华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

2017 第二季度 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
报告送出日期:2017年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
报告期末基金份额总额	137,276,356.09份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
下属分级基金的交易代码	240012	240013
报告期末下属分级基金的份额总额	126,335,212.26份	10,941,143.83份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年4月1日－2017年6月30日)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1.本期已实现收益	-1,095,859.85	-91,912.14
2.本期利润	656,196.11	52,209.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0045
4.期末基金资产净值	138,963,897.51	11,527,082.62
5.期末基金份额净值	1.1000	1.0536

注:1.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。

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华宝兴业增强收益债券A

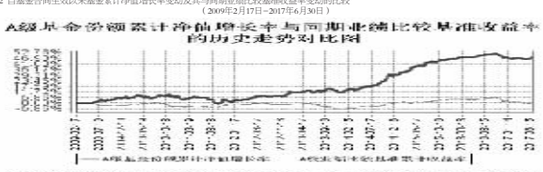
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.59%	0.06%	-1.04%	0.11%	1.63%	-0.05%

华宝兴业增强收益债券B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.06%	-1.04%	0.11%	1.54%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

(2009年2月17日-2017年6月30日)



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2009年8月16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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、华宝新动力混合、华宝新起点混合、华宝新动力混合、华宝新飞跃混合、华宝新回报混合、华宝新优选混合、华宝新优享混合基金经理	2014年10月11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洋产管理有限公司从事固定收益的研究和投资,2010年9月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师,2010年12月至2011年6月任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理助理,2011年6月起担任华宝兴业宝康债券投资基金基金经理,2014年10月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2015年10月兼任华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)和华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年4月兼任华宝兴业宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金经理。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。

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遵规守信情况的说明

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、《华宝兴业增强收益债券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 公平交易专项说明

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投权、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,分析了本基金与公司旗下所有其他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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年1-5月份,固定资产累计投资完成额同比增长8.6%,1季度累计增速高幅反弹,但进入2季度开始回落。其中,制造业投资同比增长5.1%,增速提高0.2个百分点;房地产开发投资同比名义增长8.8%,比1-4月份累计值回落0.5个百分点;基础设施投资同比增长20.9%,比前值回落2.4个百分点。1-5月份出口金额累计同比增长8.2%,出口交货于海外经济好转而上升,1-5月份进口金额累计同比上升19.8%。1-5月份社会消费品零售总额累计同比增长10.3%,比前值提高0.4个百分点。物价水平呈现分化,CPI水平较为温和,PPI明显上升,PPI同CPI的传导仍不畅。1-5月份CPI累计同比增长1.3%,5月份同比增长1.5%,延续温和上行;1-5月份PPI累计同比增速6.8%,5月份PPI同比增速为5.5%,增速在2季度逐月小幅回落。2季度央行货币政策在边际上有所放松,在6月初就续作MLF,结合公开市场净投放,使市场度过了一个较为平稳的半年末,直到6月下旬逐渐转为连续净回笼,进入2季度受金融去杠杆影响,企业债券融资大幅减少,非标融资维持低位,拖累社会融资总量下降,但信用投放仍保持平稳。

2季度债券市场受到金融监管升级重创,银行表外大量顺回加剧了资金面紧张,收益率在4月快速上行,5月区间震荡小幅下行,进入6月伴随央行对半年末资金面超预期呵护和监管暂稳,债市出现一波明显的修复行情,直到月末最后一周伴随公开市场连续净回笼,加之经济数据未如市场预期出现走弱迹象,反而显示出短期呈现一定韧性,债市利率重回震荡上行。

2季度股票市场总体呈现先抑后扬走势,4-5连续录得降幅,6月有所反弹,但仍未回到1季度末的位置。期间不乏一些重要事件,如4月雄安新区横空出世,5月一带一路峰会胜利召开,证监会发布减持新规,6月A股被纳入MSCI。市场结构性行情较为突出,不同指数和行业之间分化较为明显,背后是估值约均值回归和业绩支撑的双重作用。中小板、创业板的回落正是对前期高成长预期的去伪存真,同时在存量博弈的经济中,业绩支撑使得蓝筹白马股估值进一步提升。

可转债市场震荡上行,5月证监会发布转债打新新规,将改为信用申购,旨在解决转债和EB发行过程中大规模资金冻结对市场造成的流动性冲击,伴随股市债市的上涨,6月转债指数录得5.02%的涨幅。由于个券涨幅偏离正股涨幅率以持续,本轮转债市场反弹时间和空间可能较为有限,后续仍将回到结构性行情,市场博弈难度将增大。

2季度基金踏板了债券的投资比例和久期,6月份再度提高了债券投资比例和久期。4月份及降低了股票投资比例,在随后的反弹中没有及时加大股票投资比例,导致基金净值在2季度表现不佳。管理人需要强化行业配置和个股选择能力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内增强收益A基金份额净值增长率为0.59%,同期业绩比较基准收益率为-1.04%;增强收益B基金份额净值增长率为0.50%,同期业绩比较基准收益率为-1.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,775,005.14	9.94
	其中:股票	17,775,005.14	9.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	153,344,349.20	85.76
	其中:债券	153,344,349.20	85.76
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,625,258.46	2.59
8	其他资产	3,051,383.86	1.71
9	合计	178,795,996.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,358,712.00	0.90
C	制造业	7,330,188.74	4.87
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	1,692,104.40	1.12
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	1,356,000.00	0.90
J	金融业	2,466,000.00	1.64
K	房地产业	2,364,000.00	1.57
L	租赁和商务服务业	1,208,000.00	0.80
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	17,775,005.14	11.81

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	300,000	2,466,000.00	1.64
2	600426	华鲁恒升	203,551	2,389,688.74	1.59
3	600663	陆家嘴	100,000	2,364,000.00	1.57
4	000028	国药一致	20,916	1,692,104.40	1.12
5	000999	华润三九	50,000	1,587,500.00	1.05
6	600332	白云山	50,000	1,452,000.00	0.96
7	600273	嘉化能源	150,000	1,407,000.00	0.93
8	600348	阳泉煤业	200,400	1,358,712.00	0.90
9	300383	光环新网	100,000	1,356,000.00	0.90
10	002127	南极电商	100,000	1,208,000.00	0.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,084,512.10	33.28
	其中:政策性金融债	40,376,512.10	26.83
4	企业债券	103,259,837.10	68.62
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	153,344,349.20	101.90

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018003	国开1401	172,990	20,030,512.10	13.31
2	122049	10营口港	138,520	13,973,897.60	9.29
3	122355	14乔鲁债	138,000	13,902,120.00	9.24
4	122941	10滨城投	130,000	13,423,800.00	8.92
5	122819	11常城建	130,000	13,156,000.00	8.74

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

增强收益基金截至2017年6月30日持仓前十名证券中的14券鲁债(122355)发行主体中泰证券股份有限公司于2016年12月19日收到中国证监会行政监管措施决定书。因公司未完整履行对发行人信市贷金的核查程序,对交易对方的产权和控制关系核查不充分,对交易对方持股信息出具的专业意见有失完整,决定对中泰证券股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对债券的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	137,970.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,907,254.75
5	应收申购款	6,158.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,051,383.86

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002127	南极电商	1,208,000.00	0.80	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
报告期期初基金份额总额	164,792,830.73	12,376,347.05
报告期期间基金总申购份额	30,730,894.89	421,211.86
减:报告期期间基金总赎回份额	69,188,513.36	1,856,415.08
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	126,335,212.26	10,941,143.83

注:总申购份额含转入份额;总赎回份额含转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1.1 基金管理人持有A基金份额变动情况

单位:份

项目	华宝兴业增强收益债券A
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,798,891.84
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,798,891.84
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.42

7.1.2 基金管理人持有B基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资该份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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
	1	20170401-20170630	67,230,738.20	-	-	67,230,738.20	48.97
机构	2	20170525-20170630	32,969,317.72	-	-	32,969,317.72	24.02
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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业增强收益债券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。

9.2 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。

9.3 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7月20日

华宝兴业中证100指数证券投资基金

2017 第二季度 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
报告送出日期:2017年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证100指数
基金主代码	240014
交易代码	240014
前端交易代码	240014
后端交易代码	240015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	570,637,415.49份
投资目标	本基金通过指数化投资,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证100指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证100指数收益率x95%+银行同业存款收益率x5%。
风险收益特征	本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年4月1日－2017年6月30日)
1.本期已实现收益	4,906,018.35
2.本期利润	64,238,226.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.1151
4.期末基金资产净值	680,482,238.91
5.期末基金份额净值	1.1925

注:1.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。

2.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。

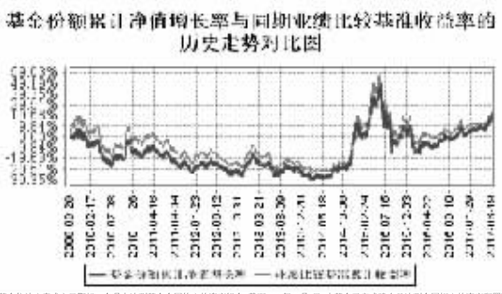
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.65%	0.62%	9.26%	0.62%	1.39%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

(2009年9月29日至2017年6月30日)



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2009年11月6日,本基金已完成建仓且达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈建华	本基金基金经理、华宝兴业事件驱动混合、华宝智慧产业混合、华宝第三产业混合基金经理	2012年12月22日	-	16年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作,2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理助理,兼任华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理,2012年12月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2015年4月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理,2017年5月任华宝兴业智慧产业灵活配置混合型证券投资基金和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遵规守信情况的说明

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、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证100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申购赎回引起的基金资产规模变化,中证100指数证券投资基金在短期内出现过较大幅度的偏离度,存在基金净值表现不佳的情况。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 公平交易专项说明

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投权、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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度A股先抑后扬,总体表现平稳,以蓝筹股和白马成长股为代表的大盘股整体走势强劲,沪深300指数二季度上涨6.10%。主要原因还在于中国经济企稳,投资者对蓝筹股和白马成长股的业绩增长有良好预期,因此此类股票表现优良。与之相对应的,A股互联网板块中的绩优股二季度也走出上扬行情,中证A股互联网指数四季度涨3.2%。而海外,美股中概怀随着纳斯达克牛市大幅度上扬,而港股以腾讯为代表的科技蓝筹股也延续了一季度的强劲走势,因此中证海外互联网指数录11.0%,超过了A股的涨幅。二季度考虑到市场仍然处于震荡期间,因此基金投资比较谨慎,仓位控制的比较低。A股选股上还是以确定性比较高的白马成长股为主,取得了一定的正收益。但是整体仓位还是以偏海外投资为主。

海外部分,二季度特朗普新政预期继续降温。4月中美两国首脑会晤之后简定中美双方推动经贸合作"百日计划",两国之间发生贸易战的风险大大下降,人民币兑美元贬值担忧缓解。法国大选中有"脱欧"倾向的极右势力未能获胜,欧元区投资者情绪回升。美国科技股龙头业绩超出市场预期,推动纳斯达克指数继续上涨,带动海外中资互联网公司继续估值修复。同时腾讯、阿里巴巴、微博、网易等龙头股业绩超预期,带动股价望著上涨。我们二季度增持了受益于双摄像头普及率提升的手机零部件类股和受益于苹果手机新机型下半年推出的苹果产业链类股。

截止至本报告期末(2017年6月26日基金清算日),本报告期内基金份额净值增长率为7.12%,同期业绩比较基准收益率为8.75%,基金表现弱于业绩比较基准1.63%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金基金资产净值低于五千万元,存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已于2017年6月23日发布《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证100指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金已于2017年6月26日进入清算流程。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	646,132,486.80	94.74
	其中:股票	646,132,486.80	94.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,874,137.77	5.11
8	其他资产	981,667.15	0.14
9	合计	681,988,291.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按证券行业分类的境内股票投资组合

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	19,039,847.83	2.80
C	制造业	191,841,018.19	28.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,102,200.66	2.81
E	建筑业	33,055,500.92	4.86
F	批发和零售业	3,946,376.25	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	13,277,114.19	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,836,077.56	2.33
J	金融业	305,277,389.04	44.86
K	房地产业	36,086,645.30	5.30
L	租赁和商务服务业	2,189,284.80	0.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,715,027.22	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,273,262.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	645,639,743.96	94.88

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	446,324.98	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,778.24	0.01
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	7,639.62	0.00
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	492,742.84	0.07

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,027,828	50,990,547.08	7.49
2	600036	招商银行	976,367	23,344,934.97	3.43
3	600519	贵州茅台	47,632	22,475,159.20	3.30
4	601166	兴业银行	1,193,427	20,121,179.22	2.96
5	000651	格力电器	457,678	18,842,603.26	2.77
6	000333	美的集团	427,811	18,412,985.44	2.71
7	600016	民生银行	2,237,897	18,395,513.34	2.70
8	000002	万科A	644,433	16,091,492.01	2.36
9	601328	交通银行	2,597,140	15,998,382.40	2.35
10	601668	中国建筑	1,391,005	13,464,928.40	1.98

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
2	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
3	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
4	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
5	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01

5.4 报告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。

5.5 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