

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 26 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 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	40
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	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	70
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71

§8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末上市基金前十名持有人	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	74
§9 开放式基金份额变动	75
§10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8 其他重大事件	79
§11 备查文件目录	80
11.1 备查文件目录	80
11.2 存放地点	80
11.3 查阅方式	80

§ 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	142,983,595.47 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	13,774,157.00 份	13,774,157.00 份	115,435,281.47 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	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。 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。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率 $\times$ 95% + 同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 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
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	《上海证券报》、《中国证券报》、《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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-26,370,796.33
本期利润	-28,836,843.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1656
本期加权平均净值利润率	-20.72%
本期基金份额净值增长率	-18.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-131,275,675.39
期末可供分配基金份额利润	-0.9181
期末基金资产净值	120,955,280.92
期末基金份额净值	0.8459
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-50.16%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.84%	1.56%	6.31%	1.62%	-0.47%	-0.06%
过去三个月	2.72%	1.71%	3.36%	1.72%	-0.64%	-0.01%
过去六个月	-18.33%	2.60%	-16.65%	2.63%	-1.68%	-0.03%
过去一年	-35.21%	2.88%	-21.72%	2.94%	-13.49%	-0.06%
自基金合同生效日起至 今	-50.16%	2.95%	-37.17%	2.98%	-12.99%	-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%。

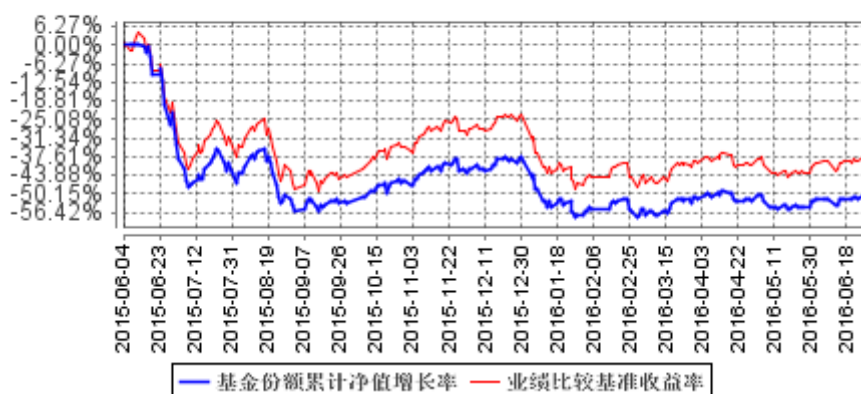
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非

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 2016 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。

§ 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（2016 年 6 月 30 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、新兴产业基金、可转债债券、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接、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、华宝兴业核心优势、华宝兴业转型升级、华宝标普美国消费、华宝宝鑫纯债及华宝香港中小，

所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 157,478,315,809.98 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	-	10 年	金融学硕士、量化投资部总经理助理。2006 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部工作，担任量化投资部高级数量分析师兼任投资经理助理的职务。2012 年 10 月起任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 5 月 21 日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 4 日起任华宝兴业中证 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

资基金在短期内出现过股票资产占基金资产净值低于 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

2016 年上半年，A 股市场先抑后扬。年初由于市场对熔断机制的应对尚不成熟，出现一轮恐慌性下跌行情，创下股灾来新低；2 月指数震荡筑底；随后在锂电池、白酒等热点板块的带动下，市场在 3 月至 4 月中旬走出一波较为明显的反弹；4 月下旬至 6 月市场进入窄幅震荡阶段。报告期内，锂电池、新能源汽车、白酒等板块表现活跃，军工、有色也走出过阶段性行情。指数方面，大盘蓝筹股指数整体表现强于中小盘股指数。其中以上证 180 成长指数和中证 100 指数为代表的大盘蓝筹股指数在报告期分别下跌 12.59%和 12.65%，而以中小板指和创业板指为代表的中小盘指数跌幅居前，同期跌幅分别为 17.88%和 17.92%。本报告期内，中证 1000 指数累计下跌了 17.65%。

本报告期本基金为正常运作期，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 0.8459 元，本报告期内基金份额净值增长率为-18.33%，同期业绩比较基准增长率为-16.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年，中国 GDP 同比增长 6.7%，我国经济呈阶段性企稳态势，下半年经济仍有望趋稳。从财政支出、国债发行规模等指标和发改委对基建投资的支持力度看，政府通过积极财政政策维稳经济的意愿明显，社会融资和新增贷款的稳健增长也可以看出稳增长政策背景下，实体经济对信贷的需求有所转暖，而相应信贷政策的支持力度也相当明显。预计下半年国家将继续保持积极的财政政策和稳健的货币政策，其他产业政策也继续利好证券市场的长远发展。其他的风险因素，如美联储加息预期降低、英国脱欧公投的短期风险释放等，将有利于投资者的风险偏好提升。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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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，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：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日： 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	7,874,902.11	13,943,193.59
结算备付金		2,361.10	266,900.57
存出保证金		32,836.01	164,756.91
交易性金融资产	6.4.7.2	114,534,195.16	170,287,578.29
其中：股票投资		114,534,195.16	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	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	1,458.00	3,414.32
应收股利		-	-
应收申购款		54,423.14	51,297.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		122,500,175.52	184,717,140.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		832,380.32	3,757,175.38
应付赎回款		140,373.58	77,404.07
应付管理人报酬		99,030.03	149,128.30
应付托管费		21,786.61	32,808.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	217,289.52	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	6.4.7.8	234,034.54	240,291.69
负债合计		1,544,894.60	4,527,168.92
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	242,682,723.04	295,270,982.70
未分配利润	6.4.7.10	-121,727,442.12	-115,081,010.81
所有者权益合计		120,955,280.92	180,189,971.89
负债和所有者权益总计		122,500,175.52	184,717,140.81

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，华宝中证 1000 份额基金份额净值 0.8459 元，基金份额总额 115,435,281.47 份；华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0298 元，基金份额总额 13,774,157.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额净值 0.6620 元，基金份额总额 13,774,157.00 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-27,473,304.20	-78,577,056.31
1.利息收入		46,186.32	93,538.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,186.32	93,538.51
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）		-25,174,829.54	-6,379,220.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-25,548,631.42	-6,480,124.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	373,801.88	100,903.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,466,047.07	-72,355,931.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	121,386.09	64,556.94
减：二、费用		1,363,539.20	725,502.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	696,980.33	226,638.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	153,335.73	49,860.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	308,105.70	411,089.93

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	205,117.44	37,914.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,836,843.40	-79,302,559.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,836,843.40	-79,302,559.13

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	295,270,982.70	-115,081,010.81	180,189,971.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,836,843.40	-28,836,843.40
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）	-52,588,259.66	22,190,412.09	-30,397,847.57
其中：1. 基金申购款	147,415,790.60	-80,536,137.39	66,879,653.21
2. 基金赎回款	-200,004,050.26	102,726,549.48	-97,277,500.78
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（基金净值）	242,682,723.04	-121,727,442.12	120,955,280.92

项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 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)	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)	-	-79,302,559.13	-79,302,559.13
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)	-11,500,208.78	5,659,343.44	-5,840,865.34
其中: 1.基金申购款	47,014,716.00	-2,227,062.69	44,787,653.31
2.基金赎回款	-58,514,924.78	7,886,406.13	-50,628,518.65
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)	319,210,895.76	-73,643,215.69	245,567,680.07

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:

<u>黄小薏</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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 元或以上，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 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

本基金本报告期末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[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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	7,874,902.11
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	7,874,902.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	125,894,229.15	114,534,195.16	-11,360,033.99
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	125,894,229.15	114,534,195.16	-11,360,033.99

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,441.61

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	1.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.49
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.80
合计	1,458.00

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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	217,289.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	217,289.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	479.92
预提费用	183,554.62
应付指数使用费	50,000.00
合计	234,034.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	173,967,475.30	295,270,982.70
本期申购	86,854,771.20	147,415,790.60

本期赎回(以“-”号填列)	-117,838,651.03	-200,004,050.26
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期末	142,983,595.47	242,682,723.04

注：

本基金的基金份额包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。本期申购含申购的华宝中证 1000 基础份额和配对转入的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额，本期赎回含赎回的华宝中证 1000 基础份额和配对转出的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 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	-129,672,978.28	14,591,967.47	-115,081,010.81
本期利润	-26,370,796.33	-2,466,047.07	-28,836,843.40
本期基金份额交易产生的变动数	24,768,099.22	-2,577,687.13	22,190,412.09
其中：基金申购款	-71,971,785.42	-8,564,351.97	-80,536,137.39
基金赎回款	96,739,884.64	5,986,664.84	102,726,549.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-131,275,675.39	9,548,233.27	-121,727,442.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,551.00
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	1,266.29
其他	369.03
合计	46,186.32

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	110,726,373.70
减：卖出股票成本总额	136,275,005.12
买卖股票差价收入	-25,548,631.42

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	373,801.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	373,801.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,466,047.07
——股票投资	-2,466,047.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-2,466,047.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	121,386.09
其他	-
合计	121,386.09

注：本基金场外的赎回费率按持有期间递减；场内的赎回费率为 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	308,105.70
银行间市场交易费用	-
合计	308,105.70

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	53,828.58
基金上市费	29,835.26
其他	400.00
银行汇划费用	1,162.82
指数使用费	100,000.00
合计	205,117.44

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、基金销售机构
中国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
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。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日） 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	696,980.33	226,638.24
其中：支付销售机构的客户维护费	231,558.16	79,051.19

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	153,335.73	49,860.40

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金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。

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。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 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	7,874,902.11	44,551.00	13,862,666.98	93,535.82

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（2016 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
000806	银河生物	2016 年 1 月 12 日	重大事项停牌	19.44	2016 年 7 月 12 日	17.50	20,200	564,377.46	392,688.00	-
300142	沃森生物	2016 年 3 月 22 日	重大事项停牌	11.16	-	-	32,800	425,942.61	366,048.00	-
002555	三七互娱	2016 年 3 月 10 日	重大事项停牌	21.41	2016 年 8 月 16 日	19.91	13,800	300,133.20	295,458.00	-
300208	恒顺众昇	2016 年 5 月 18 日	重大事项停牌	13.87	2016 年 7 月 8 日	15.26	20,250	434,876.72	280,867.50	-
002089	新海宜	2016 年 1 月 8 日	重大事项停牌	16.88	2016 年 7 月 18 日	18.55	14,700	330,042.31	248,136.00	-
600149	廊坊发展	2016 年 4 月 13 日	重大事项停牌	16.64	2016 年 7 月 21 日	14.98	14,391	265,536.12	239,466.24	-
002630	华西能源	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	11.06	-	-	21,400	285,588.82	236,684.00	-
002283	天润曲轴	2016 年 3 月 23 日	重大事项停牌	17.15	-	-	13,100	257,745.11	224,665.00	-
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大事项停牌	27.47	-	-	7,900	277,650.62	217,013.00	-
600330	天通股份	2016 年 5 月 23 日	重大事项停牌	13.93	-	-	15,100	229,872.89	210,343.00	-

600653	申华控股	2016 年 5 月 5 日	重大事项停牌	3.93	-	-	53,500	352,372.37	210,255.00	-
002355	兴民钢圈	2016 年 5 月 12 日	重大事项停牌	19.35	-	-	10,600	149,878.54	205,110.00	-
300300	汉鼎股份	2016 年 5 月 10 日	重大事项停牌	30.56	-	-	6,600	205,303.42	201,696.00	-
000802	北京文化	2016 年 6 月 1 日	重大事项停牌	23.52	2016 年 8 月 22 日	21.86	8,500	252,735.17	199,920.00	-
300332	天壕环境	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	9.37	-	-	20,600	254,119.61	193,022.00	-
600139	西部资源	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	12.31	-	-	15,000	203,221.84	184,650.00	-
600577	精达股份	2016 年 5 月 3 日	重大事项停牌	4.18	-	-	40,300	267,028.23	168,454.00	-
002445	中南文化	2016 年 6 月 14 日	重大事项停牌	22.99	-	-	7,300	152,430.17	167,827.00	-
002331	皖通科技	2016 年 4 月 18 日	重大事项停牌	16.54	2016 年 7 月 11 日	15.31	10,080	239,258.97	166,723.20	-
300284	苏交科	2016 年 5 月 20 日	重大事项停牌	19.49	-	-	8,400	196,622.74	163,716.00	-
300450	先导智能	2016 年 3 月 14 日	重大事项停牌	37.81	2016 年 7 月 20 日	41.59	4,200	123,893.64	158,802.00	-
000932	华菱钢铁	2016 年 3 月 28 日	重大事项停牌	3.95	-	-	40,200	144,746.69	158,790.00	-
002617	露笑科技	2016 年 5 月 9 日	重大事项停牌	15.60	-	-	10,030	116,966.66	156,468.00	-
002469	三维工程	2016 年 5 月 10 日	重大事项停牌	10.71	-	-	13,850	135,732.08	148,333.50	-
300038	梅泰诺	2015 年 12 月	重大事项	50.58	-	-	2,900	153,976.61	146,682.00	-

		16 日	停牌							
000920	南方汇通	2016 年 2 月 17 日	重大事项停牌	17.80	2016 年 7 月 12 日	18.10	8,200	148,970.54	145,960.00	-
300173	智慧松德	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	16.25	-	-	8,900	141,618.00	144,625.00	-
002389	南洋科技	2016 年 2 月 3 日	重大事项停牌	12.95	-	-	11,100	184,856.49	143,745.00	-
600634	中技控股	2016 年 6 月 22 日	重大事项停牌	14.41	-	-	9,900	221,476.99	142,659.00	-
002387	黑牛食品	2016 年 5 月 25 日	重大事项停牌	16.26	-	-	8,600	149,159.49	139,836.00	-
600035	楚天高速	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	5.06	-	-	27,500	138,875.50	139,150.00	-
002447	壹桥海参	2016 年 3 月 9 日	重大事项停牌	7.19	-	-	19,100	215,644.77	137,329.00	-
300353	东土科技	2016 年 6 月 23 日	重大事项停牌	22.09	-	-	6,200	134,099.88	136,958.00	-
002349	精华制药	2016 年 1 月 4 日	重大事项停牌	25.73	2016 年 7 月 18 日	23.16	5,250	111,880.00	135,082.50	-
600877	中国嘉陵	2016 年 3 月 3 日	重大事项停牌	7.38	-	-	18,200	167,219.70	134,316.00	-
300111	向日葵	2016 年 6 月 14 日	重大事项停牌	4.90	-	-	27,400	156,750.40	134,260.00	-
002289	*ST 宇顺	2016 年 4 月 29 日	重大事项停牌	26.04	-	-	5,100	147,186.56	132,804.00	-
600173	卧龙地产	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.28	-	-	15,700	138,035.01	129,996.00	-
600209	罗顿发展	2016 年 2 月 24 日	重大事项停牌	11.13	-	-	11,600	108,678.88	129,108.00	-
600318	新力	2016 年	重大	26.84	-	-	4,800	129,569.38	128,832.00	-

	金融	3 月 24 日	事项停牌							
002631	德尔未来	2016 年 6 月 29 日	重大事项停牌	26.60	-	-	4,800	140,288.11	127,680.00	-
002567	唐人神	2016 年 5 月 16 日	重大事项停牌	13.98	-	-	9,100	125,046.68	127,218.00	-
000407	胜利股份	2016 年 5 月 23 日	重大事项停牌	6.73	-	-	18,700	151,479.65	125,851.00	-
600321	国栋建设	2016 年 5 月 6 日	重大事项停牌	4.02	-	-	31,200	200,102.30	125,424.00	-
002207	准油股份	2015 年 12 月 16 日	重大事项停牌	21.42	-	-	5,800	149,519.63	124,236.00	-
000537	广宇发展	2016 年 4 月 13 日	重大事项停牌	8.01	2016 年 7 月 20 日	8.81	15,500	131,448.35	124,155.00	-
300356	光一科技	2016 年 5 月 26 日	重大事项停牌	48.44	-	-	2,400	115,003.07	116,256.00	-
000409	山东地矿	2016 年 3 月 14 日	重大事项停牌	10.19	-	-	11,007	137,899.90	112,161.33	-
000757	浩物股份	2016 年 3 月 29 日	重大事项停牌	10.56	-	-	10,600	127,672.14	111,936.00	-
000936	华西股份	2016 年 5 月 24 日	重大事项停牌	8.22	2016 年 7 月 13 日	9.04	13,500	163,242.68	110,970.00	-
300323	华灿光电	2016 年 4 月 18 日	重大事项停牌	8.99	-	-	12,200	93,426.85	109,678.00	-
002452	长高集团	2016 年 6 月 14 日	重大事项停牌	12.02	2016 年 7 月 12 日	10.82	9,000	94,241.13	108,180.00	-
002712	思美传媒	2016 年 4 月 11 日	重大事项停牌	35.76	2016 年 8 月 17 日	41.82	3,000	79,146.41	107,280.00	-
002297	博云新材	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	13.09	-	-	8,100	108,168.21	106,029.00	-

300223	北京君正	2016 年 6 月 3 日	重大事项停牌	44.00	-	-	2,400	65,661.02	105,600.00	-
300044	赛为智能	2016 年 5 月 12 日	重大事项停牌	12.97	-	-	8,100	153,421.80	105,057.00	-
002071	长城影视	2016 年 6 月 16 日	重大事项停牌	13.64	-	-	7,700	138,357.27	105,028.00	-
600237	铜峰电子	2016 年 6 月 30 日	重大事项停牌	7.61	2016 年 7 月 7 日	7.42	13,600	137,835.49	103,496.00	-
300080	易成新能	2016 年 5 月 19 日	重大事项停牌	7.76	-	-	13,300	115,444.42	103,208.00	-
600986	科达股份	2016 年 6 月 27 日	重大事项停牌	15.98	2016 年 7 月 18 日	17.58	6,400	131,025.34	102,272.00	-
002432	九安医疗	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	18.14	2016 年 7 月 13 日	19.95	5,500	138,499.89	99,770.00	-
002212	南洋股份	2016 年 5 月 3 日	重大事项停牌	11.28	2016 年 8 月 17 日	12.41	8,800	92,726.26	99,264.00	-
000553	沙隆达 A	2015 年 8 月 5 日	重大事项停牌	10.68	-	-	9,100	100,791.00	97,188.00	-
300355	蒙草抗旱	2016 年 6 月 30 日	重大事项停牌	7.11	2016 年 7 月 6 日	7.38	13,500	127,158.02	95,985.00	-
002246	北化股份	2015 年 11 月 23 日	重大事项停牌	14.10	-	-	6,800	86,250.01	95,880.00	-
000159	国际实业	2016 年 2 月 23 日	重大事项停牌	7.63	-	-	12,500	100,258.87	95,375.00	-
300298	三诺生物	2016 年 3 月 21 日	重大事项停牌	20.96	-	-	4,550	118,257.00	95,368.00	-
600843	上工申贝	2016 年 2 月 18 日	重大事项停牌	13.71	2016 年 7 月 26 日	15.08	6,900	104,091.41	94,599.00	-
002012	凯恩股份	2016 年 1 月 19 日	重大事项	8.71	2016 年 7 月 18 日	8.80	10,800	96,200.71	94,068.00	-

		日	停牌		日					
002611	东方精工	2016 年 3 月 29 日	重大事项停牌	10.84	2016 年 8 月 18 日	11.92	8,500	130,089.43	92,140.00	-
300351	永贵电器	2016 年 6 月 29 日	重大事项停牌	33.93	2016 年 7 月 4 日	33.30	2,600	92,995.27	88,218.00	-
000571	新大洲 A	2016 年 1 月 18 日	重大事项停牌	5.71	2016 年 7 月 19 日	6.28	15,000	144,090.82	85,650.00	-
002574	明牌珠宝	2016 年 6 月 27 日	重大事项停牌	13.04	-	-	6,500	73,825.56	84,760.00	-
002274	华昌化工	2016 年 6 月 12 日	重大事项停牌	10.50	2016 年 7 月 7 日	10.65	8,000	94,460.55	84,000.00	-
300052	中青宝	2016 年 6 月 8 日	重大事项停牌	22.03	-	-	3,800	123,810.96	83,714.00	-
002313	日海通讯	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	13.59	2016 年 7 月 4 日	14.95	6,100	86,484.24	82,899.00	-
000948	南天信息	2016 年 6 月 28 日	重大事项停牌	19.31	2016 年 7 月 12 日	21.00	4,200	123,565.13	81,102.00	-
300451	创业软件	2016 年 5 月 30 日	重大事项停牌	44.41	-	-	1,800	109,189.06	79,938.00	-
603808	歌力思	2016 年 4 月 20 日	重大事项停牌	29.13	2016 年 7 月 20 日	31.50	2,700	81,509.03	78,651.00	-
600113	浙江东日	2016 年 3 月 25 日	重大事项停牌	12.05	2016 年 7 月 25 日	13.24	6,300	87,290.29	75,915.00	-
300334	津膜科技	2016 年 5 月 20 日	重大事项停牌	18.05	-	-	4,200	89,123.87	75,810.00	-
300246	宝莱特	2016 年 6 月 27 日	重大事项停牌	30.31	2016 年 7 月 1 日	32.20	2,500	73,348.01	75,775.00	-
600475	华光股份	2016 年 5 月 18 日	重大事项停牌	14.85	-	-	5,100	79,861.79	75,735.00	-
300110	华仁	2016 年	重大	9.53	2016 年	10.48	7,700	166,165.17	73,381.00	-

	药业	1 月 27 日	事项停牌		7 月 12 日					
600738	兰州民百	2016 年 3 月 23 日	重大事项停牌	8.49	2016 年 7 月 11 日	9.34	8,600	77,105.90	73,014.00	-
002046	轴研科技	2016 年 5 月 9 日	重大事项停牌	10.33	2016 年 8 月 22 日	11.36	7,000	73,969.19	72,310.00	-
300413	快乐购	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	24.35	-	-	2,900	96,485.27	70,615.00	-
000968	*ST 煤气	2015 年 12 月 24 日	重大事项停牌	8.71	2016 年 7 月 7 日	9.06	8,000	60,665.11	69,680.00	-
000018	神州长城	2016 年 6 月 24 日	重大事项停牌	12.17	2016 年 7 月 11 日	12.88	5,300	60,456.83	64,501.00	-
000498	山东路桥	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	5.76	2016 年 7 月 4 日	6.11	11,000	75,680.33	63,360.00	-
000551	创元科技	2016 年 6 月 7 日	重大事项停牌	9.18	2016 年 7 月 7 日	10.10	6,800	78,643.19	62,424.00	-
000546	金圆股份	2016 年 6 月 16 日	重大事项停牌	10.54	2016 年 7 月 12 日	10.95	5,900	58,533.36	62,186.00	-
002379	*ST 鲁丰	2016 年 5 月 16 日	重大事项停牌	3.83	2016 年 8 月 16 日	4.02	15,400	92,970.02	58,982.00	-
300227	光韵达	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	23.79	-	-	2,400	73,991.09	57,096.00	-
603398	邦宝益智	2016 年 6 月 28 日	重大事项停牌	36.94	2016 年 7 月 8 日	39.00	1,500	61,735.00	55,410.00	-
000916	华北高速	2016 年 6 月 24 日	重大事项停牌	5.01	-	-	10,700	59,584.37	53,607.00	-
002713	东易日盛	2016 年 6 月 29 日	重大事项停牌	29.03	2016 年 7 月 20 日	31.93	1,800	47,887.68	52,254.00	-
600121	郑州煤电	2016 年 6 月 17 日	重大事项停牌	4.80	2016 年 7 月 1 日	5.05	9,900	68,711.10	47,520.00	-

300292	吴通 控股	2016 年 1 月 25 日	重大 事项 停牌	33.26	2016 年 7 月 20 日	36.48	400	18,753.38	13,304.00	-
--------	----------	-----------------------	----------------	-------	-----------------------	-------	-----	-----------	-----------	---

注：本基金截至 2016 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

本基金是一只指数型的分级证券投资基金，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以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理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，因此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，通过对投资品种的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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 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。本基金所持证券在证券交易所上市，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 2016 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(2015 年 12 月 31 日:同)。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	7,874,902.11	-	-	-	7,874,902.11
结算备付金	2,361.10	-	-	-	2,361.10
存出保证金	32,836.01	-	-	-	32,836.01
交易性金融资产	-	-	-	114,534,195.16	114,534,195.16
应收利息	-	-	-	1,458.00	1,458.00
应收申购款	100.00	-	-	54,323.14	54,423.14
资产总计	7,910,199.22	-	-	114,589,976.30	122,500,175.52
负债					
应付证券清算款	-	-	-	832,380.32	832,380.32
应付赎回款	-	-	-	140,373.58	140,373.58
应付管理人报酬	-	-	-	99,030.03	99,030.03
应付托管费	-	-	-	21,786.61	21,786.61
应付指数使用费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	217,289.52	217,289.52
其他负债	-	-	-	184,034.54	184,034.54
负债总计	-	-	-	1,544,894.60	1,544,894.60
利率敏感度缺口	7,910,199.22	-	-	113,045,081.70	120,955,280.92
上年度末 2015 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	13,943,193.59	-	-	-	13,943,193.59
结算备付金	266,900.57	-	-	-	266,900.57
存出保证金	164,756.91	-	-	-	164,756.91
交易性金融资产	-	-	-	170,287,578.29	170,287,578.29
应收利息	-	-	-	3,414.32	3,414.32
应收申购款	6,092.21	-	-	45,204.92	51,297.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,380,943.28	-	-	170,336,197.53	184,717,140.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,757,175.38	3,757,175.38
应付赎回款	-	-	-	77,404.07	77,404.07
应付管理人报酬	-	-	-	149,128.30	149,128.30
应付托管费	-	-	-	32,808.25	32,808.25
应付指数使用费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	270,361.23	270,361.23
其他负债	-	-	-	190,291.69	190,291.69
负债总计	-	-	-	4,527,168.92	4,527,168.92
利率敏感度缺口	14,380,943.28	-	-	165,809,028.61	180,189,971.89

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日, 本基金未持有交易性债券投资, 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资, 股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数, 通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	114,534,195.16	94.69	170,287,578.29	94.50
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	114,534,195.16	94.69	170,287,578.29	94.50

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,864,698.23	-
	业绩比较基准下降 5%	-5,864,698.23	-

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 101,914,553.89 元，属于第二层次的余额为 12,619,641.27 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 157,055,834.94 元，第二层次 13,231,743.35 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，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 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。

§ 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	114,534,195.16	93.50
	其中：股票	114,534,195.16	93.50
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	7,877,263.21	6.43
7	其他各项资产	88,717.15	0.07
8	合计	122,500,175.52	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,022,058.50	0.84
B	采矿业	1,873,416.33	1.55
C	制造业	75,381,516.41	62.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,020,272.00	2.50
E	建筑业	2,613,834.00	2.16
F	批发和零售业	4,373,936.60	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,372,901.50	2.79
H	住宿和餐饮业	128,847.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,212,568.88	8.44
J	金融业	78,280.00	0.06
K	房地产业	4,822,160.30	3.99
L	租赁和商务服务业	1,052,101.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	1,034,635.90	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	718,723.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	89,792.00	0.07
Q	卫生和社会工作	346,784.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,583,882.00	1.31
S	综合	1,165,833.74	0.96
	合计	112,891,543.16	93.33

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	193,916.00	0.16
C	制造业	936,265.00	0.77
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	512,471.00	0.42

	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	1,642,652.00	1.36

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002407	多氟多	12,108	515,679.72	0.43
2	002176	江特电机	24,920	383,768.00	0.32
3	002460	赣锋锂业	11,000	367,950.00	0.30
4	300142	沃森生物	32,800	366,048.00	0.30
5	300136	信维通信	16,220	339,971.20	0.28
6	300383	光环新网	8,800	333,520.00	0.28
7	300159	新研股份	18,100	326,705.00	0.27
8	002070	众和股份	12,400	313,100.00	0.26
9	300156	神雾环保	14,650	301,497.00	0.25
10	300296	利亚德	9,200	291,272.00	0.24
11	300079	数码视讯	33,500	287,095.00	0.24
12	300208	恒顺众昇	20,250	280,867.50	0.23
13	600777	新潮实业	15,600	275,964.00	0.23

14	600110	诺德股份	28,000	275,520.00	0.23
15	002108	沧州明珠	10,500	271,950.00	0.22
16	300077	国民技术	13,700	271,260.00	0.22
17	300101	振芯科技	9,500	265,335.00	0.22
18	300324	旋极信息	12,182	261,425.72	0.22
19	002224	三力士	11,200	259,280.00	0.21
20	002610	爱康科技	13,700	259,204.00	0.21
21	002491	通鼎互联	14,600	249,076.00	0.21
22	600172	黄河旋风	13,500	248,805.00	0.21
23	002089	新海宜	14,700	248,136.00	0.21
24	300367	东方网力	9,750	242,092.50	0.20
25	300207	欣旺达	9,400	241,298.00	0.20
26	002544	杰赛科技	7,500	240,525.00	0.20
27	000627	天茂集团	31,100	240,403.00	0.20
28	600149	廊坊发展	14,391	239,466.24	0.20
29	000048	康达尔	6,700	239,391.00	0.20
30	600868	梅雁吉祥	46,200	237,930.00	0.20
31	002630	华西能源	21,400	236,684.00	0.20
32	300009	安科生物	7,730	230,972.40	0.19
33	002474	榕基软件	12,100	228,690.00	0.19
34	002138	顺络电子	12,600	228,438.00	0.19
35	002104	恒宝股份	13,876	228,121.44	0.19
36	000957	中通客车	5,000	227,000.00	0.19
37	300359	全通教育	7,650	226,899.00	0.19
38	300068	南都电源	10,300	225,158.00	0.19
39	002283	天润曲轴	13,100	224,665.00	0.19
40	300014	亿纬锂能	5,200	224,588.00	0.19
41	002709	天赐材料	3,200	223,808.00	0.19
42	002023	海特高新	12,900	223,557.00	0.18
43	000520	长航凤凰	24,600	222,138.00	0.18
44	600343	航天动力	9,300	221,154.00	0.18
45	000901	航天科技	5,500	220,825.00	0.18
46	002343	慈文传媒	4,550	220,675.00	0.18
47	000687	华讯方舟	11,100	219,780.00	0.18
48	002067	景兴纸业	26,600	218,386.00	0.18
49	000410	沈阳机床	13,000	218,140.00	0.18
50	600728	佳都科技	22,280	216,561.60	0.18
51	002123	荣信股份	10,400	216,216.00	0.18
52	002517	恺英网络	4,900	215,992.00	0.18

53	300170	汉得信息	14,200	215,556.00	0.18
54	600711	盛屯矿业	29,100	215,340.00	0.18
55	600391	成发科技	5,600	215,320.00	0.18
56	002047	宝鹰股份	21,500	215,000.00	0.18
57	002303	美盈森	17,400	213,846.00	0.18
58	000938	紫光股份	3,500	213,080.00	0.18
59	300377	赢时胜	4,300	212,807.00	0.18
60	002312	三泰控股	11,200	212,240.00	0.18
61	000089	深圳机场	24,900	211,650.00	0.17
62	300238	冠昊生物	4,800	210,624.00	0.17
63	600330	天通股份	15,100	210,343.00	0.17
64	600653	申华控股	53,500	210,255.00	0.17
65	002618	丹邦科技	6,200	210,118.00	0.17
66	002467	二六三	13,600	209,576.00	0.17
67	002643	万润股份	4,100	208,608.00	0.17
68	002364	中恒电气	7,600	208,468.00	0.17
69	300073	当升科技	3,100	207,514.00	0.17
70	002095	生意宝	3,700	207,163.00	0.17
71	300020	银江股份	11,100	206,460.00	0.17
72	600652	游久游戏	14,200	206,184.00	0.17
73	002284	亚太股份	10,800	206,172.00	0.17
74	002019	亿帆鑫富	13,400	206,092.00	0.17
75	300271	华宇软件	10,880	205,849.60	0.17
76	002355	兴民钢圈	10,600	205,110.00	0.17
77	300266	兴源环境	4,900	205,016.00	0.17
78	300310	宜通世纪	5,360	204,698.40	0.17
79	300078	思创医惠	6,080	203,315.20	0.17
80	300203	聚光科技	7,700	203,280.00	0.17
81	600667	太极实业	20,300	202,797.00	0.17
82	002055	得润电子	6,600	202,092.00	0.17
83	300300	汉鼎股份	6,600	201,696.00	0.17
84	002522	浙江众成	10,700	200,625.00	0.17
85	002622	永大集团	16,300	200,490.00	0.17
86	300347	泰格医药	6,900	200,238.00	0.17
87	000802	北京文化	8,500	199,920.00	0.17
88	002501	利源精制	18,500	199,800.00	0.17
89	600990	四创电子	2,300	199,387.00	0.16
90	300496	中科创达	2,927	198,216.44	0.16
91	002326	永太科技	9,700	197,880.00	0.16

92	002185	华天科技	15,500	197,315.00	0.16
93	000516	国际医学	33,600	196,560.00	0.16
94	300216	千山药机	6,200	196,106.00	0.16
95	600988	赤峰黄金	10,400	193,960.00	0.16
96	002031	巨轮智能	42,800	193,456.00	0.16
97	603799	华友钴业	5,200	193,440.00	0.16
98	600562	国睿科技	5,640	193,395.60	0.16
99	300332	天壕环境	20,600	193,022.00	0.16
100	600206	有研新材	14,300	192,335.00	0.16
101	000601	韶能股份	18,400	192,280.00	0.16
102	002256	彩虹精化	5,700	186,960.00	0.15
103	601058	赛轮金宇	55,740	186,171.60	0.15
104	300118	东方日升	9,800	184,828.00	0.15
105	600139	西部资源	15,000	184,650.00	0.15
106	300012	华测检测	14,900	184,462.00	0.15
107	002462	嘉事堂	4,900	182,525.00	0.15
108	300090	盛运环保	22,500	182,025.00	0.15
109	300065	海兰信	4,700	181,796.00	0.15
110	002245	澳洋顺昌	14,200	181,334.00	0.15
111	002583	海能达	14,980	180,359.20	0.15
112	000733	振华科技	8,000	180,000.00	0.15
113	600303	曙光股份	12,100	179,685.00	0.15
114	002130	沃尔核材	11,100	178,488.00	0.15
115	300053	欧比特	9,745	176,871.75	0.15
116	000882	华联股份	43,300	176,664.00	0.15
117	600571	信雅达	3,200	176,384.00	0.15
118	002099	海翔药业	18,500	176,120.00	0.15
119	300285	国瓷材料	4,400	175,516.00	0.15
120	600855	航天长峰	5,600	175,280.00	0.14
121	002448	中原内配	11,400	173,850.00	0.14
122	600360	华微电子	14,400	170,784.00	0.14
123	002121	科陆电子	14,500	170,375.00	0.14
124	600210	紫江企业	29,500	169,920.00	0.14
125	300297	蓝盾股份	10,600	168,858.00	0.14
126	600707	彩虹股份	14,300	168,740.00	0.14
127	000518	四环生物	25,000	168,500.00	0.14
128	600577	精达股份	40,300	168,454.00	0.14
129	002445	中南文化	7,300	167,827.00	0.14
130	600130	波导股份	18,700	167,739.00	0.14

131	601388	怡球资源	7,800	167,466.00	0.14
132	002117	东港股份	5,300	166,738.00	0.14
133	002331	皖通科技	10,080	166,723.20	0.14
134	002664	信质电机	4,900	166,698.00	0.14
135	002707	众信旅游	8,200	166,460.00	0.14
136	601588	北辰实业	38,800	165,676.00	0.14
137	300252	金信诺	5,000	165,650.00	0.14
138	600756	浪潮软件	5,500	165,550.00	0.14
139	002318	久立特材	14,300	165,451.00	0.14
140	300185	通裕重工	18,500	165,020.00	0.14
141	002421	达实智能	9,400	164,218.00	0.14
142	600677	航天通信	8,900	164,205.00	0.14
143	300036	超图软件	6,700	164,150.00	0.14
144	002436	兴森科技	7,200	164,088.00	0.14
145	300284	苏交科	8,400	163,716.00	0.14
146	002547	春兴精工	14,800	163,688.00	0.14
147	300294	博雅生物	2,600	163,436.00	0.14
148	002625	龙生股份	3,700	162,726.00	0.13
149	300054	鼎龙股份	6,500	162,630.00	0.13
150	300336	新文化	6,500	162,370.00	0.13
151	600662	强生控股	15,400	161,238.00	0.13
152	600730	中国高科	11,400	161,082.00	0.13
153	300269	联建光电	6,200	161,076.00	0.13
154	600856	中天能源	8,300	160,771.00	0.13
155	000902	新洋丰	12,800	160,128.00	0.13
156	600602	云赛智联	15,100	159,456.00	0.13
157	000875	吉电股份	28,400	159,324.00	0.13
158	000036	华联控股	19,400	159,274.00	0.13
159	600291	西水股份	8,000	158,960.00	0.13
160	300450	先导智能	4,200	158,802.00	0.13
161	000932	华菱钢铁	40,200	158,790.00	0.13
162	002570	贝因美	12,400	158,596.00	0.13
163	002288	超华科技	15,900	157,410.00	0.13
164	300188	美亚柏科	5,900	157,176.00	0.13
165	002638	勤上光电	7,300	156,731.00	0.13
166	002617	露笑科技	10,030	156,468.00	0.13
167	600567	山鹰纸业	55,000	156,200.00	0.13
168	300368	汇金股份	5,300	156,138.00	0.13
169	300228	富瑞特装	9,180	156,060.00	0.13

170	002550	千红制药	18,700	155,958.00	0.13
171	002488	金固股份	7,400	155,548.00	0.13
172	300178	腾邦国际	8,100	155,520.00	0.13
173	601689	拓普集团	4,700	154,865.00	0.13
174	300333	兆日科技	6,500	154,700.00	0.13
175	000055	方大集团	8,200	154,324.00	0.13
176	002402	和而泰	5,700	154,185.00	0.13
177	300096	易联众	8,400	154,056.00	0.13
178	300131	英唐智控	13,000	153,530.00	0.13
179	600363	联创光电	8,600	153,166.00	0.13
180	000801	四川九洲	12,400	152,768.00	0.13
181	002721	金一文化	7,900	152,707.00	0.13
182	600559	老白干酒	6,372	152,673.12	0.13
183	603678	火炬电子	2,000	152,440.00	0.13
184	601222	林洋能源	3,631	151,957.35	0.13
185	002359	齐星铁塔	6,100	151,585.00	0.13
186	000751	锌业股份	27,400	151,522.00	0.13
187	000807	云铝股份	23,100	151,305.00	0.13
188	002097	山河智能	14,700	151,263.00	0.13
189	600495	晋西车轴	20,580	150,851.40	0.12
190	300011	鼎汉技术	6,400	150,208.00	0.12
191	002509	天广消防	15,140	149,734.60	0.12
192	600261	阳光照明	21,200	149,672.00	0.12
193	600255	鑫科材料	34,400	149,296.00	0.12
194	002469	三维工程	13,850	148,333.50	0.12
195	000851	高鸿股份	11,500	148,235.00	0.12
196	000666	经纬纺机	7,600	148,200.00	0.12
197	300031	宝通科技	5,800	148,016.00	0.12
198	002091	江苏国泰	9,300	147,405.00	0.12
199	002094	青岛金王	5,500	146,905.00	0.12
200	300038	梅泰诺	2,900	146,682.00	0.12
201	600763	通策医疗	4,700	146,546.00	0.12
202	300075	数字政通	5,700	146,205.00	0.12
203	002668	奥马电器	2,400	146,088.00	0.12
204	000920	南方汇通	8,200	145,960.00	0.12
205	002177	御银股份	14,800	145,780.00	0.12
206	300183	东软载波	5,500	145,750.00	0.12
207	002418	康盛股份	13,800	145,728.00	0.12
208	002145	中核钛白	23,300	145,625.00	0.12

209	300004	南风股份	7,400	145,040.00	0.12
210	002443	金洲管道	10,100	144,935.00	0.12
211	002151	北斗星通	4,300	144,738.00	0.12
212	600862	中航高科	10,200	144,636.00	0.12
213	300173	智慧松德	8,900	144,625.00	0.12
214	002601	佰利联	10,350	144,382.50	0.12
215	002376	新北洋	10,800	144,288.00	0.12
216	002497	雅化集团	18,700	144,177.00	0.12
217	002253	川大智胜	3,850	143,797.50	0.12
218	002389	南洋科技	11,100	143,745.00	0.12
219	000989	九芝堂	6,305	143,564.85	0.12
220	300037	新宙邦	2,200	143,418.00	0.12
221	002416	爱施德	7,200	142,992.00	0.12
222	600399	抚顺特钢	22,100	142,987.00	0.12
223	002577	雷柏科技	2,800	142,940.00	0.12
224	600634	中技控股	9,900	142,659.00	0.12
225	603118	共进股份	3,500	142,415.00	0.12
226	600650	锦江投资	4,700	142,175.00	0.12
227	600323	瀚蓝环境	11,200	142,128.00	0.12
228	300191	潜能恒信	3,100	141,763.00	0.12
229	300226	上海钢联	2,786	140,414.40	0.12
230	600107	美尔雅	7,000	140,070.00	0.12
231	002387	黑牛食品	8,600	139,836.00	0.12
232	300007	汉威电子	5,000	139,600.00	0.12
233	600620	天宸股份	13,350	139,240.50	0.12
234	600035	楚天高速	27,500	139,150.00	0.12
235	002600	江粉磁材	11,500	138,920.00	0.11
236	002367	康力电梯	9,000	138,600.00	0.11
237	002341	新纶科技	6,400	137,792.00	0.11
238	600622	嘉宝集团	10,000	137,500.00	0.11
239	002468	艾迪西	4,800	137,376.00	0.11
240	002447	壹桥海参	19,100	137,329.00	0.11
241	000150	宜华健康	4,400	137,192.00	0.11
242	600186	莲花健康	25,800	136,998.00	0.11
243	600771	广誉远	4,700	136,958.00	0.11
244	300353	东土科技	6,200	136,958.00	0.11
245	000760	斯太尔	9,600	136,800.00	0.11
246	600638	新黄浦	9,600	136,704.00	0.11
247	300197	铁汉生态	9,820	136,105.20	0.11

248	300386	飞天诚信	4,100	135,997.00	0.11
249	002716	金贵银业	7,300	135,780.00	0.11
250	002036	联创电子	5,800	135,778.00	0.11
251	300379	东方通	1,700	135,116.00	0.11
252	002349	精华制药	5,250	135,082.50	0.11
253	002339	积成电子	7,400	134,976.00	0.11
254	002260	德奥通航	5,200	134,940.00	0.11
255	300302	同有科技	4,140	134,425.80	0.11
256	300034	钢研高纳	6,079	134,345.90	0.11
257	002481	双塔食品	18,400	134,320.00	0.11
258	600877	中国嘉陵	18,200	134,316.00	0.11
259	300111	向日葵	27,400	134,260.00	0.11
260	300212	易华录	4,500	133,965.00	0.11
261	002411	必康股份	7,500	133,875.00	0.11
262	002156	通富微电	9,470	133,527.00	0.11
263	000422	湖北宣化	21,800	133,198.00	0.11
264	002510	天汽模	16,000	133,120.00	0.11
265	600527	江南高纤	19,500	132,990.00	0.11
266	002471	中超控股	21,600	132,840.00	0.11
267	600382	广东明珠	8,300	132,800.00	0.11
268	002296	辉煌科技	7,300	132,495.00	0.11
269	300128	锦富新材	7,300	131,911.00	0.11
270	002413	雷科防务	9,600	131,808.00	0.11
271	600552	凯盛科技	6,500	131,560.00	0.11
272	600165	新日恒力	9,950	131,539.00	0.11
273	600116	三峡水利	16,900	131,482.00	0.11
274	600459	贵研铂业	4,400	131,472.00	0.11
275	600491	龙元建设	15,300	131,274.00	0.11
276	600767	运盛医疗	8,300	130,974.00	0.11
277	600807	天业股份	10,800	130,896.00	0.11
278	000016	深康佳 A	27,200	130,832.00	0.11
279	002581	未名医药	4,800	130,800.00	0.11
280	002429	兆驰股份	15,600	130,728.00	0.11
281	300157	恒泰艾普	12,100	130,559.00	0.11
282	600238	海南椰岛	10,900	130,255.00	0.11
283	300045	华力创通	6,800	130,220.00	0.11
284	600173	卧龙地产	15,700	129,996.00	0.11
285	002684	猛狮科技	4,000	129,920.00	0.11
286	600836	界龙实业	11,300	129,837.00	0.11

287	000683	远兴能源	49,540	129,794.80	0.11
288	600502	安徽水利	17,580	129,564.60	0.11
289	002222	福晶科技	8,250	129,525.00	0.11
290	600105	永鼎股份	13,800	129,306.00	0.11
291	600209	罗顿发展	11,600	129,108.00	0.11
292	600318	新力金融	4,800	128,832.00	0.11
293	600713	南京医药	15,300	128,826.00	0.11
294	300458	全志科技	1,200	128,376.00	0.11
295	002464	金利科技	2,100	128,310.00	0.11
296	002496	辉丰股份	21,920	128,232.00	0.11
297	603609	禾丰牧业	8,100	128,223.00	0.11
298	000035	中国天楹	18,100	127,967.00	0.11
299	002229	鸿博股份	5,100	127,908.00	0.11
300	002631	德尔未来	4,800	127,680.00	0.11
301	002188	巴士在线	4,400	127,292.00	0.11
302	601890	XD 亚星锚	14,000	127,260.00	0.11
303	002567	唐人神	9,100	127,218.00	0.11
304	600641	万业企业	9,800	127,106.00	0.11
305	002298	中电鑫龙	7,700	127,050.00	0.11
306	300100	双林股份	2,900	127,049.00	0.11
307	300219	鸿利光电	8,150	126,977.00	0.10
308	300322	硕贝德	5,900	126,850.00	0.10
309	000735	罗牛山	19,600	126,420.00	0.10
310	000682	东方电子	23,800	126,378.00	0.10
311	000407	胜利股份	18,700	125,851.00	0.10
312	600668	尖峰集团	8,400	125,832.00	0.10
313	300047	天源迪科	6,300	125,685.00	0.10
314	002239	奥特佳	7,800	125,658.00	0.10
315	600420	现代制药	4,200	125,580.00	0.10
316	300339	润和软件	3,500	125,440.00	0.10
317	600321	国栋建设	31,200	125,424.00	0.10
318	600106	重庆路桥	17,700	125,316.00	0.10
319	600400	红豆股份	13,800	125,304.00	0.10
320	600626	申达股份	12,100	124,872.00	0.10
321	300137	先河环保	8,400	124,236.00	0.10
322	300098	高新兴	7,820	124,181.60	0.10
323	000537	广宇发展	15,500	124,155.00	0.10
324	600285	羚锐制药	11,500	124,085.00	0.10
325	600063	皖维高新	28,000	124,040.00	0.10

326	000915	山大华特	3,500	123,795.00	0.10
327	000700	模塑科技	12,200	123,586.00	0.10
328	600269	赣粤高速	28,400	123,540.00	0.10
329	000886	海南高速	19,200	123,456.00	0.10
330	300066	三川智慧	12,600	123,354.00	0.10
331	000821	京山轻机	7,000	123,340.00	0.10
332	600486	扬农化工	4,500	123,300.00	0.10
333	002262	恩华药业	6,110	123,116.50	0.10
334	300005	探路者	7,200	122,760.00	0.10
335	600775	南京熊猫	8,200	122,590.00	0.10
336	000533	万家乐	11,800	122,484.00	0.10
337	300028	金亚科技	6,700	122,342.00	0.10
338	600185	格力地产	19,680	122,212.80	0.10
339	000536	华映科技	7,600	122,208.00	0.10
340	002329	皇氏集团	8,140	122,018.60	0.10
341	002383	合众思壮	3,400	121,822.00	0.10
342	000838	财信发展	10,700	121,659.00	0.10
343	603368	柳州医药	1,400	121,548.00	0.10
344	600012	皖通高速	8,500	121,465.00	0.10
345	002043	兔宝宝	12,100	121,363.00	0.10
346	300049	福瑞股份	5,100	121,227.00	0.10
347	002263	大东南	27,400	120,834.00	0.10
348	600846	同济科技	12,200	120,780.00	0.10
349	300263	隆华节能	10,800	120,744.00	0.10
350	000673	当代东方	9,600	120,288.00	0.10
351	600096	云天化	12,900	119,970.00	0.10
352	300326	凯利泰	4,800	119,952.00	0.10
353	600123	兰花科创	16,700	119,906.00	0.10
354	300231	银信科技	6,500	119,860.00	0.10
355	300288	朗玛信息	3,300	119,658.00	0.10
356	600595	中孚实业	21,200	119,568.00	0.10
357	002650	加加食品	16,800	119,448.00	0.10
358	603508	思维列控	1,200	119,292.00	0.10
359	002197	证通电子	6,200	119,164.00	0.10
360	000910	大亚科技	7,700	118,965.00	0.10
361	002247	帝龙新材	8,000	118,960.00	0.10
362	000790	华神集团	10,500	118,755.00	0.10
363	002649	博彦科技	3,000	118,710.00	0.10
364	002527	新时达	7,500	118,500.00	0.10

365	002080	中材科技	5,900	118,472.00	0.10
366	002079	苏州固锴	10,600	118,402.00	0.10
367	300222	科大智能	4,320	118,324.80	0.10
368	600630	龙头股份	7,200	118,152.00	0.10
369	002279	久其软件	5,300	117,554.00	0.10
370	002178	延华智能	10,700	117,486.00	0.10
371	300352	北信源	6,290	117,434.30	0.10
372	000819	岳阳兴长	4,410	117,217.80	0.10
373	600057	象屿股份	11,400	117,192.00	0.10
374	300171	东富龙	6,200	117,056.00	0.10
375	002717	岭南园林	3,900	116,454.00	0.10
376	002636	金安国纪	7,100	116,440.00	0.10
377	300356	光一科技	2,400	116,256.00	0.10
378	002167	东方锆业	10,600	116,070.00	0.10
379	000545	金浦钛业	16,800	115,920.00	0.10
380	002215	诺普信	11,200	115,808.00	0.10
381	000996	中国中期	5,600	115,808.00	0.10
382	002020	京新药业	9,300	115,041.00	0.10
383	002157	正邦科技	4,900	114,954.00	0.10
384	600438	通威股份	18,000	114,480.00	0.09
385	300149	量子高科	6,200	114,390.00	0.09
386	600405	动力源	8,500	114,240.00	0.09
387	300369	绿盟科技	2,700	114,237.00	0.09
388	300256	星星科技	6,300	114,156.00	0.09
389	000705	浙江震元	8,100	114,129.00	0.09
390	300083	劲胜精密	13,800	113,988.00	0.09
391	000573	粤宏远 A	15,100	113,854.00	0.09
392	300318	博晖创新	11,952	113,424.48	0.09
393	600624	复旦复华	9,000	113,400.00	0.09
394	000788	北大医药	8,700	113,361.00	0.09
395	002433	太安堂	11,300	113,226.00	0.09
396	600273	嘉化能源	12,700	113,157.00	0.09
397	002539	新都化工	7,400	113,146.00	0.09
398	002655	共达电声	7,000	113,050.00	0.09
399	002334	英威腾	12,700	113,030.00	0.09
400	601011	宝泰隆	20,000	113,000.00	0.09
401	300048	合康变频	9,600	112,896.00	0.09
402	002454	松芝股份	6,200	112,716.00	0.09
403	600072	XD 钢构工	8,100	112,671.00	0.09

404	300316	晶盛机电	8,600	112,660.00	0.09
405	600114	东睦股份	6,700	112,627.00	0.09
406	000409	山东地矿	11,007	112,161.33	0.09
407	000757	浩物股份	10,600	111,936.00	0.09
408	300429	强力新材	800	111,728.00	0.09
409	002585	双星新材	10,500	111,510.00	0.09
410	000042	中洲控股	6,500	111,280.00	0.09
411	300224	正海磁材	4,900	111,083.00	0.09
412	300463	迈克生物	4,100	110,987.00	0.09
413	000936	华西股份	13,500	110,970.00	0.09
414	002596	海南瑞泽	3,900	110,955.00	0.09
415	000918	嘉凯城	17,600	110,704.00	0.09
416	600550	保变电气	18,700	110,143.00	0.09
417	002154	报喜鸟	22,800	110,124.00	0.09
418	300217	东方电热	24,720	110,004.00	0.09
419	600288	大恒科技	8,500	109,990.00	0.09
420	002540	亚太科技	12,600	109,872.00	0.09
421	002521	齐峰新材	9,600	109,824.00	0.09
422	600129	太极集团	6,200	109,802.00	0.09
423	300016	北陆药业	4,800	109,680.00	0.09
424	002182	云海金属	5,500	109,450.00	0.09
425	000903	云内动力	13,600	109,208.00	0.09
426	300426	唐德影视	1,600	109,120.00	0.09
427	600590	泰豪科技	8,100	109,026.00	0.09
428	600794	保税科技	20,300	109,011.00	0.09
429	600686	金龙汽车	7,400	109,002.00	0.09
430	002590	万安科技	3,500	108,955.00	0.09
431	600136	当代明诚	4,700	108,805.00	0.09
432	002126	银轮股份	12,300	108,486.00	0.09
433	000888	峨眉山 A	9,000	108,360.00	0.09
434	002518	科士达	4,350	108,228.00	0.09
435	002452	长高集团	9,000	108,180.00	0.09
436	600331	宏达股份	19,800	108,108.00	0.09
437	002170	芭田股份	12,800	108,032.00	0.09
438	300074	华平股份	9,000	108,000.00	0.09
439	300109	新开源	1,700	107,950.00	0.09
440	600568	中珠控股	6,200	107,880.00	0.09
441	002425	凯撒股份	4,900	107,800.00	0.09
442	600531	豫光金铅	12,900	107,715.00	0.09

443	002434	万里扬	9,900	107,712.00	0.09
444	002449	国星光电	8,100	107,487.00	0.09
445	002712	思美传媒	3,000	107,280.00	0.09
446	300295	三六五网	3,300	107,250.00	0.09
447	002369	卓翼科技	9,500	106,875.00	0.09
448	600824	益民集团	17,900	106,863.00	0.09
449	601069	西部黄金	4,600	106,766.00	0.09
450	600227	赤天化	18,500	106,375.00	0.09
451	603588	高能环境	3,900	106,275.00	0.09
452	002297	博云新材	8,100	106,029.00	0.09
453	600033	福建高速	33,400	105,878.00	0.09
454	002556	辉隆股份	7,000	105,770.00	0.09
455	300223	北京君正	2,400	105,600.00	0.09
456	603308	应流股份	4,200	105,588.00	0.09
457	600084	中葡股份	16,400	105,452.00	0.09
458	000966	长源电力	16,200	105,300.00	0.09
459	002100	天康生物	11,700	105,183.00	0.09
460	300044	赛为智能	8,100	105,057.00	0.09
461	300050	世纪鼎利	7,300	105,047.00	0.09
462	002071	长城影视	7,700	105,028.00	0.09
463	002737	葵花药业	2,800	104,916.00	0.09
464	600589	广东榕泰	10,300	104,545.00	0.09
465	002446	盛路通信	3,300	104,478.00	0.09
466	002042	华孚色纺	10,100	104,434.00	0.09
467	300245	天玑科技	4,700	104,340.00	0.09
468	000731	四川美丰	14,400	104,112.00	0.09
469	000701	厦门信达	5,900	104,017.00	0.09
470	600965	福成股份	8,000	103,840.00	0.09
471	000739	普洛药业	16,700	103,707.00	0.09
472	002037	久联发展	6,400	103,552.00	0.09
473	600237	铜峰电子	13,600	103,496.00	0.09
474	300348	长亮科技	2,800	103,488.00	0.09
475	002502	骅威文化	4,200	103,320.00	0.09
476	300080	易成新能	13,300	103,208.00	0.09
477	600526	菲达环保	8,000	103,040.00	0.09
478	000952	广济药业	6,100	102,846.00	0.09
479	002658	雪迪龙	5,900	102,601.00	0.08
480	300006	莱美药业	11,838	102,517.08	0.08
481	600742	一汽富维	8,200	102,418.00	0.08

482	000506	中润资源	13,600	102,408.00	0.08
483	600986	科达股份	6,400	102,272.00	0.08
484	600621	华鑫股份	10,200	102,204.00	0.08
485	002609	捷顺科技	5,800	102,022.00	0.08
486	600093	禾嘉股份	8,200	101,762.00	0.08
487	300363	博腾股份	4,100	101,762.00	0.08
488	000531	穗恒运 A	8,300	101,426.00	0.08
489	600305	恒顺醋业	8,800	101,376.00	0.08
490	002671	龙泉股份	8,200	101,270.00	0.08
491	000752	西藏发展	6,400	101,248.00	0.08
492	002009	天奇股份	6,200	101,246.00	0.08
493	002526	山东矿机	10,400	101,192.00	0.08
494	300376	易事特	3,700	100,973.00	0.08
495	300064	豫金刚石	9,900	100,782.00	0.08
496	601700	风范股份	13,800	100,602.00	0.08
497	300392	腾信股份	3,700	100,196.00	0.08
498	002432	九安医疗	5,500	99,770.00	0.08
499	002148	北纬通信	5,000	99,750.00	0.08
500	002769	普路通	1,100	99,748.00	0.08
501	000837	秦川机床	11,800	99,710.00	0.08
502	600479	千金药业	5,900	99,651.00	0.08
503	000070	特发信息	3,800	99,636.00	0.08
504	300056	三维丝	5,500	99,275.00	0.08
505	002212	南洋股份	8,800	99,264.00	0.08
506	000767	漳泽电力	27,400	99,188.00	0.08
507	600007	中国国贸	4,900	98,980.00	0.08
508	000584	友利控股	10,400	98,904.00	0.08
509	002546	新联电子	8,060	98,896.20	0.08
510	300373	扬杰科技	4,100	98,851.00	0.08
511	000928	中钢国际	7,800	98,124.00	0.08
512	002484	江海股份	6,420	97,905.00	0.08
513	600784	鲁银投资	11,100	97,791.00	0.08
514	002083	孚日股份	15,500	97,650.00	0.08
515	002575	群兴玩具	8,600	97,610.00	0.08
516	300342	天银机电	3,200	97,472.00	0.08
517	002612	朗姿股份	3,900	97,227.00	0.08
518	000553	沙隆达 A	9,100	97,188.00	0.08
519	600308	华泰股份	19,900	97,112.00	0.08
520	002516	旷达科技	16,100	97,083.00	0.08

521	002335	科华恒盛	2,000	97,040.00	0.08
522	300177	中海达	6,400	97,024.00	0.08
523	002564	天沃科技	12,600	97,020.00	0.08
524	002504	弘高创意	4,000	96,800.00	0.08
525	600020	中原高速	21,900	96,798.00	0.08
526	002711	欧浦智网	6,480	96,552.00	0.08
527	002453	天马精化	11,100	96,459.00	0.08
528	002476	宝莫股份	11,900	96,271.00	0.08
529	300229	拓尔思	4,500	96,210.00	0.08
530	002214	大立科技	7,800	96,174.00	0.08
531	002324	普利特	3,300	96,096.00	0.08
532	300355	蒙草抗旱	13,500	95,985.00	0.08
533	600322	天房发展	21,500	95,890.00	0.08
534	002542	中化岩土	12,650	95,887.00	0.08
535	002246	北化股份	6,800	95,880.00	0.08
536	000159	国际实业	12,500	95,375.00	0.08
537	300298	三诺生物	4,550	95,368.00	0.08
538	600555	海航创新	16,600	95,118.00	0.08
539	300303	聚飞光电	10,000	95,100.00	0.08
540	002137	麦达数字	5,600	94,976.00	0.08
541	000576	广东甘化	6,500	94,900.00	0.08
542	603686	龙马环卫	2,600	94,822.00	0.08
543	600843	上工申贝	6,900	94,599.00	0.08
544	002626	金达威	5,600	94,360.00	0.08
545	002231	奥维通信	6,100	94,306.00	0.08
546	300148	天舟文化	6,200	94,302.00	0.08
547	002206	海利得	5,500	94,215.00	0.08
548	002519	银河电子	4,200	94,164.00	0.08
549	600338	西藏珠峰	3,200	94,048.00	0.08
550	002139	拓邦股份	6,500	93,990.00	0.08
551	600501	航天晨光	5,100	93,840.00	0.08
552	600396	金山股份	17,900	93,796.00	0.08
553	600676	交运股份	10,500	93,765.00	0.08
554	002554	惠博普	13,000	93,600.00	0.08
555	600987	航民股份	7,700	93,324.00	0.08
556	300432	富临精工	2,600	93,262.00	0.08
557	300205	天喻信息	6,300	93,177.00	0.08
558	000782	美达股份	10,300	93,112.00	0.08
559	600480	凌云股份	6,600	93,060.00	0.08

560	600133	东湖高新	12,300	92,988.00	0.08
561	002597	金禾实业	6,900	92,943.00	0.08
562	002147	新光圆成	6,000	92,940.00	0.08
563	600726	华电能源	18,700	92,939.00	0.08
564	000863	三湘股份	10,100	92,920.00	0.08
565	300419	浩丰科技	2,200	92,906.00	0.08
566	603008	喜临门	5,400	92,826.00	0.08
567	600838	上海九百	7,800	92,820.00	0.08
568	002322	理工环科	4,900	92,806.00	0.08
569	000958	东方能源	6,700	92,795.00	0.08
570	002604	龙力生物	8,600	92,794.00	0.08
571	000657	中钨高新	6,100	92,415.00	0.08
572	600257	大湖股份	8,300	92,379.00	0.08
573	002301	齐心集团	4,500	92,250.00	0.08
574	002531	天顺风能	14,380	92,175.80	0.08
575	002338	奥普光电	1,500	92,175.00	0.08
576	002611	东方精工	8,500	92,140.00	0.08
577	002111	威海广泰	3,500	92,015.00	0.08
578	002226	江南化工	9,600	91,968.00	0.08
579	600135	乐凯胶片	5,400	91,908.00	0.08
580	000665	湖北广电	6,200	91,884.00	0.08
581	002571	德力股份	5,700	91,770.00	0.08
582	300198	纳川股份	5,700	91,713.00	0.08
583	000828	东莞控股	10,100	91,708.00	0.08
584	002559	亚威股份	6,200	91,450.00	0.08
585	600386	北巴传媒	4,900	91,434.00	0.08
586	000404	华意压缩	9,500	91,390.00	0.08
587	600530	交大昂立	11,400	91,314.00	0.08
588	002033	丽江旅游	7,200	91,296.00	0.08
589	600439	瑞贝卡	16,100	91,287.00	0.08
590	002255	海陆重工	10,600	91,266.00	0.08
591	600692	亚通股份	6,000	91,260.00	0.08
592	300152	科融环境	12,100	91,234.00	0.08
593	002494	华斯股份	5,900	91,155.00	0.08
594	600684	珠江实业	12,100	90,871.00	0.08
595	000925	众合科技	4,700	90,710.00	0.07
596	002689	远大智能	11,700	90,675.00	0.07
597	002348	高乐股份	13,800	90,666.00	0.07
598	300051	三五互联	4,500	90,585.00	0.07

599	300278	华昌达	5,300	90,577.00	0.07
600	000797	中国武夷	6,050	90,387.00	0.07
601	600818	中路股份	2,900	90,219.00	0.07
602	300215	电科院	7,000	90,160.00	0.07
603	002235	安妮股份	4,950	90,139.50	0.07
604	002172	澳洋科技	8,400	90,132.00	0.07
605	601616	广电电气	15,900	89,994.00	0.07
606	300193	佳士科技	8,660	89,977.40	0.07
607	300439	美康生物	2,500	89,950.00	0.07
608	600616	金枫酒业	8,798	89,915.56	0.07
609	600290	华仪电气	9,200	89,884.00	0.07
610	000868	安凯客车	11,800	89,798.00	0.07
611	600661	新南洋	3,200	89,792.00	0.07
612	300071	华谊嘉信	8,300	89,640.00	0.07
613	000301	东方市场	20,700	89,631.00	0.07
614	600815	厦工股份	14,000	89,180.00	0.07
615	002741	光华科技	3,500	89,145.00	0.07
616	300018	中元华电	7,000	88,970.00	0.07
617	002102	冠福股份	7,100	88,892.00	0.07
618	300364	中文在线	1,706	88,712.00	0.07
619	601218	吉鑫科技	16,900	88,556.00	0.07
620	600789	鲁抗医药	9,900	88,506.00	0.07
621	000909	数源科技	4,300	88,322.00	0.07
622	300351	永贵电器	2,600	88,218.00	0.07
623	300086	康芝药业	7,650	87,975.00	0.07
624	603018	设计股份	3,040	87,734.40	0.07
625	002021	中捷资源	10,000	87,700.00	0.07
626	002086	东方海洋	10,000	87,500.00	0.07
627	300129	泰胜风能	12,500	87,500.00	0.07
628	600193	创兴资源	7,200	87,336.00	0.07
629	000065	北方国际	2,700	87,291.00	0.07
630	002733	雄韬股份	2,950	86,877.50	0.07
631	600469	风神股份	8,150	86,716.00	0.07
632	600477	杭萧钢构	12,710	86,682.20	0.07
633	300130	新国都	2,800	86,520.00	0.07
634	300114	中航电测	2,900	86,420.00	0.07
635	300204	舒泰神	4,678	86,262.32	0.07
636	600973	宝胜股份	10,940	86,207.20	0.07
637	600207	安彩高科	8,400	85,932.00	0.07

638	002441	众业达	5,300	85,807.00	0.07
639	002321	华英农业	9,100	85,722.00	0.07
640	000571	新大洲 A	15,000	85,650.00	0.07
641	300057	万顺股份	5,300	85,595.00	0.07
642	600800	天津磁卡	11,900	85,561.00	0.07
643	300150	世纪瑞尔	7,900	85,557.00	0.07
644	300255	常山药业	10,300	85,490.00	0.07
645	002362	汉王科技	3,100	85,219.00	0.07
646	002259	升达林业	11,000	85,030.00	0.07
647	002666	德联集团	9,200	85,008.00	0.07
648	000058	深赛格	7,900	85,004.00	0.07
649	002574	明牌珠宝	6,500	84,760.00	0.07
650	600543	莫高股份	6,200	84,692.00	0.07
651	300030	阳普医疗	5,300	84,588.00	0.07
652	002166	莱茵生物	7,400	84,582.00	0.07
653	600239	云南城投	18,200	84,448.00	0.07
654	000507	珠海港	15,400	84,392.00	0.07
655	002274	华昌化工	8,000	84,000.00	0.07
656	000987	广州友谊	6,500	83,850.00	0.07
657	300052	中青宝	3,800	83,714.00	0.07
658	300485	赛升药业	1,800	83,628.00	0.07
659	300494	盛天网络	1,800	83,610.00	0.07
660	300041	回天新材	5,800	83,462.00	0.07
661	000607	华媒控股	9,900	83,457.00	0.07
662	603128	华贸物流	8,500	83,385.00	0.07
663	300358	楚天科技	4,300	83,334.00	0.07
664	300135	宝利国际	15,700	83,210.00	0.07
665	603012	创力集团	6,200	83,204.00	0.07
666	600683	京投发展	9,000	83,160.00	0.07
667	002662	京威股份	5,500	83,105.00	0.07
668	000990	诚志股份	4,700	83,049.00	0.07
669	600229	城市传媒	6,800	82,960.00	0.07
670	600310	桂东电力	10,100	82,921.00	0.07
671	002313	日海通讯	6,100	82,899.00	0.07
672	600467	好当家	21,300	82,857.00	0.07
673	002393	力生制药	2,200	82,852.00	0.07
674	600488	天药股份	14,000	82,740.00	0.07
675	603456	九洲药业	3,200	82,624.00	0.07
676	000523	广州浪奇	7,600	82,612.00	0.07

677	002225	濮耐股份	13,000	82,420.00	0.07
678	002406	远东传动	9,600	82,272.00	0.07
679	300181	佐力药业	8,900	82,236.00	0.07
680	002090	金智科技	2,800	82,236.00	0.07
681	601789	宁波建工	14,200	82,076.00	0.07
682	600191	华资实业	5,900	81,951.00	0.07
683	600680	上海普天	1,900	81,909.00	0.07
684	600336	澳柯玛	11,600	81,780.00	0.07
685	603167	渤海轮渡	8,200	81,590.00	0.07
686	600055	DR 华润万	4,640	81,478.40	0.07
687	002538	司尔特	8,700	81,345.00	0.07
688	300456	耐威科技	1,200	81,300.00	0.07
689	600197	伊力特	5,400	81,216.00	0.07
690	000948	南天信息	4,200	81,102.00	0.07
691	000554	泰山石油	9,400	80,840.00	0.07
692	002372	伟星新材	5,620	80,703.20	0.07
693	600708	光明地产	9,600	80,544.00	0.07
694	600995	文山电力	8,100	80,514.00	0.07
695	002614	蒙发利	6,700	80,467.00	0.07
696	002115	三维通信	7,000	80,430.00	0.07
697	600192	长城电工	7,500	80,400.00	0.07
698	300360	炬华科技	3,550	80,336.50	0.07
699	002586	围海股份	8,900	80,278.00	0.07
700	002472	双环传动	3,300	80,256.00	0.07
701	000561	烽火电子	7,200	80,064.00	0.07
702	300451	创业软件	1,800	79,938.00	0.07
703	300140	启源装备	3,600	79,920.00	0.07
704	600857	宁波中百	5,500	79,860.00	0.07
705	002520	日发精机	5,400	79,704.00	0.07
706	002697	红旗连锁	13,140	79,365.60	0.07
707	000589	黔轮胎 A	15,100	79,275.00	0.07
708	600119	长江投资	5,200	78,988.00	0.07
709	600077	宋都股份	16,300	78,892.00	0.07
710	002337	赛象科技	10,100	78,780.00	0.07
711	603808	歌力思	2,700	78,651.00	0.07
712	300155	安居宝	5,351	78,552.68	0.06
713	600961	株冶集团	7,700	78,463.00	0.06
714	300206	理邦仪器	7,050	78,396.00	0.06
715	000010	美丽生态	10,000	78,300.00	0.06

716	000416	民生控股	10,300	78,280.00	0.06
717	601636	旗滨集团	24,600	78,228.00	0.06
718	002535	林州重机	9,680	78,214.40	0.06
719	600222	太龙药业	9,800	78,106.00	0.06
720	300102	乾照光电	8,600	78,088.00	0.06
721	300248	新开普	2,900	78,039.00	0.06
722	300139	晓程科技	5,300	77,963.00	0.06
723	002606	大连电瓷	4,000	77,960.00	0.06
724	600326	西藏天路	9,700	77,794.00	0.06
725	300307	慈星股份	5,900	77,762.00	0.06
726	600127	金健米业	12,500	77,625.00	0.06
727	000722	湖南发展	5,600	77,448.00	0.06
728	601107	四川成渝	15,800	77,420.00	0.06
729	300406	九强生物	3,600	77,220.00	0.06
730	300312	邦讯技术	3,900	77,220.00	0.06
731	600533	XD 栖霞建	15,300	77,112.00	0.06
732	000096	广聚能源	6,400	76,928.00	0.06
733	603718	海利生物	4,685	76,927.70	0.06
734	603100	川仪股份	4,800	76,608.00	0.06
735	002232	启明信息	5,000	76,600.00	0.06
736	002198	嘉应制药	7,400	76,516.00	0.06
737	002184	海得控制	2,900	76,299.00	0.06
738	000532	力合股份	4,200	76,272.00	0.06
739	600834	申通地铁	5,800	76,038.00	0.06
740	600113	浙江东日	6,300	75,915.00	0.06
741	002584	西陇科学	5,700	75,867.00	0.06
742	600470	六国化工	10,100	75,851.00	0.06
743	002328	新朋股份	7,600	75,848.00	0.06
744	300276	三丰智能	3,600	75,816.00	0.06
745	002486	嘉麟杰	16,200	75,816.00	0.06
746	300334	津膜科技	4,200	75,810.00	0.06
747	300246	宝莱特	2,500	75,775.00	0.06
748	600865	百大集团	6,400	75,584.00	0.06
749	002565	上海绿新	10,200	75,582.00	0.06
750	600246	万通地产	14,800	75,480.00	0.06
751	300465	高伟达	1,000	75,140.00	0.06
752	603939	益丰药房	2,300	75,026.00	0.06
753	300398	飞凯材料	1,000	74,800.00	0.06
754	300162	雷曼股份	3,400	74,766.00	0.06

755	300438	鹏辉能源	1,800	74,682.00	0.06
756	600283	钱江水利	6,000	74,460.00	0.06
757	002391	长青股份	5,200	74,360.00	0.06
758	300467	迅游科技	1,200	74,256.00	0.06
759	002561	徐家汇	6,100	74,176.00	0.06
760	600814	杭州解百	7,000	74,130.00	0.06
761	002171	楚江新材	4,300	74,089.00	0.06
762	000151	中成股份	4,300	73,960.00	0.06
763	002351	漫步者	5,700	73,872.00	0.06
764	002363	隆基机械	5,660	73,693.20	0.06
765	600798	宁波海运	15,000	73,650.00	0.06
766	300021	大禹节水	3,900	73,476.00	0.06
767	002017	东信和平	5,100	73,440.00	0.06
768	300110	华仁药业	7,700	73,381.00	0.06
769	600876	洛阳玻璃	2,700	73,224.00	0.06
770	600162	DR 香江控	17,450	73,115.50	0.06
771	600738	兰州民百	8,600	73,014.00	0.06
772	600082	海泰发展	12,600	72,954.00	0.06
773	600052	浙江广厦	10,600	72,928.00	0.06
774	002116	中国海诚	4,900	72,814.00	0.06
775	300165	天瑞仪器	6,700	72,561.00	0.06
776	300076	GQY 视讯	6,200	72,354.00	0.06
777	600354	敦煌种业	9,000	72,270.00	0.06
778	600830	香溢融通	7,700	72,226.00	0.06
779	000597	东北制药	8,100	71,928.00	0.06
780	600279	重庆港九	10,050	71,656.50	0.06
781	000965	天保基建	12,100	71,632.00	0.06
782	001896	豫能控股	8,300	71,546.00	0.06
783	600723	首商股份	8,000	71,440.00	0.06
784	600744	华银电力	13,000	71,370.00	0.06
785	603989	艾华集团	2,200	71,324.00	0.06
786	600740	山西焦化	13,000	71,110.00	0.06
787	603020	爱普股份	3,100	70,959.00	0.06
788	000591	太阳能	4,700	70,923.00	0.06
789	002114	罗平锌电	2,600	70,876.00	0.06
790	600592	龙溪股份	6,800	70,856.00	0.06
791	601199	江南水务	9,100	70,798.00	0.06
792	300413	快乐购	2,900	70,615.00	0.06
793	300213	佳讯飞鸿	2,500	70,600.00	0.06

794	002228	合兴包装	12,680	70,500.80	0.06
795	002107	沃华医药	4,400	70,400.00	0.06
796	000949	新乡化纤	17,500	70,175.00	0.06
797	000564	西安民生	7,300	70,080.00	0.06
798	002060	粤水电	10,200	70,074.00	0.06
799	002438	江苏神通	3,200	70,048.00	0.06
800	002378	章源钨业	6,700	70,015.00	0.06
801	300328	宜安科技	3,980	69,968.40	0.06
802	300311	任子行	3,201	69,845.82	0.06
803	600381	青海春天	5,100	69,819.00	0.06
804	300190	维尔利	4,000	69,480.00	0.06
805	002592	八菱科技	2,100	69,300.00	0.06
806	601339	百隆东方	10,900	69,215.00	0.06
807	600080	金花股份	5,900	69,030.00	0.06
808	603636	南威软件	1,000	69,000.00	0.06
809	300262	巴安水务	4,500	68,940.00	0.06
810	300482	万孚生物	1,300	68,835.00	0.06
811	600461	洪城水业	5,300	68,794.00	0.06
812	002227	奥特迅	2,100	68,628.00	0.06
813	601028	玉龙股份	9,600	68,544.00	0.06
814	600225	天津松江	11,400	68,514.00	0.06
815	002381	双箭股份	5,200	68,380.00	0.06
816	300172	中电环保	7,400	68,154.00	0.06
817	600313	农发种业	13,150	67,985.50	0.06
818	002401	中海科技	3,700	67,858.00	0.06
819	600979	广安爱众	11,500	67,850.00	0.06
820	300314	戴维医疗	2,800	67,844.00	0.06
821	600327	大东方	7,600	67,792.00	0.06
822	000905	厦门港务	6,500	67,730.00	0.06
823	300424	航新科技	1,000	67,720.00	0.06
824	000029	深深房 A	6,500	67,600.00	0.06
825	002579	中京电子	4,300	67,424.00	0.06
826	600168	武汉控股	6,900	67,344.00	0.06
827	002524	光正集团	8,600	67,338.00	0.06
828	300084	海默科技	5,500	67,210.00	0.06
829	603996	中新科技	2,200	67,122.00	0.06
830	300380	安硕信息	1,300	66,950.00	0.06
831	000043	中航地产	8,100	66,825.00	0.06
832	600982	宁波热电	12,700	66,802.00	0.06

833	002162	悦心健康	10,400	66,768.00	0.06
834	300399	京天利	1,550	66,743.00	0.06
835	300476	胜宏科技	2,700	66,528.00	0.06
836	600101	明星电力	5,500	66,495.00	0.05
837	000548	湖南投资	8,500	65,960.00	0.05
838	002529	海源机械	3,200	65,568.00	0.05
839	603898	好莱客	2,100	65,289.00	0.05
840	000889	茂业通信	6,000	65,100.00	0.05
841	600523	贵航股份	3,500	65,030.00	0.05
842	603126	中材节能	5,900	65,018.00	0.05
843	603999	读者传媒	2,100	64,953.00	0.05
844	000428	华天酒店	9,900	64,944.00	0.05
845	600508	上海能源	7,000	64,890.00	0.05
846	601566	九牧王	4,200	64,848.00	0.05
847	603979	金诚信	2,700	64,773.00	0.05
848	600735	新华锦	4,600	64,538.00	0.05
849	000018	神州长城	5,300	64,501.00	0.05
850	002135	东南网架	8,300	64,491.00	0.05
851	600218	全柴动力	6,300	64,386.00	0.05
852	000922	佳电股份	6,600	64,020.00	0.05
853	002751	易尚展示	1,000	64,010.00	0.05
854	600698	湖南天雁	10,800	63,936.00	0.05
855	601007	金陵饭店	5,100	63,903.00	0.05
856	002320	海峡股份	4,100	63,837.00	0.05
857	300254	仟源医药	2,500	63,650.00	0.05
858	002307	北新路桥	8,100	63,585.00	0.05
859	000498	山东路桥	11,000	63,360.00	0.05
860	002062	宏润建设	10,700	63,344.00	0.05
861	600449	宁夏建材	7,000	63,140.00	0.05
862	300105	龙源技术	7,500	63,075.00	0.05
863	300187	永清环保	4,700	62,980.00	0.05
864	002771	真视通	600	62,970.00	0.05
865	300337	银邦股份	8,000	62,960.00	0.05
866	000153	丰原药业	6,100	62,891.00	0.05
867	601677	明泰铝业	4,700	62,698.00	0.05
868	601968	宝钢包装	6,100	62,586.00	0.05
869	000514	渝开发	8,200	62,484.00	0.05
870	000551	创元科技	6,800	62,424.00	0.05
871	600604	市北高新	2,600	62,400.00	0.05

872	300175	朗源股份	6,900	62,376.00	0.05
873	600223	鲁商置业	12,200	62,220.00	0.05
874	000546	金圆股份	5,900	62,186.00	0.05
875	300289	利德曼	4,150	62,084.00	0.05
876	002747	埃斯顿	1,800	61,920.00	0.05
877	300272	开能环保	4,000	61,720.00	0.05
878	600128	弘业股份	4,800	61,584.00	0.05
879	300343	联创股份	2,830	61,439.30	0.05
880	300195	长荣股份	3,300	61,215.00	0.05
881	300119	瑞普生物	3,800	60,990.00	0.05
882	002667	鞍重股份	2,000	60,980.00	0.05
883	600897	厦门空港	2,900	60,784.00	0.05
884	300468	四方精创	800	60,536.00	0.05
885	002660	茂硕电源	4,000	60,280.00	0.05
886	300357	我武生物	1,600	60,256.00	0.05
887	600845	宝信软件	2,700	60,237.00	0.05
888	002218	拓日新能	5,900	60,180.00	0.05
889	600569	安阳钢铁	23,300	60,114.00	0.05
890	002528	英飞拓	6,750	59,940.00	0.05
891	000811	烟台冰轮	5,300	59,466.00	0.05
892	300443	金雷风电	890	59,371.90	0.05
893	002756	永兴特钢	2,600	59,332.00	0.05
894	002543	万和电气	3,200	59,168.00	0.05
895	600278	东方创业	3,800	59,090.00	0.05
896	002144	宏达高科	3,000	58,980.00	0.05
897	600359	新农开发	5,600	58,968.00	0.05
898	002483	润邦股份	5,100	58,854.00	0.05
899	300444	双杰电气	2,000	58,740.00	0.05
900	002457	青龙管业	5,700	58,539.00	0.05
901	600287	江苏舜天	6,400	58,432.00	0.05
902	002487	大金重工	6,600	58,410.00	0.05
903	601008	连云港	12,300	58,302.00	0.05
904	002356	赫美集团	2,300	58,282.00	0.05
905	000529	广弘控股	7,100	58,078.00	0.05
906	600658	电子城	5,600	57,848.00	0.05
907	000899	赣能股份	7,100	57,723.00	0.05
908	000419	通程控股	7,900	57,512.00	0.05
909	002388	新亚制程	4,900	57,379.00	0.05
910	300449	汉邦高科	1,000	57,140.00	0.05

911	300227	光韵达	2,400	57,096.00	0.05
912	000906	物产中拓	4,800	56,976.00	0.05
913	300389	艾比森	2,308	56,707.56	0.05
914	600159	大龙地产	12,100	56,507.00	0.05
915	603936	博敏电子	1,200	56,232.00	0.05
916	300378	鼎捷软件	1,950	56,004.00	0.05
917	603818	曲美家居	3,500	56,000.00	0.05
918	300349	金卡股份	1,300	55,900.00	0.05
919	300309	吉艾科技	4,200	55,776.00	0.05
920	000789	万年青	9,000	55,620.00	0.05
921	300403	地尔汉宇	1,000	55,570.00	0.05
922	603398	邦宝益智	1,500	55,410.00	0.05
923	300384	三联虹普	1,100	55,330.00	0.05
924	603338	浙江鼎力	1,200	55,320.00	0.05
925	603669	灵康药业	1,900	55,157.00	0.05
926	300164	通源石油	6,900	54,924.00	0.05
927	002499	科林环保	2,800	54,768.00	0.05
928	002763	汇洁股份	1,600	54,560.00	0.05
929	600548	深高速	7,000	54,530.00	0.05
930	600782	新钢股份	10,200	54,366.00	0.04
931	600560	金白天正	3,300	54,351.00	0.04
932	002302	西部建设	7,500	54,150.00	0.04
933	002382	蓝帆医疗	4,800	53,952.00	0.04
934	300440	运达科技	1,600	53,936.00	0.04
935	002783	凯龙股份	600	53,928.00	0.04
936	000014	沙河股份	2,900	53,708.00	0.04
937	000713	丰乐种业	5,100	53,652.00	0.04
938	002096	南岭民爆	3,600	53,640.00	0.04
939	000916	华北高速	10,700	53,607.00	0.04
940	300447	全信股份	1,200	53,604.00	0.04
941	000022	深赤湾 A	3,400	53,584.00	0.04
942	600724	宁波富达	10,500	53,550.00	0.04
943	002451	摩恩电气	4,300	53,406.00	0.04
944	300448	浩云科技	1,495	53,371.50	0.04
945	600371	万向德农	3,280	53,136.00	0.04
946	300209	天泽信息	2,100	53,025.00	0.04
947	603168	莎普爱思	1,200	52,800.00	0.04
948	600190	锦州港	13,000	52,650.00	0.04
949	300471	厚普股份	1,100	52,624.00	0.04

950	000570	苏常柴 A	6,000	52,320.00	0.04
951	002713	东易日盛	1,800	52,254.00	0.04
952	000011	深物业 A	3,900	52,221.00	0.04
953	601015	陕西黑猫	4,500	52,065.00	0.04
954	600802	福建水泥	6,500	52,000.00	0.04
955	603969	银龙股份	3,900	51,987.00	0.04
956	601188	龙江交通	12,800	51,840.00	0.04
957	002651	利君股份	4,900	51,499.00	0.04
958	601999	出版传媒	5,400	51,408.00	0.04
959	603599	广信股份	2,700	50,679.00	0.04
960	600716	凤凰股份	6,800	50,592.00	0.04
961	600981	汇鸿集团	6,000	50,580.00	0.04
962	603566	普莱柯	2,300	50,577.00	0.04
963	002677	浙江美大	4,640	50,390.40	0.04
964	603309	维力医疗	1,900	50,350.00	0.04
965	300388	国祯环保	2,200	50,182.00	0.04
966	600081	东风科技	3,100	50,127.00	0.04
967	600613	神奇制药	3,500	50,050.00	0.04
968	000637	茂化实华	7,600	50,008.00	0.04
969	300350	华鹏飞	1,400	49,980.00	0.04
970	600629	华建集团	2,600	49,582.00	0.04
971	603866	桃李面包	1,100	49,236.00	0.04
972	300473	德尔股份	700	48,965.00	0.04
973	002016	世荣兆业	5,900	48,734.00	0.04
974	002534	杭锅股份	4,550	48,457.50	0.04
975	002726	龙大肉食	3,200	48,416.00	0.04
976	002781	奇信股份	1,100	47,685.00	0.04
977	600121	郑州煤电	9,900	47,520.00	0.04
978	601368	绿城水务	3,600	47,340.00	0.04
979	300293	蓝英装备	2,600	46,540.00	0.04
980	603299	井神股份	2,700	46,359.00	0.04
981	603800	道森股份	1,500	46,125.00	0.04
982	603227	雪峰科技	2,400	46,080.00	0.04
983	603789	星光农机	1,500	44,160.00	0.04
984	002605	姚记扑克	2,700	44,037.00	0.04
985	002750	龙津药业	2,900	43,442.00	0.04
986	300436	广生堂	700	42,994.00	0.04
987	603600	永艺股份	700	42,000.00	0.03
988	002724	海洋王	1,900	41,914.00	0.03

989	002644	佛慈制药	3,700	41,477.00	0.03
990	601038	一拖股份	4,300	40,721.00	0.03
991	002752	昇兴股份	2,350	39,574.00	0.03
992	603997	继峰股份	2,000	39,480.00	0.03
993	002346	柘中股份	2,100	39,039.00	0.03
994	600792	云煤能源	7,200	36,504.00	0.03
995	603116	红蜻蜓	1,500	35,520.00	0.03
996	603099	长白山	1,900	34,029.00	0.03
997	603166	福达股份	1,740	30,780.60	0.03
998	603117	万林股份	1,500	28,050.00	0.02
999	300292	吴通控股	400	13,304.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000806	银河生物	20,200	392,688.00	0.32
2	002555	三七互娱	13,800	295,458.00	0.24
3	300166	东方国信	7,900	217,013.00	0.18
4	002289	*ST 宇顺	5,100	132,804.00	0.11
5	002207	准油股份	5,800	124,236.00	0.10
6	300323	华灿光电	12,200	109,678.00	0.09
7	002012	凯恩股份	10,800	94,068.00	0.08
8	600475	华光股份	5,100	75,735.00	0.06
9	002046	轴研科技	7,000	72,310.00	0.06
10	000968	*ST 煤气	8,000	69,680.00	0.06
11	002379	*ST 鲁丰	15,400	58,982.00	0.05

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	300383	光环新网	276,221.00	0.15
2	000048	康达尔	272,419.00	0.15

3	002176	江特电机	267,821.00	0.15
4	300496	中科创达	262,186.00	0.15
5	300324	旋极信息	256,899.00	0.14
6	000520	长航凤凰	252,475.00	0.14
7	002407	多氟多	251,101.00	0.14
8	600868	梅雁吉祥	248,189.00	0.14
9	600110	诺德股份	238,433.00	0.13
10	002343	慈文传媒	237,770.52	0.13
11	002517	恺英网络	228,788.00	0.13
12	300028	金亚科技	216,970.00	0.12
13	002426	胜利精密	213,501.00	0.12
14	000627	天茂集团	213,266.00	0.12
15	300266	兴源环境	211,711.50	0.12
16	002070	众和股份	207,585.00	0.12
17	300113	顺网科技	207,512.00	0.12
18	002544	杰赛科技	206,598.00	0.11
19	300159	新研股份	204,109.50	0.11
20	300136	信维通信	202,604.00	0.11

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	300113	顺网科技	731,434.40	0.41
2	600682	南京新百	700,394.00	0.39
3	002426	胜利精密	675,230.80	0.37
4	002572	索菲亚	651,603.00	0.36
5	600666	奥瑞德	516,788.00	0.29
6	002131	利欧股份	483,478.00	0.27
7	600687	刚泰控股	467,244.60	0.26
8	002075	沙钢股份	464,212.60	0.26
9	600565	迪马股份	452,784.88	0.25
10	000008	神州高铁	452,374.00	0.25
11	002268	卫士通	443,787.20	0.25
12	002074	国轩高科	436,313.04	0.24
13	300287	飞利信	427,213.00	0.24

14	002366	台海核电	421,798.73	0.23
15	300001	特锐德	420,053.50	0.23
16	002407	多氟多	416,896.00	0.23
17	002589	瑞康医药	391,129.93	0.22
18	300010	立思辰	380,646.60	0.21
19	002512	达华智能	359,461.78	0.20
20	002002	鸿达兴业	329,301.00	0.18

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	82,987,669.06
卖出股票收入（成交）总额	110,726,373.70

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

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。

沃森生物（300142）于 2016 年 3 月 25 日收到国家食品药品监督管理总局通知，将对子公司进行调查。于 2016 年 4 月 22 日收到山东省食品药品监督管理局和福建省食品药品监督管理局的《行政处罚事先告知书》和《听证告知书》，将对山东实杰和圣泰（莆田）进行吊销《药品经营许可证》的行政处罚。

众和股份（002070）于 2015 年 8 月 27 日收到中国证券监督管理委员会福建监管局行政监管措施决定书。因公司部分担保超授权且未披露，会计核算错误，决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。

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七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。

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	32,836.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,458.00
5	应收申购款	54,423.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,717.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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	300142	沃森生物	366,048.00	0.30	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000806	银河生物	392,688.00	0.32	重大事项停牌
2	002555	三七互娱	295,458.00	0.24	重大事项停牌
3	300166	东方国信	217,013.00	0.18	重大事项停牌
4	002289	*ST 宇顺	132,804.00	0.11	重大事项停牌
5	002207	准油股份	124,236.00	0.10	重大事项停牌

§ 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

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	122	112,902.93	12,008,600.00	87.18%	1,765,557.00	12.82%
1000B	589	23,385.67	643,250.00	4.67%	13,130,907.00	95.33%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	4,363	26,457.78	744,671.96	0.65%	114,690,609.51	99.35%
合计	5,074	28,179.66	13,396,521.96	9.37%	129,587,073.51	90.63%

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。

8.2 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	5,969,246.00	43.34%
2	上海明汭投资管理有限公司—明汭多策略对冲 1 号基金	5,834,154.00	42.36%
3	陈杰	993,024.00	7.21%
4	上海明汭投资管理有限公司—明汭 CTA 一号基金	80,000.00	0.58%
5	平安养老保险股份有限公司—平安养老睿富优选 FOF 资产管理产	69,100.00	0.50%
6	孙庆华	60,000.00	0.44%
7	黄维嘉	60,000.00	0.44%
8	郑志坤	49,800.00	0.36%
9	陈敏	40,000.00	0.29%
10	上海千象资产管理有限公司—千象子基金 2 号	36,000.00	0.26%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额
----	-------	---------	--------

			比例
1	武超	2,814,862.00	20.44%
2	肖文舟	2,046,600.00	14.86%
3	厦门国际信托有限公司-紫鑫三号证券投资集合资金信托计划	600,000.00	4.36%
4	王静	285,600.00	2.07%
5	张路	239,000.00	1.74%
6	赵志强	238,900.00	1.73%
7	吴天爵	225,000.00	1.63%
8	周立华	207,000.00	1.50%
9	翟晓明	182,616.00	1.33%
10	董耀韵	174,700.00	1.27%

8.3 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	37,957.29	0.0329%
	合计	37,957.29	0.0265%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	1000A	0
	1000B	0
	华宝兴业中证 1000 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝兴业中证 1000 指数分级	0
	合计	0

§ 9 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）	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	7,765,201.00	7,765,201.00	158,437,073.30
本报告期基金总申购份额	—	—	86,854,771.20
减:本报告期基金总赎回份额	—	—	117,838,651.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	6,008,956.00	6,008,956.00	-12,017,912.00
本报告期期末基金份额总额	13,774,157.00	13,774,157.00	115,435,281.47

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

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

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

- 1、本报告期内，基金管理人未有受到稽查或处罚的情况。
- 2、本报告期内，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、本报告期内，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。

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	
中信证券	2	42,510,648.40	21.95%	39,591.38	21.97%	-
平安证券	1	41,021,721.37	21.18%	38,203.76	21.20%	-
申万宏源	3	36,433,687.51	18.81%	33,930.84	18.83%	-
华宝证券	1	19,239,406.83	9.93%	17,918.89	9.94%	-
安信证券	1	16,008,090.43	8.26%	14,908.99	8.27%	-
国信证券	1	13,093,551.15	6.76%	12,193.90	6.77%	-
东北证券	1	5,656,098.68	2.92%	5,267.67	2.92%	-
中泰证券	2	5,224,482.49	2.70%	4,761.10	2.64%	-
东兴证券	1	3,676,506.59	1.90%	3,350.40	1.86%	-
华泰证券	1	3,328,476.71	1.72%	3,099.76	1.72%	-
中银国际	1	3,198,781.26	1.65%	2,978.88	1.65%	-
长江证券	1	2,142,850.11	1.11%	1,995.83	1.11%	-
国泰君安	2	1,044,988.61	0.54%	952.37	0.53%	-
方正证券	2	826,048.00	0.43%	769.58	0.43%	-
银河证券	1	288,240.42	0.15%	268.45	0.15%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	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：资力雄厚，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要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元无变化。

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

中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间场内申购赎回业务安排的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 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参加国都证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
6	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
7	关于调整华宝中证 1000 分级基金网上直销申购定投费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 3 月 25 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增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 4 月 12 日
9	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诺亚正行（上海）基金投资顾问有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 4 月 25 日
10	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2016 年 5 月 3 日

	资产管理有限公司开通转换、定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	报》以及基金管理人网站	
11	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珠海盈米财富管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 5 月 31 日
12	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 6 月 24 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；

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同；

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书；

华宝兴业中证 1000 指数分级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
2016 年 8 月 26 日