

# 华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金		
基金简称	华宝兴业中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
基金主代码	162413		
交易代码	162413		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 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	173,967,475.30 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-16		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
下属分级基金的场内简称	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金份额总额	7,765,201.00 份	7,765,201.00 份	158,437,073.30 份

### 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最小化。在正常情况下，本基金力争将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绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	<p>本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将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绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p> <p>在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p>

业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。	华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国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

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-124,557,018.36
本期利润	-133,451,005.28
加权平均基金份额本期利润	-0.7229

本期加权平均净值利润率	-76.83%
本期基金份额净值增长率	-38.97%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2015 年末</b>
期末可供分配利润	-129,672,978.28
期末可供分配基金份额利润	-0.7454
期末基金资产净值	180,189,971.89
期末基金份额净值	1.0358
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2015 年末</b>
基金份额累计净值增长率	-38.97%

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	29.87%	1.94%	35.30%	2.09%	-5.43%	-0.15%
过去六个月	-20.67%	3.14%	-6.08%	3.21%	-14.59%	-0.07%
自基金合同生效日起至 今	-38.97%	3.23%	-24.63%	3.26%	-14.34%	-0.03%

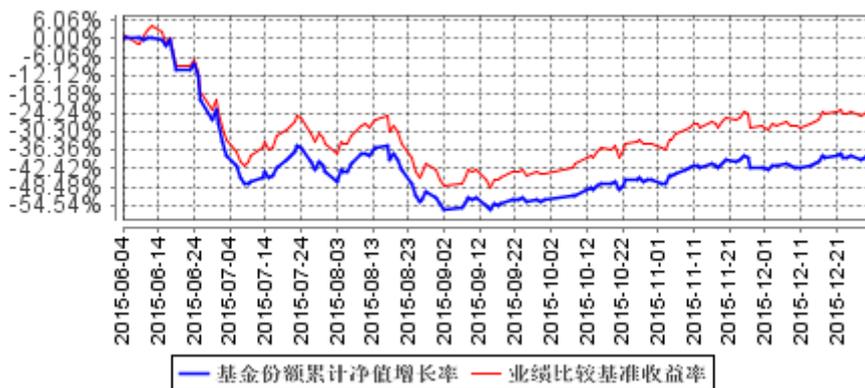
注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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

(2015 年 6 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日)

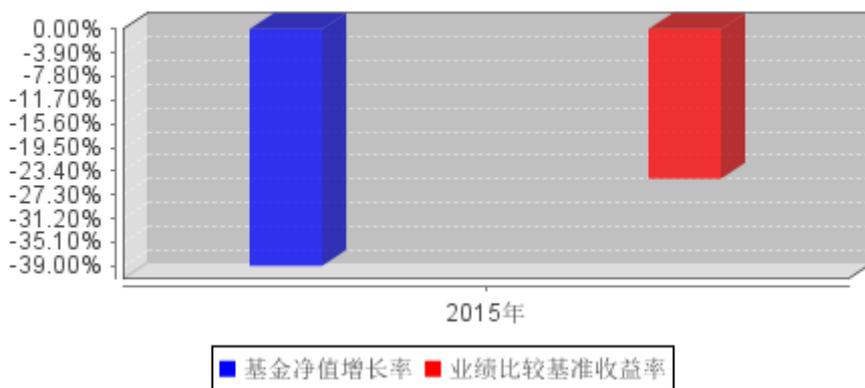
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2015 年 6 月 4 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。  
2、按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金本年度未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2015 年 12 月 31 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业中国互联网和华宝兴业转型升级基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 182,703,481,955.16 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		
胡洁	本基金基金经理、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基金经理	2015 年 6 月 4 日	-	9 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任华宝兴业上证 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。2015 年 5 月起任华宝兴业中证医

					疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任华宝兴业中证 1000 指数分级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、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金合同》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 1000 指数分级证券投资基金出现了股票资产占基金资产净值比低于 90%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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞

价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

2015 年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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，分析了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；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）

发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。

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

2015 年 A 股市场经历了暴涨暴跌的过山车行情，波动幅度空前。上半年，在宽松货币政策和经济转型升级预期的推动下，国企改革、重组并购、互联网、券商等热点板块轮番启动，市场整体呈现单边上涨走势，上证综指的最高涨幅超过 60%，创业板指的最高涨幅更是达到 174%。随着监管层 6 月开始清查场外配资拉开了去杠杆的序幕，A 股市场风云突变，在短短 2 个多月的时间内，上证综指的调整幅度达到 45%，各个板块悉数下跌，行业共性显著上升，大盘数次上演千股涨停、千股跌停的前所未见的场面，上半年单边上涨所累计的风险集中释放。9 月，由于市场风险得到大幅释放，利好政策轮番上阵，市场迎来暴跌后的技术性反弹，之前调整幅度较深的中小板、创业板股票反弹力度较大。随后市场转入振荡寻底阶段。指数方面，中小盘股指数总体表现显著强于大盘蓝筹股指数。其中以创业板指和中小板指为代表的中小盘指数位居涨幅前列，全年分别上涨了 84.41% 和 53.70%，而以沪深 300 和中证 100 指数为代表的大盘蓝筹股指数同期涨跌幅分别为 5.58% 和 -1.52%。

本基金成立于 2015 年 6 月 4 日，本报告期涵盖了基金的建仓期。在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，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 1.0358 元，本报告期内基金份额净值增长率为 -38.97%，同期业绩比较基准增长率为 -24.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外方面，2015 年美国复苏的势头放缓，欧元区经济得到逐步改善，日本表现平稳，而主要新兴市场国家经济持续表现疲软。预计 2016 年全球经济将继续缓慢复苏，目前来看全球经济复苏的主要风险是需求低迷、大宗商品熊市带来的通缩压力，以及美国与其他地区的货币政策分

化。国内市场，中国经济增速将进一步探底，我们对中国经济的企稳复苏抱有信心。中央经济工作会议提出 2016 年去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大结构性改革重点任务。随着供给侧改革信号的释放，结构调整步伐将加快，稳增长底线放宽，未来积极财政政策力度有望加大，以托底经济，为转型去化提供条件。货币政策以降准及定向工具为主，将继续维持流动性宽松，有序控制汇率波动及资本流动，人民币汇率贬值空间有限。资本市场在经历了 2015 年下半年的大幅调整和较长时间的震荡整固后，风险释放较为充分。中证 1000 指数是小市值股票组合的代表，其成份股为中证 800 指数样本股之外综合考虑规模和流动性选取 1000 只股票，全面覆盖了计算机、医药生物、机械设备、化工、电子、房地产、有色金属等 28 个行业。作为小盘宽基指数的代表，中证 1000 指数的小盘风格特征明显，投资者可以通过投资中证 1000 指数在大小盘风格轮动的结构性机会中把握小盘股投资机会。中长期来看，“大众创业、万众创新”经济转型与改革的战略将继续给小市值的股票带来高成长性，伴随这些经济转型与改革的措施真正开始释放红利，小市值公司的创新潜能将不断被挖掘，小盘股未来潜力大，投资价值明显。

本基金为分级基金，为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具。作为指数基金的管理人，我们将严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成份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，实现对中证 1000 指数的有效跟踪。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人承诺书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展

不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2015 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，不断加强了防控内幕交易等行为的稽核力度；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款		13,943,193.59

结算备付金		266,900.57
存出保证金		164,756.91
交易性金融资产		170,287,578.29
其中：股票投资		170,287,578.29
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		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息		3,414.32
应收股利		-
应收申购款		51,297.13
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		184,717,140.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 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		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,757,175.38
应付赎回款		77,404.07
应付管理人报酬		149,128.30
应付托管费		32,808.25
应付销售服务费		-
应付交易费用		270,361.23
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		240,291.69
负债合计		4,527,168.92
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		295,270,982.70
未分配利润		-115,081,010.81
所有者权益合计		180,189,971.89
负债和所有者权益总计		184,717,140.81

注：

1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，华宝中证 1000 份额基金份额净值 1.0358 元，基金份额总额

158,437,073.30 份；华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0024 元，基金份额总额 7,765,201.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额净值 1.0692 元，基金份额总额 7,765,201.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-130,969,927.95
1.利息收入		186,879.21
其中：存款利息收入		186,879.21
债券利息收入		-
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）		-122,460,859.48
其中：股票投资收益		-122,638,685.64
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		177,826.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-8,893,986.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		198,039.24
<b>减：二、费用</b>		2,481,077.33
1. 管理人报酬		982,595.93
2. 托管费		216,171.08
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		919,831.82
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		362,478.50

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-133,451,005.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-133,451,005.28

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	330,711,104.54	-	330,711,104.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-133,451,005.28	-133,451,005.28
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）	-35,440,121.84	18,369,994.47	-17,070,127.37
其中：1. 基金申购款	212,083,623.68	-71,742,143.10	140,341,480.58
2. 基金赎回款	-247,523,745.52	90,112,137.57	-157,411,607.95
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）	295,270,982.70	-115,081,010.81	180,189,971.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金(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[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 330,638,859.16 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售,按照每份基金份额 1.00 元计算,本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额,其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。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《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华宝中证 1000 基础份额”)、华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华宝中证 1000A 份额”)和华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华宝中证 1000B 份额”)。本基金基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的份额配对转换业务,包括分拆与合并。申请进行分拆的华宝中证 1000 基础份额的场内份额数必须为偶数;申请进行合并的华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额必须同时配对申请,且基金份额数必须为整数且相等。基金份额定期折算的频率为每年折算一次。定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元。当达到不定期折算条件(即华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值达到 1.5000 元以上,或华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值跌至 0.2500 元或以下)时,本基金将分别对华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额进行份额折算,份额折算后华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的份额配比将保持为 1:1,份额折算后华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。

基金合同生效后,华宝中证 1000 基础份额只可以进行场内与场外的申购和赎回,不上市交易;

华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]第 272 号文审核同意，本基金 58,883,164.00 份基金份额（截至 2015 年 6 月 9 日）于 2015 年 6 月 16 日在深圳证券交易所挂牌交易（其中华宝中证 1000A 份额为 29,441,582.00 份，华宝中证 1000B 份额为 29,441,582.00 份）。

截至 2015 年 7 月 3 日，华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值为 0.2317 元，达到基金合同约定的不定期份额折算条件，本基金以 2015 年 7 月 6 日为不定期折算基准日办理份额折算业务。另外，本基金以 2015 年 12 月 15 日为定期折算基准日办理份额结算业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券和货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率  $\times$  95% + 同期银行活期存款利率（税后） $\times$  5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2016 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会

计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；

对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在存续期内，本基金(包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额)不进行收益分配。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“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
宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝钢集团控制的公司

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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	982,595.93
其中：支付销售机构的客户维护费	358,760.46

注：支付基金管理人 华宝兴业 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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×1.00%/当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	216,171.08

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 0.22% 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 × 0.22% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.8.5 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 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,943,193.59	179,212.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.9.2 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
600375	华菱星马	2015-11-18	重大资产重组	7.73	2016-03-23	6.96	11,600	156,163.01	89,668.00	-
600714	金瑞矿业	2015-12-02	重大资产重组	11.84	2016-03-04	13.02	3,800	56,699.80	44,992.00	-
600781	辅仁药业	2015-09-23	重大资产重组	19.36	2016-01-06	21.30	2,800	49,073.51	54,208.00	-
601996	丰林集团	2015-12-10	重大资产重组	9.12	未知	未知	7,700	102,161.17	70,224.00	-
600106	重庆路桥	2015-08-31	重大资产重组	10.54	2016-01-11	11.00	15,500	223,618.78	163,370.00	-
600133	东湖高新	2015-12-28	重要事项未公告	12.10	2016-01-12	10.89	15,800	159,024.78	191,180.00	-
600168	武汉控股	2015-10-08	重大资产重组	9.68	未知	未知	5,500	61,304.69	53,240.00	-
600237	铜峰电子	2015-09-29	重大资产重组	5.73	2016-01-27	6.30	11,000	150,684.29	63,030.00	-
600354	敦煌种业	2015-12-15	重大资产重组	9.88	2016-01-19	8.89	11,200	95,547.46	110,656.00	-
600420	现代制药	2015-10-21	重大资产重组	41.76	2016-03-23	33.44	3,900	152,007.73	162,864.00	-
600469	风神股份	2015-12-28	重大事项	17.19	未知	未知	7,000	103,344.68	120,330.00	-
600502	安徽水利	2015-10-20	重大资产重组	13.67	未知	未知	9,100	177,234.35	124,397.00	-
600565	迪马股份	2015-12-30	重要事项未公告	11.68	2016-01-07	11.03	43,800	558,004.63	511,584.00	-
600568	中珠控股	2015-12-30	重要事项未公告	23.94	2016-01-08	21.55	6,300	137,897.31	150,822.00	-
600595	中孚实业	2015-12-29	重要事项未公告	7.05	2016-01-19	6.35	32,500	218,276.02	229,125.00	-
600682	南京新百	2015-07-01	重大资产重组	32.98	2016-01-27	33.78	22,900	990,572.77	755,242.00	-
600740	山西焦化	2015-12-30	重要事项未公告	6.49	未知	未知	19,100	124,041.02	123,959.00	-
600771	广誉远	2015-11-17	重大资产重组	31.98	2016-03-09	28.78	5,800	263,392.03	185,484.00	-
600982	宁波热电	2015-10-21	重大资产重组	7.54	2016-02-25	6.80	6,700	44,829.51	50,518.00	-
600986	科达股份	2015-12-14	重大资产重组	21.00	未知	未知	7,900	165,710.00	165,900.00	-
600988	赤峰黄金	2015-08-31	重大事项	11.57	2016-01-05	12.73	6,100	135,006.09	70,577.00	-
600990	四创电子	2015-09-01	重大资产重组	62.75	未知	未知	1,800	145,218.42	112,950.00	-
600995	文山电力	2015-09-23	重大资产重组	9.22	2016-01-08	10.14	7,400	78,595.46	68,228.00	-
601058	赛轮金宇	2015-12-28	重要事项未公告	9.00	2016-01-12	8.10	26,000	302,765.53	234,000.00	-
601388	怡球资源	2015-07-28	重大资产重组	23.33	2016-02-15	21.00	14,200	364,444.43	331,286.00	-

002286	保龄宝	2015-08-03	重大资产重组	14.50	2016-02-24	15.95	9,300	157,025.58	134,850.00	-
002360	同德化工	2015-12-03	重大事项	12.32	2016-01-05	11.09	7,700	114,452.43	94,864.00	-
002481	双塔食品	2015-07-07	重大资产重组	13.88	2016-01-04	12.49	26,750	478,263.72	371,290.00	-
002514	宝馨科技	2015-07-08	重大事项	14.80	2016-01-08	16.28	4,400	148,619.54	65,120.00	-
002582	好想你	2015-09-17	重大资产重组	15.62	2016-02-24	17.18	1,700	64,200.16	26,554.00	-
000035	中国天楹	2015-12-14	重大资产重组	15.35	2016-02-18	13.82	11,200	209,672.43	171,920.00	-
000058	深赛格	2015-11-04	重大资产重组	11.85	2016-02-25	13.04	9,100	175,755.19	107,835.00	-
000065	北方国际	2015-10-21	重大资产重组	30.53	2016-03-15	27.48	2,400	113,256.68	73,272.00	-
000153	丰原药业	2015-10-14	重大资产重组	10.44	未知	未知	5,300	89,668.82	55,332.00	-
000553	沙隆达 A	2015-08-05	重大资产重组	10.70	未知	未知	9,100	100,791.00	97,370.00	-
000657	中钨高新	2015-08-05	重大资产重组	16.01	2016-02-25	16.30	9,100	238,961.06	145,691.00	-
000767	漳泽电力	2015-12-30	重大事项	5.77	2016-01-04	6.10	35,100	232,788.02	202,527.00	-
000901	航天科技	2015-08-19	重大资产重组	52.88	2016-02-18	47.59	7,000	495,444.40	370,160.00	-
000909	数源科技	2015-12-28	重大事项	18.68	2016-01-20	16.81	5,500	74,728.15	102,740.00	-
000925	众合科技	2015-11-03	重大资产重组	18.48	未知	未知	5,300	179,562.47	97,944.00	-
000968	煤气化	2015-12-24	重大资产重组	8.71	未知	未知	8,000	60,665.11	69,680.00	-
002020	京新药业	2015-12-29	重大事项	33.55	2016-01-20	30.20	6,200	178,724.00	208,010.00	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大资产重组	13.91	2016-01-21	21.21	35,980	794,738.33	500,481.80	-
002207	准油股份	2015-12-16	重大资产重组	21.42	未知	未知	5,800	149,519.63	124,236.00	-
002228	合兴包装	2015-08-04	重大事项	16.88	2016-02-02	15.21	5,400	200,739.44	91,152.00	-
002231	奥维通信	2015-12-03	重大资产重组	16.36	2016-03-17	16.00	7,000	160,593.90	114,520.00	-
002235	安妮股份	2015-07-02	重大资产重组	29.10	2016-01-12	32.00	7,300	279,839.93	212,430.00	-
002246	北化股份	2015-11-23	重大资产重组	14.12	未知	未知	6,800	86,250.01	96,016.00	-
002313	日海通讯	2015-08-10	重大事项	14.92	2016-01-22	13.90	8,500	119,133.71	126,820.00	-
002320	海峡股份	2015-06-25	重大资产重组	27.43	2016-01-07	24.69	9,100	283,927.66	249,613.00	-
002379	鲁丰环保	2015-10-22	重大事项	4.34	未知	未知	15,400	92,970.02	66,836.00	-
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事项	40.35	2016-03-17	36.32	4,200	211,579.02	169,470.00	-
002434	万里扬	2015-11-25	重大资产重组	23.05	未知	未知	6,700	107,233.46	154,435.00	-

002483	润邦股份	2015-09-30	重大事项	15.65	2016-03-11	10.38	3,400	80,564.66	53,210.00	-
002502	骅威股份	2015-08-20	重大资产重组	32.02	2016-01-14	23.35	4,300	133,972.76	137,686.00	-
002542	中化岩土	2015-12-28	重大事项	13.59	未知	未知	9,700	132,883.65	131,823.00	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大资产重组	29.65	未知	未知	5,500	198,496.67	163,075.00	-
002567	唐人神	2015-11-24	重大事项	12.84	2016-02-25	11.56	6,900	100,745.96	88,596.00	-
002612	朗姿股份	2015-12-22	重大事项	75.46	未知	未知	2,500	158,785.00	188,650.00	-
002622	永大集团	2015-07-02	重大资产重组	25.28	2016-01-08	27.81	6,700	253,537.71	169,376.00	-
002631	德尔未来	2015-11-27	重大事项	29.07	未知	未知	6,400	192,337.47	186,048.00	-
002638	勤上光电	2015-08-29	重大资产重组	15.32	2016-01-19	16.85	6,400	161,398.84	98,048.00	-
002664	信质电机	2015-12-30	重大事项	31.77	2016-03-08	28.59	6,200	230,626.35	196,974.00	-
002707	众信旅游	2015-11-16	重大资产重组	52.62	2015-03-15	47.36	5,000	279,804.11	263,100.00	-
300010	立思辰	2015-12-30	重大事项	31.90	2016-01-08	28.71	12,800	506,535.90	408,320.00	-
300011	鼎汉技术	2015-12-31	重大事项	29.80	2016-01-22	26.82	8,100	238,706.71	241,380.00	-
300025	华星创业	2015-11-26	重大资产重组	30.15	未知	未知	4,200	120,995.64	126,630.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大资产重组	56.68	未知	未知	2,900	153,976.61	164,372.00	-
300049	福瑞股份	2015-11-30	重大资产重组	31.00	2016-01-04	30.95	6,000	202,354.69	186,000.00	-
300054	鼎龙股份	2015-11-23	重大资产重组	24.66	2015-03-14	22.19	8,700	245,775.57	214,542.00	-
300162	雷曼股份	2015-11-02	重大资产重组	23.86	2016-02-29	21.47	3,600	80,583.43	85,896.00	-
300197	铁汉生态	2015-12-30	重大事项	17.11	2016-01-07	16.59	10,100	203,131.46	172,811.00	-
300222	科大智能	2015-08-21	重大资产重组	20.84	2016-01-07	21.16	5,220	156,505.10	108,784.80	-
300238	冠昊生物	2015-11-12	重大资产重组	55.14	未知	未知	5,100	251,803.70	281,214.00	-
300323	华灿光电	2015-12-29	重大事项	10.18	2016-01-04	10.20	10,500	83,090.83	106,890.00	-
300324	旋极信息	2015-12-01	重大资产重组	49.25	2016-03-10	44.33	4,691	186,672.58	231,031.75	-
300326	凯利泰	2015-09-24	重大资产重组	27.92	2016-01-22	23.98	2,100	88,954.05	58,632.00	-
300331	苏大维格	2015-11-16	重大资产重组	25.69	未知	未知	3,300	105,901.35	84,777.00	-
300336	新文化	2015-12-25	重大事项	42.00	未知	未知	6,700	220,035.85	281,400.00	-
300349	金卡股份	2015-11-20	重大资产重组	37.75	未知	未知	1,800	79,001.38	67,950.00	-
300351	永贵电器	2015-10-19	重大资产重组	31.30	2016-02-18	29.80	2,200	107,418.88	68,860.00	-

300355	蒙草抗旱	2015-12-14	重大事项	17.84	2016-02-16	16.06	7,100	153,355.86	126,664.00	-
合计									13,231,743.35	

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

### 7.4.10 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 2015 年 12 月 31 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 157,055,834.94 元，属于第二层次的余额为 13,231,743.35 元，无属于第三

层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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。

(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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,287,578.29	92.19
	其中：股票	170,287,578.29	92.19
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	14,210,094.16	7.69
7	其他各项资产	219,468.36	0.12
8	合计	184,717,140.81	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,778,879.00	0.99
B	采矿业	3,156,853.74	1.75
C	制造业	109,427,594.24	60.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,039,596.00	2.24
E	建筑业	3,536,801.00	1.96
F	批发和零售业	8,987,749.40	4.99
G	交通运输、仓储和邮政业	5,296,722.80	2.94
H	住宿和餐饮业	235,022.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,825,138.25	9.34
J	金融业	125,955.00	0.07
K	房地产业	7,890,247.00	4.38
L	租赁和商务服务业	1,216,258.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	1,459,990.20	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	902,573.00	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	158,301.00	0.09
Q	卫生和社会工作	298,178.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	2,133,391.00	1.18
S	综合	1,866,558.66	1.04
	合计	169,335,808.29	93.98

### 8.2.2 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	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	44,992.00	0.02
C	制造业	906,778.00	0.50
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	951,770.00	0.53

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 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前十名股票投资明细

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	600682	南京新百	22,900	755,242.00	0.42
2	000806	银河生物	20,900	596,277.00	0.33

3	300113	顺网科技	5,500	557,535.00	0.31
4	300079	数码视讯	43,800	530,856.00	0.29
5	600565	迪马股份	43,800	511,584.00	0.28
6	002075	沙钢股份	35,980	500,481.80	0.28
7	300383	光环新网	8,700	484,677.00	0.27
8	002176	江特电机	27,420	482,592.00	0.27
9	002426	胜利精密	18,500	481,370.00	0.27
10	002407	多氟多	6,300	480,438.00	0.27

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.fsfund.com](http://www.fsfund.com) 的年度报告正文。

### 8.3.2 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前五名股票投资明细

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	002481	双塔食品	26,750	371,290.00	0.21
2	002286	保龄宝	9,300	134,850.00	0.07
3	002360	同德化工	7,700	94,864.00	0.05
4	600375	华菱星马	11,600	89,668.00	0.05
5	601996	丰林集团	7,700	70,224.00	0.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.fsfund.com](http://www.fsfund.com) 的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	2,738,378.96	1.52
2	002303	美盈森	1,933,461.00	1.07
3	002312	三泰控股	1,873,350.25	1.04
4	002262	恩华药业	1,733,977.70	0.96
5	000938	紫光股份	1,652,000.03	0.92
6	000875	吉电股份	1,631,627.00	0.91
7	002104	恒宝股份	1,619,751.94	0.90

8	002439	启明星辰	1,577,663.32	0.88
9	600074	保千里	1,448,891.00	0.80
10	600388	龙净环保	1,428,593.00	0.79
11	300159	新研股份	1,426,519.00	0.79
12	600868	梅雁吉祥	1,384,137.00	0.77
13	300079	数码视讯	1,379,384.00	0.77
14	300085	银之杰	1,353,765.00	0.75
15	300216	千山药机	1,344,587.44	0.75
16	002657	中科金财	1,329,187.00	0.74
17	000410	沈阳机床	1,320,700.00	0.73
18	300001	特锐德	1,309,128.52	0.73
19	601588	北辰实业	1,297,403.00	0.72
20	300101	振芯科技	1,282,623.05	0.71

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	1,746,063.04	0.97
2	002262	恩华药业	1,170,932.84	0.65
3	002439	启明星辰	1,140,796.94	0.63
4	600388	龙净环保	1,041,015.29	0.58
5	600868	梅雁吉祥	1,034,189.35	0.57
6	002303	美盈森	937,995.40	0.52
7	002657	中科金财	916,623.16	0.51
8	600074	保千里	904,164.18	0.50
9	002085	万丰奥威	878,809.53	0.49
10	002572	索菲亚	864,533.00	0.48
11	300085	银之杰	856,807.18	0.48
12	000966	长源电力	771,689.37	0.43
13	002104	恒宝股份	761,886.00	0.42
14	002280	联络互动	747,780.40	0.41
15	000875	吉电股份	743,371.69	0.41
16	600098	广州发展	729,596.00	0.40
17	600236	桂冠电力	706,147.00	0.39
18	300216	千山药机	694,325.88	0.39

19	000938	紫光股份	690,844.92	0.38
20	002312	三泰控股	680,950.62	0.38

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	503,701,349.17
卖出股票收入（成交）总额	201,881,098.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

多氟多（002407）于 2015 年 7 月 22 日公告，收到中国证券监督管理委员会河南监管局对公司下达的行政监管措施决定书。由于公司在信息披露方面存在问题，违反了《上市公司信息披露管理办法》的规定。按照《上市公司信息披露管理办法》要求公司相关人员于 2015 年 7 月 30 日 10 时携带有效的身份证件到中国证监会河南监管局接受监管谈话，同时现对公司采取出具警示函的监管措施，并记入证券期货诚信档案。

本基金为开放式指数分级基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 1000 指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

本报告期内，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。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	164,756.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,414.32
5	应收申购款	51,297.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	219,468.36

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600682	南京新百	755,242.00	0.42	重大资产重组
2	600565	迪马股份	511,584.00	0.28	临时停牌
3	002075	沙钢股份	500,481.80	0.28	重大资产重组

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002481	双塔食品	371,290.00	0.21	重大资产重组
2	002286	保龄宝	134,850.00	0.07	重大资产重组
3	002360	同德化工	94,864.00	0.05	重大资产重组
4	600375	华菱星马	89,668.00	0.05	重大资产重组
5	601996	丰林集团	70,224.00	0.04	重大资产重组

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
1000A	135	57,520.01	6,066,285.00	78.12%	1,698,916.00	21.88%
1000B	323	24,040.87	86,796.00	1.12%	7,678,405.00	98.88%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	4,413	35,902.35	40,096,631.96	25.31%	118,340,441.34	74.69%
合计	4,871	35,714.94	46,249,712.96	26.59%	127,717,762.34	73.41%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，

为占期末基金份额总额的比例。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	6,048,156.00	77.89%
2	陈杰	1,057,224.00	13.61%
3	黄维嘉	60,000.00	0.77%
4	周昭山	45,576.00	0.59%
5	陈敏	40,000.00	0.52%
6	毛杰	33,400.00	0.43%
7	薛亚萍	32,100.00	0.41%
8	张春雷	30,000.00	0.39%
9	孙大威	29,400.00	0.38%
10	邵文杰	26,079.00	0.34%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	宋伟铭	1,968,400.00	25.35%
2	江淼	865,413.00	11.14%
3	吴海晏	493,900.00	6.36%
4	周昭山	252,100.00	3.25%
5	侯明新	170,000.00	2.19%
6	伍勇	167,600.00	2.16%
7	戴国梁	153,900.00	1.98%
8	张星	153,500.00	1.98%
9	王跃文	124,400.00	1.60%
10	王绪岩	120,000.00	1.55%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝兴业中证 1000 指数分级	5,864.43	0.0037%
	合计	5,864.43	0.0034%

注：期末本公司基金从业人员未持有本基金的 A 级份额和 B 级份额。

## 9.4 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日）基金份额总额	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	147,346,212.22
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	-172,544,574.02
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-21,676,381.00	-21,676,381.00	-88,192,505.44
本报告期期末基金份额总额	7,765,201.00	7,765,201.00	158,437,073.30

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副

总经理。基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副  
总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 40,000.00 元人民币。目  
前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2015 年 6 月 4 日）  
起至本报告期末。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年  
11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】  
18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整  
改，并已向上海证监局上报了专项报告。

2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
安信证券	1	22,472,304.71	3.18%	20,929.07	3.26%	-
财富里昂	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	2	8,705,478.31	1.23%	7,925.53	1.23%	-

东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	27,430,996.22	3.89%	25,546.51	3.98%	-
东兴证券	1	139,444,456.79	19.76%	124,739.04	19.43%	-
方正证券	2	9,113,038.52	1.29%	8,304.56	1.29%	-
高华证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	218,722,433.72	31.00%	199,124.10	31.01%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	1	95,449,525.46	13.53%	86,973.17	13.55%	-
国泰君安	2	16,359,412.17	2.32%	15,072.61	2.35%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	37,206,804.20	5.27%	33,873.77	5.28%	-
华泰联合	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
金元证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
日信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	3,224,451.00	0.46%	2,935.48	0.46%	-
申万宏源	3	9,492,725.68	1.35%	8,840.50	1.38%	-
西南证券	1	9,327,313.05	1.32%	8,686.66	1.35%	-
信达证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	6,342,347.91	0.90%	5,779.74	0.90%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	45,270,352.36	6.42%	41,214.34	6.42%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	1	33,152,157.44	4.70%	30,182.01	4.70%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	2	7,707,198.76	1.09%	7,023.49	1.09%	-
中投证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	1	250,044.80	0.04%	227.87	0.04%	-
中信证券	2	15,911,406.39	2.26%	14,658.73	2.28%	-

中银国际	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：资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务；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；适当的地区分散化。

（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均为新增。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司  
2016 年 3 月 28 日