-7,206,779.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,263,173.34	-8,602,542.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-567,976.62	-828,560.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,746,770.55	2,224,323.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	21,933,038.40	-53,242,523.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	36,793.34	23,167.65



<b>减：二、费用</b>		3,558,225.82	4,740,438.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,336,725.68	3,281,237.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	449,370.32	631,007.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	670,708.15	715,324.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	101,421.67	112,868.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7,979,551.57	-62,290,435.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7,979,551.57	-62,290,435.70

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

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）	200,956,558.28	170,524,260.33	371,480,818.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,979,551.57	7,979,551.57
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）	-8,552,113.19	-7,307,145.99	-15,859,259.18
其中：1.基金申购款	1,973,229.80	1,640,547.80	3,613,777.60
2.基金赎回款	-10,525,342.99	-8,947,693.79	-19,473,036.78
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	192,404,445.09	171,196,665.91	363,601,111.00

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
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	277,279,899.86	320,397,306.42	597,677,206.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-62,290,435.70	-62,290,435.70
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)	-272,214.92	-479,446.28	-751,661.20
其中：1.基金申购款	7,659,781.04	6,116,667.83	13,776,448.87
2.基金赎回款	-7,931,995.96	-6,596,114.11	-14,528,110.07
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)	-	-13,847,468.95	-13,847,468.95
五、期末所有者权益(基金净值)	277,007,684.94	243,779,955.49	520,787,640.43

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

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 62 号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 7 月 15 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康灵活配置证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康消费品证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,893,701,931.41 元,其中包括本基金人民币 1,066,581,834.53 元、宝康消费品证券投资基金人民币 1,540,046,055.09 元和宝康债券投资基金人民币 1,287,074,041.79 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 96 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等;股票投资方面,主要投资对象为上证 180 指数、深证 100 指数的成分股。本基金组合投资范围为:债券 20%-90%;股票 5%-75%;现金 5%以上。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率 $\times$ 65%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 35%。

### 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业宝康系列开放式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 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 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、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	17,056,036.88
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	17,056,036.88

### 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	250,415,549.66	263,116,424.03	12,700,874.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,720,035.78	23,588,800.00
	银行间市场	59,879,410.00	59,850,000.00
	合计	84,599,445.78	83,438,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	335,014,995.44	346,555,224.03	11,540,228.59

### 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	4,989.40
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	104.30
应收债券利息	1,199,203.28
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.04
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	28.90
合计	1,204,325.92

### 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	266,756.79
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	266,956.79

**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	500,000.00
应付赎回费	150.80
预提费用	219,686.33
合计	719,837.13

**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	200,956,558.28	200,956,558.28
本期申购	1,973,229.80	1,973,229.80
本期赎回(以“-”号填列)	-10,525,342.99	-10,525,342.99
本期末	192,404,445.09	192,404,445.09

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

**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	243,572,839.98	-73,048,579.65	170,524,260.33
本期利润	-13,953,486.83	21,933,038.40	7,979,551.57
本期基金份额交易产生的变动数	-9,964,955.01	2,657,809.02	-7,307,145.99
其中：基金申购款	2,265,423.59	-624,875.79	1,640,547.80
基金赎回款	-12,230,378.60	3,282,684.81	-8,947,693.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	219,654,398.14	-48,457,732.23	171,196,665.91

**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	163,250.65
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	2,956.50
其他	621.12
合计	166,828.27

**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1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	216,092,874.42
减：卖出股票成本总额	229,356,047.76
买卖股票差价收入	-13,263,173.34

**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1月1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	-567,976.62
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	-567,976.62



**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	82,581,522.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	81,117,839.53
减：应收利息总额	2,031,659.40
买卖债券差价收入	-567,976.62

**6.4.7.14 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。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.17 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	1,746,770.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,746,770.55

**6.4.7.18 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	21,933,038.40
——股票投资	22,163,170.51
——债券投资	-230,132.11
——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	21,933,038.40

**6.4.7.19 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	35,548.55
转换费收入	1,244.79
合计	36,793.34

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 部分基金之间的转换费采用固定转换费率，转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产；部分基金之间的转换费由赎回费和申购补差费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.20 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	669,558.15
银行间市场交易费用	1,150.00
合计	670,708.15

#### 6.4.7.21 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	49,967.55
银行间查询证书费	300.00
债券帐户维护费	18,400.00
银行费用	3,001.34
合计	101,421.67

#### 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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	2,336,725.68	3,281,237.89
其中：支付销售机构的客户维护费	33,002.51	35,332.98

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 1.3% 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 1.3% / 当年天数。

**6.4.10.2 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	449,370.32	631,007.27

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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**

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	209,033.80	286,023.61
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	209,033.80	286,023.61
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	0.10%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。期间申购/买入总份额中包含红利再投资份额。

**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**

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

### 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
中国建设银行	17,056,036.88	163,250.65	16,439,896.87	267,077.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

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

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	备注
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大事项停牌	7.55	-	-	1,200,000	9,812,862.04	9,060,000.00	-
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项停牌	7.47	2017年8月21日	8.22	171,081	990,349.84	1,277,975.07	-
601989	中国重工	2017年5月	重大事项	6.21	-	-	178,126	1,587,615.28	1,106,162.46	-

		月 31 日	停牌								
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	23.48	-	-	38,281	695,237.82	898,837.88	-	
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	3.60	-	-	231,600	868,437.98	833,760.00	-	
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	144,017	574,369.59	493,978.31	-	
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	14.12	-	-	34,660	495,574.17	489,399.20	-	
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	20.24	-	-	19,582	332,258.61	396,339.68	-	
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事项停牌	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	73,900	419,296.00	395,365.00	-	
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事项停牌	10.57	-	-	30,800	334,621.00	325,556.00	-	
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大事项停牌	24.93	-	-	12,867	438,772.65	320,774.31	-	
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大事项停牌	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	37,598	386,343.19	284,616.86	-	
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大事项停牌	17.40	-	-	14,560	245,411.00	253,344.00	-	
601872	招商轮船	2017 年 5 月	重大事项	5.16	-	-	41,300	212,516.00	213,108.00	-	

		月 2 日	停牌							
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.27	-	-	25,404	286,952.02	210,091.08	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事项停牌	7.68	-	-	26,500	217,014.00	203,520.00	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事项停牌	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	5,600	181,816.00	172,592.00	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	重大事项停牌	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	25,700	145,668.00	142,378.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项停牌	14.59	-	-	1,238	49,048.30	18,062.42	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司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。

#### 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建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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及债券投资等。

##### 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	17,056,036.88	-	-	-	17,056,036.88
结算备付金	231,793.53	-	-	-	231,793.53
存出保证金	64,158.70	-	-	-	64,158.70
交易性金融资产	59,850,000.00	23,588,800.00	-	-263,116,424.03	346,555,224.03
应收利息	-	-	-	1,204,325.92	1,204,325.92
应收申购款	-	-	-	2,043.05	2,043.05
资产总计	77,201,989.11	23,588,800.00	-	-264,322,793.00	365,113,582.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	69,780.37	69,780.37
应付管理人报酬	-	-	-	382,365.06	382,365.06
应付托管费	-	-	-	73,531.76	73,531.76

应付交易费用	-	-	-	266,956.79	266,956.79
其他负债	-	-	-	719,837.13	719,837.13
负债总计	-	-	-	1,512,471.11	1,512,471.11
利率敏感度缺口	77,201,989.11	23,588,800.00	-	-262,810,321.89	363,601,111.00
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	49,383,422.73	-	-	-	49,383,422.73
结算备付金	195,506.46	-	-	-	195,506.46
存出保证金	92,428.82	-	-	-	92,428.82
交易性金融资产	50,080,000.00	31,575,000.00	-	-239,904,212.48	321,559,212.48
应收利息	-	-	-	1,917,202.58	1,917,202.58
应收申购款	-	-	-	2,338.80	2,338.80
资产总计	99,751,358.01	31,575,000.00	-	-241,823,753.86	373,150,111.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	261,757.25	261,757.25
应付管理人报酬	-	-	-	418,539.60	418,539.60
应付托管费	-	-	-	80,488.36	80,488.36
应付交易费用	-	-	-	168,542.05	168,542.05
其他负债	-	-	-	739,966.00	739,966.00
负债总计	-	-	-	1,669,293.26	1,669,293.26
利率敏感度缺口	99,751,358.01	31,575,000.00	-	-240,154,460.60	371,480,818.61

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）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	310,370.20	462,249.34
2. 市场利率上升 25 个基点	-307,487.22	-456,927.51	

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 5%-75%；债券为 20%-90%；现金比例在 5%以上。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	263,116,424.03	72.36	239,904,212.48	64.58
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	263,116,424.03	72.36	239,904,212.48	64.58

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准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）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	24,038,156.67	26,521,234.10
	业绩比较基准下降 5%	-24,038,156.67	-26,521,234.10

**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 246,020,563.76 元，属于第二层次的余额为 100,534,660.27 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 236,448,642.44 元，第二层次 85,110,570.04 元，无第三层次)。

## (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(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 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	263,116,424.03	72.06
	其中：股票	263,116,424.03	72.06
2	固定收益投资	83,438,800.00	22.85
	其中：债券	83,438,800.00	22.85
	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	17,287,830.41	4.73
7	其他各项资产	1,270,527.67	0.35
8	合计	365,113,582.11	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	465,003.40	0.13
B	采矿业	6,509,443.79	1.79
C	制造业	116,229,787.93	31.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,229,241.24	3.36
E	建筑业	9,032,612.58	2.48
F	批发和零售业	6,103,190.96	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	5,697,891.67	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,644,789.58	5.40
J	金融业	70,920,855.76	19.51
K	房地产业	10,271,686.89	2.82



L	租赁和商务服务业	1,629,832.36	0.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,707,488.05	0.47
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	2,078,626.52	0.57
S	综合	595,973.30	0.16
	合计	263,116,424.03	72.36

### 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	601318	中国平安	214,886	10,660,494.46	2.93
2	601717	郑煤机	1,200,000	9,060,000.00	2.49
3	600116	三峡水利	600,000	6,726,000.00	1.85
4	603180	金牌厨柜	100,000	6,610,000.00	1.82
5	300409	道氏技术	170,000	6,327,400.00	1.74
6	000630	铜陵有色	2,129,790	6,048,603.60	1.66
7	300577	开润股份	100,000	5,658,000.00	1.56
8	002777	久远银海	80,000	5,568,000.00	1.53
9	300588	熙菱信息	150,000	5,218,500.00	1.44
10	600036	招商银行	203,819	4,873,312.29	1.34
11	600519	贵州茅台	10,216	4,820,419.60	1.33
12	600030	中信证券	260,231	4,429,131.62	1.22
13	601166	兴业银行	262,631	4,427,958.66	1.22
14	300115	长盈精密	150,000	4,377,000.00	1.20
15	300306	远方光电	239,095	4,143,516.35	1.14
16	000651	格力电器	95,340	3,925,147.80	1.08
17	000333	美的集团	89,581	3,855,566.24	1.06
18	600016	民生银行	465,921	3,829,870.62	1.05
19	600782	新钢股份	1,000,000	3,650,000.00	1.00

20	601328	交通银行	541,247	3,334,081.52	0.92
21	000002	万科 A	127,251	3,177,457.47	0.87
22	601688	华泰证券	165,151	2,956,202.90	0.81
23	601668	中国建筑	296,421	2,869,355.28	0.79
24	600000	浦发银行	222,030	2,808,679.50	0.77
25	601288	农业银行	755,557	2,659,560.64	0.73
26	600887	伊利股份	118,632	2,561,264.88	0.70
27	002273	水晶光电	113,771	2,347,095.73	0.65
28	600837	海通证券	155,363	2,307,140.55	0.63
29	601398	工商银行	424,286	2,227,501.50	0.61
30	601169	北京银行	239,974	2,200,561.58	0.61
31	000728	国元证券	176,483	2,156,622.26	0.59
32	000858	五粮液	37,310	2,076,674.60	0.57
33	600104	上汽集团	64,959	2,016,976.95	0.55
34	600900	长江电力	129,965	1,998,861.70	0.55
35	002462	嘉事堂	50,000	1,964,500.00	0.54
36	000725	京东方 A	459,473	1,911,407.68	0.53
37	601211	国泰君安	89,300	1,831,543.00	0.50
38	601766	中国中车	179,202	1,813,524.24	0.50
39	002415	海康威视	53,458	1,726,693.40	0.47
40	600276	恒瑞医药	33,160	1,677,564.40	0.46
41	000001	平安银行	169,156	1,588,374.84	0.44
42	000049	德赛电池	30,000	1,554,300.00	0.43
43	601988	中国银行	417,454	1,544,579.80	0.42
44	600048	保利地产	140,018	1,395,979.46	0.38
45	601390	中国中铁	150,514	1,304,956.38	0.36
46	600518	康美药业	58,988	1,282,399.12	0.35
47	600050	中国联通	171,081	1,277,975.07	0.35
48	601818	光大银行	315,290	1,276,924.50	0.35
49	600028	中国石化	207,198	1,228,684.14	0.34
50	600015	华夏银行	126,331	1,164,771.82	0.32
51	000063	中兴通讯	48,780	1,158,037.20	0.32
52	601186	中国铁建	92,754	1,115,830.62	0.31
53	601989	中国重工	178,126	1,106,162.46	0.30
54	002450	康得新	48,618	1,094,877.36	0.30
55	000166	申万宏源	194,594	1,089,726.40	0.30
56	002304	洋河股份	12,130	1,053,005.30	0.29
57	000776	广发证券	58,081	1,001,897.25	0.28
58	601006	大秦铁路	118,929	997,814.31	0.27

59	001979	招商蛇口	46,447	992,107.92	0.27
60	000538	云南白药	9,796	919,354.60	0.25
61	600690	青岛海尔	60,024	903,361.20	0.25
62	601088	中国神华	38,281	898,837.88	0.25
63	601628	中国人寿	32,947	888,910.06	0.24
64	600585	海螺水泥	38,604	877,468.92	0.24
65	600958	东方证券	61,500	855,465.00	0.24
66	600795	国电电力	231,600	833,760.00	0.23
67	002024	苏宁云商	72,302	813,397.50	0.22
68	601009	南京银行	72,099	808,229.79	0.22
69	600703	三安光电	39,784	783,744.80	0.22
70	600999	招商证券	45,062	775,967.64	0.21
71	600089	特变电工	73,126	755,391.58	0.21
72	000423	东阿阿胶	10,416	748,806.24	0.21
73	601899	紫金矿业	216,456	742,444.08	0.20
74	600309	万华化学	25,723	736,706.72	0.20
75	601857	中国石油	95,364	733,349.16	0.20
76	002142	宁波银行	37,895	731,373.50	0.20
77	002230	科大讯飞	18,121	723,027.90	0.20
78	600009	上海机场	19,160	714,859.60	0.20
79	600660	福耀玻璃	27,401	713,522.04	0.20
80	601985	中国核电	91,300	713,053.00	0.20
81	000568	泸州老窖	13,984	707,310.72	0.19
82	300070	碧水源	37,625	701,706.25	0.19
83	002456	欧菲光	38,392	697,582.64	0.19
84	002241	歌尔股份	36,048	695,005.44	0.19
85	601377	兴业证券	92,735	689,021.05	0.19
86	300072	三聚环保	18,000	666,900.00	0.18
87	002236	大华股份	28,663	653,803.03	0.18
88	601669	中国电建	81,955	649,083.60	0.18
89	000069	华侨城 A	64,394	647,803.64	0.18
90	002736	国信证券	48,700	645,275.00	0.18
91	601607	上海医药	22,149	639,663.12	0.18
92	600886	国投电力	80,710	637,609.00	0.18
93	601901	方正证券	62,763	623,236.59	0.17
94	000783	长江证券	65,224	617,671.28	0.17
95	000338	潍柴动力	46,688	616,281.60	0.17
96	600196	复星医药	19,868	615,709.32	0.17
97	002466	天齐锂业	11,300	614,155.00	0.17

98	300059	东方财富	51,000	613,020.00	0.17
99	600741	华域汽车	24,935	604,424.40	0.17
100	600068	葛洲坝	53,414	600,373.36	0.17
101	600031	三一重工	73,761	599,676.93	0.16
102	600340	华夏幸福	17,482	587,045.56	0.16
103	600010	包钢股份	267,823	586,532.37	0.16
104	600066	宇通客车	26,584	584,050.48	0.16
105	601600	中国铝业	128,398	580,358.96	0.16
106	601888	中国国旅	18,974	571,876.36	0.16
107	601788	光大证券	38,300	571,819.00	0.16
108	002008	大族激光	16,453	569,931.92	0.16
109	600029	南方航空	64,967	565,212.90	0.16
110	600637	东方明珠	25,558	553,841.86	0.15
111	000625	长安汽车	37,921	546,820.82	0.15
112	002594	比亚迪	10,801	539,509.95	0.15
113	601099	太平洋	133,400	536,268.00	0.15
114	000839	中信国安	53,500	534,465.00	0.15
115	601933	永辉超市	74,292	525,987.36	0.14
116	600535	天士力	12,652	525,564.08	0.14
117	600383	金地集团	45,054	516,769.38	0.14
118	600649	城投控股	48,864	513,560.64	0.14
119	600705	中航资本	87,886	496,555.90	0.14
120	300124	汇川技术	19,435	496,369.90	0.14
121	000100	TCL 集团	144,017	493,978.31	0.14
122	000768	中航飞机	26,721	492,735.24	0.14
123	002673	西部证券	34,484	490,362.48	0.13
124	600816	安信信托	36,080	490,327.20	0.13
125	600109	国金证券	41,802	489,919.44	0.13
126	600100	同方股份	34,660	489,399.20	0.13
127	601800	中国交建	30,731	488,315.59	0.13
128	600111	北方稀土	42,902	486,079.66	0.13
129	601618	中国中冶	96,973	485,834.73	0.13
130	000963	华东医药	9,756	484,873.20	0.13
131	002475	立讯精密	16,492	482,226.08	0.13
132	601111	中国国航	49,312	480,792.00	0.13
133	002202	金风科技	30,542	472,484.74	0.13
134	601555	东吴证券	41,439	465,359.97	0.13
135	002739	万达电影	9,100	463,827.00	0.13
136	000895	双汇发展	19,395	460,631.25	0.13

137	600570	恒生电子	9,556	446,074.08	0.12
138	600271	航天信息	21,528	444,337.92	0.12
139	601018	宁波港	77,696	438,982.40	0.12
140	600153	建发股份	33,799	437,021.07	0.12
141	600023	浙能电力	79,863	436,051.98	0.12
142	600177	雅戈尔	42,447	429,563.64	0.12
143	600739	辽宁成大	23,767	428,519.01	0.12
144	600352	浙江龙盛	44,854	427,458.62	0.12
145	600674	川投能源	43,494	427,111.08	0.12
146	600547	山东黄金	14,576	421,683.68	0.12
147	000623	吉林敖东	18,322	419,390.58	0.12
148	300024	机器人	21,487	418,996.50	0.12
149	600221	海航控股	126,971	408,846.62	0.11
150	600893	航发动力	14,854	405,514.20	0.11
151	600018	上港集团	63,756	404,213.04	0.11
152	002065	东华软件	18,501	403,136.79	0.11
153	002007	华兰生物	10,994	401,281.00	0.11
154	000793	华闻传媒	39,218	396,886.16	0.11
155	002252	上海莱士	19,582	396,339.68	0.11
156	601919	中远海控	73,900	395,365.00	0.11
157	600804	鹏博士	21,966	389,896.50	0.11
158	600415	小商品城	53,800	389,512.00	0.11
159	600115	东方航空	56,969	387,389.20	0.11
160	000157	中联重科	86,212	387,091.88	0.11
161	601998	中信银行	61,352	385,904.08	0.11
162	000540	中天金融	55,500	385,725.00	0.11
163	600085	同仁堂	10,944	382,602.24	0.11
164	600820	隧道股份	37,600	379,760.00	0.10
165	600606	绿地控股	48,200	376,924.00	0.10
166	603993	洛阳钼业	74,353	376,226.18	0.10
167	601198	东兴证券	21,800	375,832.00	0.10
168	000826	启迪桑德	10,193	357,978.16	0.10
169	002310	东方园林	21,200	354,464.00	0.10
170	600406	国电南瑞	20,069	354,217.85	0.10
171	600157	永泰能源	99,208	354,172.56	0.10
172	600663	陆家嘴	14,507	342,945.48	0.09
173	000709	河钢股份	81,813	342,796.47	0.09
174	000009	中国宝安	42,370	342,773.30	0.09
175	600489	中金黄金	34,100	342,023.00	0.09

176	002081	金螳螂	31,090	341,368.20	0.09
177	000876	新希望	41,096	337,809.12	0.09
178	600061	国投安信	21,700	337,435.00	0.09
179	000060	中金岭南	29,254	327,644.80	0.09
180	000413	东旭光电	29,027	325,682.94	0.09
181	600959	江苏有线	30,800	325,556.00	0.09
182	600332	白云山	11,090	322,053.60	0.09
183	000503	海虹控股	12,867	320,774.31	0.09
184	600170	上海建工	83,451	318,782.82	0.09
185	600297	广汇汽车	41,990	316,184.70	0.09
186	601155	新城控股	16,900	313,326.00	0.09
187	600369	西南证券	55,614	311,994.54	0.09
188	601633	长城汽车	23,438	311,491.02	0.09
189	600118	中国卫星	11,167	310,889.28	0.09
190	000425	徐工机械	82,445	309,168.75	0.09
191	600718	东软集团	19,872	309,009.60	0.08
192	600208	新潮中宝	67,808	305,136.00	0.08
193	601333	广深铁路	66,780	301,845.60	0.08
194	600150	中国船舶	13,115	299,940.05	0.08
195	002465	海格通信	27,742	297,949.08	0.08
196	000559	万向钱潮	27,563	292,719.06	0.08
197	600688	上海石化	43,529	287,726.69	0.08
198	601727	上海电气	37,598	284,616.86	0.08
199	002074	国轩高科	8,800	277,640.00	0.08
200	000402	金融街	23,596	276,545.12	0.08
201	000686	东北证券	27,293	274,294.65	0.08
202	600362	江西铜业	16,156	272,390.16	0.07
203	601225	陕西煤业	38,491	272,131.37	0.07
204	601718	际华集团	30,900	271,611.00	0.07
205	600583	海油工程	43,308	270,241.92	0.07
206	000983	西山煤电	30,500	267,485.00	0.07
207	300027	华谊兄弟	32,830	265,594.70	0.07
208	600498	烽火通信	10,400	263,640.00	0.07
209	300017	网宿科技	21,816	263,319.12	0.07
210	600008	首创股份	39,656	260,936.48	0.07
211	600256	广汇能源	62,878	260,314.92	0.07
212	600373	中文传媒	10,814	254,237.14	0.07
213	600666	奥瑞德	14,560	253,344.00	0.07
214	600895	张江高科	15,000	253,200.00	0.07

215	002385	大北农	40,171	252,675.59	0.07
216	000415	渤海金控	37,400	251,702.00	0.07
217	600704	物产中大	34,500	251,505.00	0.07
218	002146	荣盛发展	25,406	250,757.22	0.07
219	600074	保千里	19,500	249,795.00	0.07
220	600588	用友网络	14,589	249,763.68	0.07
221	601216	君正集团	50,724	248,040.36	0.07
222	000917	电广传媒	21,892	247,379.60	0.07
223	002183	怡亚通	28,200	243,366.00	0.07
224	300315	掌趣科技	29,800	243,168.00	0.07
225	600827	百联股份	14,864	241,540.00	0.07
226	600060	海信电器	15,558	236,014.86	0.06
227	002195	二三四五	32,980	235,807.00	0.06
228	300144	宋城演艺	11,117	232,011.79	0.06
229	002470	金正大	30,752	231,562.56	0.06
230	600376	首开股份	20,200	231,088.00	0.06
231	002714	牧原股份	8,300	225,926.00	0.06
232	000792	盐湖股份	21,559	225,291.55	0.06
233	601866	中远海发	62,410	224,676.00	0.06
234	600038	中直股份	4,865	222,671.05	0.06
235	002174	游族网络	6,900	219,144.00	0.06
236	601872	招商轮船	41,300	213,108.00	0.06
237	002500	山西证券	22,236	213,020.88	0.06
238	002129	中环股份	25,404	210,091.08	0.06
239	000977	浪潮信息	12,000	207,840.00	0.06
240	300168	万达信息	14,200	206,610.00	0.06
241	000627	天茂集团	25,300	204,424.00	0.06
242	002426	胜利精密	26,500	203,520.00	0.06
243	002152	广电运通	24,450	203,179.50	0.06
244	600037	歌华有线	13,800	200,928.00	0.06
245	000750	国海证券	36,286	199,573.00	0.05
246	600737	中粮糖业	20,900	197,296.00	0.05
247	600021	上海电力	16,200	195,858.00	0.05
248	000938	紫光股份	3,100	189,472.00	0.05
249	300182	捷成股份	19,200	183,552.00	0.05
250	600685	中船防务	6,600	180,708.00	0.05
251	600372	中航电子	10,373	180,179.01	0.05
252	600446	金证股份	10,200	179,316.00	0.05
253	002292	奥飞娱乐	10,546	178,227.40	0.05

254	600482	中国动力	7,000	177,030.00	0.05
255	000738	航发控制	9,000	176,130.00	0.05
256	002027	分众传媒	12,600	173,376.00	0.05
257	002049	紫光国芯	5,600	172,592.00	0.05
258	000156	华数传媒	11,185	166,768.35	0.05
259	601021	春秋航空	4,900	164,787.00	0.05
260	002424	贵州百灵	8,600	162,196.00	0.04
261	300133	华策影视	13,925	155,960.00	0.04
262	002153	石基信息	6,564	149,199.72	0.04
263	601877	正泰电器	7,400	148,666.00	0.04
264	000718	苏宁环球	24,800	145,328.00	0.04
265	002131	利欧股份	43,750	143,937.50	0.04
266	300251	光线传媒	17,502	143,341.38	0.04
267	601608	中信重工	25,700	142,378.00	0.04
268	601958	金钼股份	18,566	133,118.22	0.04
269	601118	海南橡胶	22,980	130,526.40	0.04
270	601611	中国核建	10,400	124,488.00	0.03
271	600871	石化油服	35,900	119,906.00	0.03
272	000008	神州高铁	16,300	118,664.00	0.03
273	002299	圣农发展	7,300	108,551.00	0.03
274	600188	兖州煤业	7,257	88,825.68	0.02
275	000555	神州信息	5,100	85,170.00	0.02
276	002797	第一创业	8,000	73,680.00	0.02
277	601127	小康股份	2,700	53,865.00	0.01
278	000671	阳光城	5,400	31,428.00	0.01
279	600485	信威集团	1,238	18,062.42	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	601717	郑煤机	11,469,984.46	3.09
2	002777	久远银海	9,162,911.76	2.47
3	000980	众泰汽车	8,246,835.98	2.22
4	600764	中电广通	8,074,178.00	2.17
5	300577	开润股份	7,608,259.53	2.05
6	002597	金禾实业	7,411,006.53	1.99
7	002599	盛通股份	7,297,071.83	1.96
8	603180	金牌厨柜	7,216,710.00	1.94
9	600116	三峡水利	7,027,063.00	1.89
10	002221	东华能源	6,417,625.00	1.73
11	300409	道氏技术	6,389,205.67	1.72
12	000630	铜陵有色	5,645,506.00	1.52
13	002712	思美传媒	5,147,702.88	1.39
14	300588	熙菱信息	4,964,262.00	1.34
15	002094	青岛金王	4,917,513.30	1.32
16	300115	长盈精密	4,250,159.00	1.14
17	300422	博世科	3,993,983.70	1.08
18	600123	兰花科创	3,902,727.00	1.05
19	600691	阳煤化工	3,868,694.56	1.04
20	002554	惠博普	3,507,946.00	0.94

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	002712	思美传媒	11,994,281.10	3.23
2	300078	思创医惠	8,956,240.34	2.41
3	002777	久远银海	8,951,732.30	2.41
4	300129	泰胜风能	8,799,825.18	2.37
5	000980	众泰汽车	8,532,247.17	2.30
6	002597	金禾实业	8,213,440.28	2.21
7	300409	道氏技术	8,192,267.76	2.21
8	600764	中电广通	8,006,350.54	2.16
9	300377	赢时胜	7,935,386.89	2.14
10	002094	青岛金王	7,501,295.93	2.02
11	603678	火炬电子	7,309,198.41	1.97
12	002599	盛通股份	6,353,671.65	1.71
13	603008	喜临门	5,429,060.00	1.46
14	002221	东华能源	5,197,074.39	1.40
15	300188	美亚柏科	5,128,038.70	1.38
16	300417	南华仪器	4,915,125.00	1.32
17	603729	龙韵股份	4,495,076.41	1.21
18	600691	阳煤化工	3,999,984.00	1.08
19	600123	兰花科创	3,999,558.67	1.08
20	300422	博世科	3,977,753.22	1.07

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	230,405,088.80
卖出股票收入（成交）总额	216,092,874.42

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	23,588,800.00	6.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,850,000.00	16.46
	其中：政策性金融债	59,850,000.00	16.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,438,800.00	22.95

**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	010107	21 国债(7)	230,000	23,588,800.00	6.49
2	140378	14 进出 78	200,000	19,998,000.00	5.50
3	100412	10 农发 12	200,000	19,898,000.00	5.47
4	150406	15 农发 06	100,000	9,992,000.00	2.75
5	170401	17 农发 01	100,000	9,962,000.00	2.74

**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**

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。

### **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	64,158.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,204,325.92
5	应收申购款	2,043.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,270,527.67

### 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

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	601717	郑煤机	9,060,000.00	2.49	重大资产重组

## § 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
12,170	15,809.73	677,506.03	0.35%	191,726,939.06	99.65%

### 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	11,033.81	0.0057%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年7月15日）基金份额总额	1,067,242,501.27
本报告期期初基金份额总额	200,956,558.28
本报告期基金总申购份额	1,973,229.80
减：本报告期基金总赎回份额	10,525,342.99
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	192,404,445.09

注：总申购份额含红利再投、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

本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(2003 年 7 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,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	
中信建投	1	256,584,542.61	57.68%	238,957.68	57.68%	-
平安证券	1	132,937,086.05	29.89%	123,803.97	29.88%	-
中银国际	1	34,665,538.30	7.79%	32,284.27	7.79%	-
华泰证券	1	20,640,223.39	4.64%	19,222.30	4.64%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国元证券	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：财力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，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、本报告期租用的证券公司交易单元没有变化。

## 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	13,796,720.11	100.00%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

## 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》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017年5月15日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017年5月12日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017年4月24日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017年4月19日
5	华宝兴业基金公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券股份有	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2017年4月10日

	限公司申购费率优惠的公告	以及基金管理人网站	
6	华宝兴业基金公司关于旗下部分开放式基金参加工商银行股份有限公司申购费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017 年 4 月 10 日
7	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定投金额下限的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017 年 3 月 4 日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》以及基金管理人网站	2017 年 2 月 23 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；  
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同；  
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书；  
华宝兴业宝康系列开放式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办公场所备投资者查阅。

### 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