

# 华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 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 2017 年 3 月 24 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 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83
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.....	83
8.7 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.....	83

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 .....	83
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 .....	83
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.12 投资组合报告附注 .....	84
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>86</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
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 .....	87
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>87</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
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 .....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
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 .....	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	89
11.8 其他重大事件 .....	92
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>94</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>94</b>
13.1 备查文件目录 .....	94
13.2 存放地点 .....	94
13.3 查阅方式 .....	94

## § 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	129,700,950.59 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	12,008,007.00 份	12,008,007.00 份	105,684,936.59 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 $\times$ 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
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、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	2016 年	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	-26,938,665.53	-124,557,018.36
本期利润	-29,529,606.35	-133,451,005.28
加权平均基金份额本期利润	-0.1912	-0.7229
本期加权平均净值利润率	-23.23%	-76.83%
本期基金份额净值增长率	-19.19%	-38.97%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-115,486,611.86	-129,672,978.28
期末可供分配基金份额利润	-0.8904	-0.7454
期末基金资产净值	104,976,629.34	180,189,971.89
期末基金份额净值	0.8094	1.0358
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-50.68%	-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	0.18%	0.93%	-1.85%	0.94%	2.03%	-0.01%

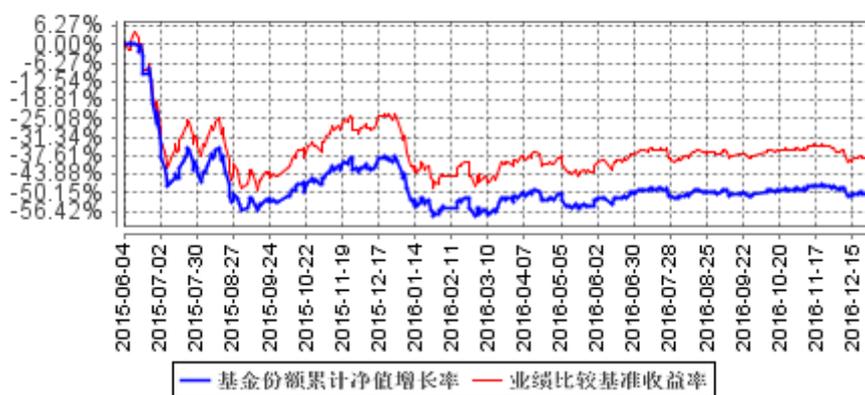
过去六个月	-1.05%	0.97%	-2.68%	0.99%	1.63%	-0.02%
过去一年	-19.19%	1.94%	-18.88%	1.97%	-0.31%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	-50.68%	2.49%	-38.86%	2.52%	-11.82%	-0.03%

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 12 月 31 日）

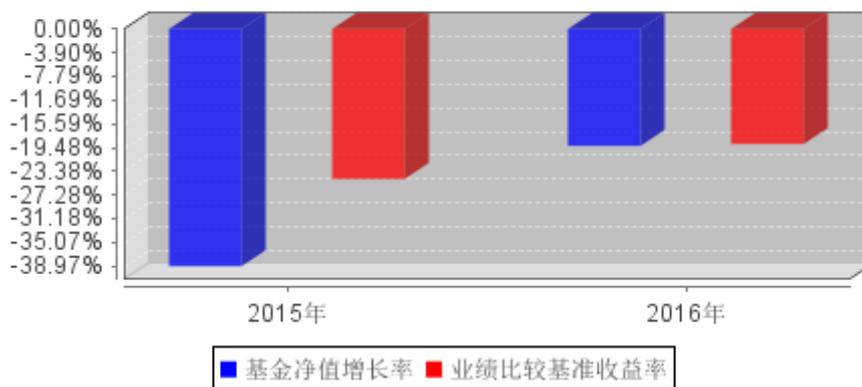
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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

本基金成立于 2015 年 6 月 4 日，成立至今尚未实施利润分配。

## § 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 12 月 31 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、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、华宝兴业转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来产业主导基金和新起点基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 119,691,851,523.98 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、华宝兴业中证军工 ETF 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。2016 年 8 月起兼任华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

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。

#### 4.3.3 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，各项经济数据显示中国经济正逐渐企稳，经济处于转型过程，产业结构不断优化，但整体基础尚不牢固，转型去化的步伐仍在继续。对于 A 股市场，2016 年是改革与发展的一年。1 月，在“熔断机制”的影响下，市场出现了一轮较大幅度的系统性下跌；随后经历一番技术性反弹、震荡筑底后，3 月至 4 月在 TMT、军工和非银金融板块的带领下，指数走出一波上涨行情；5 月-8 月，在权重股护盘作用下，市场波动幅度逐渐变小；9 月至 11 月，随着政府基建投资价码及通胀预期等因素影响，地产、建筑和食品等板块带动指数震荡向上；年底，在美国新政府上台对全球经济带来较大的不确定性的影响下，市场出现回调。本报告期内，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数跌幅较小，分别下跌了 7.5% 和 11.28%；而作为成长股代表的小板指和创业板指调整较大，分别下跌了 22.89% 和 27.71%。本报告期内，中证 1000 指数下跌了 20.01%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，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，本报告期内基金份额净值增长率为-19.19%，同期业绩比较基准收益率为-18.88%，基金表现落后比较基准 0.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年中国仍将继续推进经济改革，财政政策将保持积极态势，货币政策将维持中性稳健，市场流动性将维持宽裕，随着供给侧改革效应的逐步显现，传统周期性行业将获得进一步支撑，宏观经济有望维持平稳增长。再看全球经济，美国经济增长前景平稳向好，欧央行在政治与经济双重风险下预计将继续维持宽松政策，日本经济增长动力相对不足。在此环境下，我们对中国 A 股市场中长期走势持有乐观态度，同时经过过去数次的系统性下跌后，目前市场的风险获得较为充分的释放，在经历了持续半年以上的震荡整固行情后，市场参与者更趋于理性，中长期的投资机会日益凸显。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，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。2016 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、根据监管要求开展了涉及投资、销售等方面的专项自查；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其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

#### 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

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20014 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金（以下简称“华宝兴业中证 1000 指数基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是华宝兴业中证 1000 指数基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述华宝兴业中证 1000 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了华宝兴业中证 1000 指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	曹阳

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

## § 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,424,942.83	13,943,193.59
结算备付金		2,637.42	266,900.57
存出保证金		16,128.15	164,756.91
交易性金融资产	7.4.7.2	99,470,723.98	170,287,578.29
其中：股票投资		99,470,723.98	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		30,915.98	-
应收利息	7.4.7.5	1,415.86	3,414.32
应收股利		-	-
应收申购款		6,987.15	51,297.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		105,953,751.37	184,717,140.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		279,606.56	3,757,175.38
应付赎回款		38,276.78	77,404.07
应付管理人报酬		91,342.86	149,128.30
应付托管费		20,095.45	32,808.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	207,679.76	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	7.4.7.8	340,120.62	240,291.69
负债合计		977,122.03	4,527,168.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	212,869,103.61	295,270,982.70
未分配利润	7.4.7.10	-107,892,474.27	-115,081,010.81
所有者权益合计		104,976,629.34	180,189,971.89
负债和所有者权益总计		105,953,751.37	184,717,140.81

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.8094 元，基金份额总额 105,684,936.59 份；华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0024 元，基金份额总额 12,008,007.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额净值 0.6164 元，基金份额总额 12,008,007.00 份。

## 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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>		-27,136,842.48	-130,969,927.95
1.利息收入		71,856.41	186,879.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	71,856.41	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）		-24,775,450.23	-122,460,859.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-25,231,388.41	-122,638,685.64
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	455,938.18	177,826.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,590,940.82	-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）	7.4.7.18	157,692.16	198,039.24
<b>减：二、费用</b>		2,392,763.87	2,481,077.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,276,838.22	982,595.93
2. 托管费	7.4.10.2.2	280,904.46	216,171.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	422,858.70	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	7.4.7.20	412,162.49	362,478.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-29,529,606.35	-133,451,005.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-29,529,606.35	-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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	-29,529,606.35	-29,529,606.35
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	-82,401,879.09	36,718,142.89	-45,683,736.20

列)			
其中：1. 基金申购款	183,824,300.98	-98,616,839.62	85,207,461.36
2. 基金赎回款	-266,226,180.07	135,334,982.51	-130,891,197.56
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）	212,869,103.61	-107,892,474.27	104,976,629.34
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 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：

<u>黄小慧</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

## 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”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后，华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B

份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+4.0%,华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算,计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后,根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日),本基金将进行基金的定期份额折算: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,基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配;持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份额的分配。经过上述份额折算后,华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外,当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时,或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时,本基金将进行不定期份额折算(基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日):份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1,份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时,基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时,华宝中证 1000 基础份额、华宝中

证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

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,本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通;对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

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、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。本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 2017 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 2016 年度的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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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。比较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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券

投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	6,424,942.83	13,943,193.59
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	6,424,942.83	13,943,193.59

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	110,955,651.72	99,470,723.98	-11,484,927.74
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	110,955,651.72	99,470,723.98	-11,484,927.74
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	179,181,565.21	170,287,578.29	-8,893,986.92
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	179,181,565.21	170,287,578.29	-8,893,986.92

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,406.01	3,200.57
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	1.32	132.11
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.50	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	8.03	81.62
合计	1,415.86	3,414.32

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	207,679.76	270,361.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	207,679.76	270,361.23

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	120.62	291.69
预提费用	290,000.00	190,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	340,120.62	240,291.69

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	108,156,327.56	183,569,995.14
本期赎回（以“-”号填列）	-156,243,037.56	-265,186,707.06
- 基金拆分/份额折算前	125,880,765.30	213,654,270.78
基金拆分/份额折算变动份额	4,298,598.17	-
本期申购	154,945.55	254,305.84
本期赎回（以“-”号填列）	-633,358.43	-1,039,473.01
本期末	129,700,950.59	212,869,103.61

注：

1. 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。

2. 根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝兴业基金管理有限公司于 2016 年 12 月 19 日发布的《关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金以 2016 年 12 月 15 日为定期折算基准日，进行定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 100,627,303.30 份和 1,150,180.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.034148179，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 104,063,542.47 份和 2,012,539.00 份（含华宝中证 1000A 份额经折算后产生的新增华宝中证 1000 基础份额场内份额），份额净值为 0.805 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 12,051,641.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.068296358，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 12,051,641.00 份，份额净值为 1.0000 元。

3. 截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 25,796,159.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 1,780,145.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 12,008,007.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 103,904,791.59 份，均为华宝中证 1000 基础份额（2015 年 12 月 31 日：本基金于深交所上市的基金份额为 56,418,243.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 40,887,841.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 7,765,201.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 117,549,232.30 份，均为华宝中证 1000 基础份额）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 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	-26,938,665.53	-2,590,940.82	-29,529,606.35
本期基金份额交易产生的变动数	41,125,031.95	-4,406,889.06	36,718,142.89
其中：基金申购款	-91,700,067.37	-6,916,772.25	-98,616,839.62
基金赎回款	132,825,099.32	2,509,883.19	135,334,982.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-115,486,611.86	7,594,137.59	-107,892,474.27

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	69,490.55	179,212.25
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	1,759.73	6,552.96
其他	606.13	1,114.00
合计	71,856.41	186,879.21

#### 7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	154,098,885.96	201,881,098.32
减：卖出股票成本总额	179,330,274.37	324,519,783.96
买卖股票差价收入	-25,231,388.41	-122,638,685.64

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	455,938.18	177,826.16
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	455,938.18	177,826.16

### 7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,590,940.82	-8,893,986.92
——股票投资	-2,590,940.82	-8,893,986.92
——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	-2,590,940.82	-8,893,986.92

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	157,692.16	196,768.47
其他	-	1,270.77
合计	157,692.16	198,039.24

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。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

	月 31 日	日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	422,858.70	919,831.82
银行间市场交易费用	-	-
合计	422,858.70	919,831.82

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	110,000.00	150,000.00
基金上市费	60,000.00	65,000.00
其他	400.00	-
指数使用费	200,000.00	104,532.78
银行汇划费用	1,762.49	2,945.72
合计	412,162.49	362,478.50

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### 7.4.9 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
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

注：

- 1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
- 2、宝武集团由原宝钢集团有限公司和武汉钢铁(集团)公司联合重组而成，于 2016 年 12 月 1 日正式成立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华宝证券	28,980,461.53	10.99%	-	-

##### 7.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

### 7.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	26,991.30	11.00%	26,991.30	13.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	-	-	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 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	1,276,838.22
其中：支付销售机构的客户维护费	437,808.94	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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	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	280,904.46	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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,424,942.83	69,490.55	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，按银行同业利率计息。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	13,620	54,480.00	54,480.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	1,431	30,480.30	30,480.30	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	935	13,192.85	13,192.85	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	992	10,356.48	10,356.48	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 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
000516	国际医学	2016年12月5日	重大资产重组	7.90	-	-	30,600	252,011.88	241,740.00	-
000048	康达尔	2016年12月1日	重大资产重组	37.92	2017年3月1日	37.18	6,100	221,147.69	231,312.00	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大资产重组	43.67	2017年1月12日	38.98	4,600	195,031.95	200,882.00	-
300367	东方网力	2016年12月15日	重大资产重组	20.04	-	-	9,150	253,787.05	183,366.00	-
002509	天广中茂	2016年9月21日	重大事项	12.68	-	-	14,440	125,792.30	183,099.20	-
600711	盛屯矿业	2016年12月19日	重大事项未公告	7.02	2017年1月11日	7.38	25,500	190,250.11	179,010.00	-
000520	长航凤凰	2016年12月29日	重大事项	7.90	2017年1月12日	8.69	21,600	197,583.55	170,640.00	-
600577	精达股份	2016年5月3日	重大资产重组	4.18	2017年3月2日	4.60	40,300	267,028.23	168,454.00	-
300271	华宇软	2016年	重大资产	17.45	-	-	9,580	219,666.43	167,171.00	-

	件	12月19日	重组								
300065	海兰信	2016年12月8日	重大资产重组	38.52	-	-	4,300	151,400.58	165,636.00	-	
600855	航天长峰	2016年11月8日	重大资产重组	28.89	-	-	5,300	188,694.78	153,117.00	-	
002464	金利科技	2016年12月28日	重大事项	78.20		2017年1月5日	78.03	1,900	124,050.11	148,580.00	-
300496	中科创达	2016年10月11日	重大资产重组	52.28		2017年1月6日	47.49	2,827	232,664.50	147,795.56	-
002151	北斗星通	2016年11月16日	重大资产重组	31.90		2017年1月12日	31.00	4,600	156,917.84	146,740.00	-
600626	申达股份	2016年12月15日	重大资产重组	13.69		2017年1月12日	13.70	10,600	167,664.09	145,114.00	-
603111	康尼机电	2016年12月26日	重大事项未公告	14.70	-	-	-	9,400	136,488.00	138,180.00	-
300212	易华录	2016年11月30日	重大资产重组	34.00	-	-	-	4,100	187,592.42	139,400.00	-
600763	通策医疗	2016年12月19日	重大事项未公告	33.54		2017年1月3日	34.80	4,100	117,240.93	137,514.00	-
600807	天业股份	2016年11月21日	重大资产重组	13.73	-	-	-	9,900	114,875.32	135,927.00	-
300047	天源迪科	2016年8月15日	重大资产重组	19.90		2017年1月6日	19.00	6,800	149,381.01	135,320.00	-
000533	万家乐	2016年12月29日	重大事项	12.82		2017年1月12日	11.54	10,300	102,042.55	132,046.00	-

					日						
000676	智度股份	2016 年 11 月 17 日	重大资产重组	19.73	2017 年 1 月 24 日	18.25	6,600	137,665.11	130,218.00	-	
000042	中洲控股	2016 年 10 月 27 日	重大资产重组	20.24	-	-	6,100	117,384.16	123,464.00	-	
300149	量子高科	2016 年 12 月 15 日	重大资产重组	19.42	-	-	6,300	118,635.93	122,346.00	-	
600400	红豆股份	2016 年 12 月 29 日	重大事项未公告	8.56	-	-	14,000	121,464.70	119,840.00	-	
600331	宏达股份	2016 年 10 月 21 日	重大资产重组	6.36	2017 年 1 月 23 日	5.85	18,700	153,448.81	118,932.00	-	
000584	友利控股	2016 年 10 月 10 日	重大资产重组	11.85	-	-	9,900	115,794.27	117,315.00	-	
000682	东方电子	2016 年 10 月 10 日	重大资产重组	5.20	-	-	22,500	136,149.74	117,000.00	-	
002156	通富微电	2016 年 12 月 28 日	重大事项	11.38	2017 年 1 月 5 日	11.65	10,270	135,606.74	116,872.60	-	
300223	北京君正	2016 年 12 月 19 日	重大事项	48.40	-	-	2,400	65,661.02	116,160.00	-	
002239	奥特佳	2016 年 10 月 18 日	重大资产重组	15.69	2017 年 2 月 7 日	14.12	7,400	103,078.57	116,106.00	-	
300098	高新兴	2016 年 11 月 17 日	重大资产重组	15.84	2017 年 1 月 23 日	14.26	7,320	107,615.35	115,948.80	-	
600552	凯盛科技	2016 年 9 月 8 日	重大资产重组	18.43	2017 年 2 月 13 日	17.51	6,200	136,296.26	114,266.00	-	
300005	探路者	2016 年	重大资产	16.69	2017	15.02	6,600	154,503.57	110,154.00	-	

		11 月 29 日	重组		年 2 月 6 日						
300323	华灿光电	2016 年 4 月 18 日	重大资产重组	8.99	2017 年 1 月 9 日	8.65	12,200	93,426.85	109,678.00	-	
002664	信质电机	2016 年 12 月 16 日	重大资产重组	25.39	-	-	4,300	150,172.84	109,177.00	-	
002260	德奥通航	2016 年 12 月 5 日	重大资产重组	23.10	-	-	4,700	165,417.58	108,570.00	-	
601700	风范股份	2016 年 11 月 25 日	重大资产重组	8.47	-	-	12,600	127,010.66	106,722.00	-	
002297	博云新材	2016 年 6 月 20 日	重大资产重组	13.09	2017 年 1 月 4 日	13.40	8,100	108,168.21	106,029.00	-	
600173	卧龙地产	2016 年 12 月 22 日	重大事项未公告	11.48	-	-	9,200	80,886.77	105,616.00	-	
002071	长城影视	2016 年 6 月 16 日	重大资产重组	13.64	2017 年 1 月 3 日	15.00	7,700	138,357.27	105,028.00	-	
000821	京山轻机	2016 年 12 月 5 日	重大资产重组	16.24	-	-	6,400	95,757.77	103,936.00	-	
600303	曙光股份	2016 年 12 月 15 日	重大事项未公告	9.02	2017 年 1 月 17 日	9.92	11,500	129,280.88	103,730.00	-	
002526	山东矿机	2016 年 8 月 2 日	重大资产重组	10.12	-	-	10,100	118,909.01	102,212.00	-	
600735	新华锦	2016 年 12 月 19 日	重大事项未公告	20.74	-	-	4,800	94,718.10	99,552.00	-	
600480	凌云股份	2016 年 7 月 22 日	重大资产重组	15.01	2017 年 1 月 13 日	16.51	6,500	100,793.28	97,565.00	-	
300450	先导智	2016 年	重大资产	33.99	2017	33.00	2,800	82,595.76	95,172.00	-	

	能	11 月 15 日	重组		年 2 月 8 日					
300100	双林股份	2016 年 11 月 7 日	重大资产重组	34.00	2017 年 1 月 25 日	30.60	2,700	79,901.98	91,800.00	-
000531	穗恒运 A	2016 年 8 月 29 日	重大资产重组	11.47	2017 年 1 月 9 日	11.80	8,000	81,510.39	91,760.00	-
600239	云南城投	2016 年 12 月 30 日	重大事项未公告	5.66	2017 年 1 月 3 日	5.70	16,000	112,555.93	90,560.00	-
000987	越秀金控	2016 年 8 月 29 日	重大资产重组	14.49	2017 年 1 月 9 日	15.94	6,200	91,069.14	89,838.00	-
002226	江南化工	2016 年 11 月 14 日	重大资产重组	8.61	2017 年 3 月 1 日	9.20	10,300	83,896.39	88,683.00	-
300076	GQY 视讯	2016 年 10 月 17 日	重大资产重组	15.26	2017 年 3 月 1 日	13.73	5,800	74,123.78	88,508.00	-
300028	金亚科技	2016 年 12 月 1 日	重大资产重组	14.18	2017 年 2 月 24 日	14.01	6,200	127,918.62	87,916.00	-
002571	德力股份	2016 年 8 月 2 日	重大资产重组	15.33	2017 年 2 月 28 日	15.44	5,600	86,305.10	85,848.00	-
002584	西陇科学	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	15.88	2017 年 3 月 2 日	14.29	5,400	84,392.32	85,752.00	-
600979	广安爱众	2016 年 11 月 14 日	重大资产重组	7.92	-	-	10,800	71,603.65	85,536.00	-
600973	宝胜股份	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	8.05	2017 年 2 月	8.86	10,140	79,076.40	81,627.00	-

		日			月 22 日						
603308	应流股份	2016 年 11 月 24 日	重大资产重组	20.13	2017 年 2 月 14 日	21.92	3,900	101,939.35	78,507.00	-	
002335	科华恒盛	2016 年 12 月 16 日	重大资产重组	42.90	-	-	1,700	64,900.80	72,930.00	-	
600090	同济堂	2016 年 12 月 26 日	重大事项未公告	11.75	2017 年 1 月 10 日	12.93	6,100	76,188.70	71,675.00	-	
600225	天津松江	2016 年 11 月 8 日	重大资产重组	6.64	-	-	10,600	76,521.79	70,384.00	-	
600814	杭州解百	2016 年 12 月 26 日	重大事项未公告	11.37	2017 年 1 月 9 日	10.70	6,100	61,635.72	69,357.00	-	
000029	深深房 A	2016 年 9 月 14 日	重大资产重组	11.17	-	-	6,200	81,266.58	69,254.00	-	
300518	盛讯达	2016 年 12 月 13 日	重大资产重组	113.46	-	-	600	76,314.00	68,076.00	-	
002617	露笑科技	2016 年 12 月 23 日	重大事项	14.63	2017 年 1 月 23 日	15.60	4,630	53,993.58	67,736.90	-	
300213	佳讯飞鸿	2016 年 11 月 4 日	重大资产重组	28.00	2017 年 2 月 17 日	25.48	2,400	77,270.04	67,200.00	-	
300150	世纪瑞尔	2016 年 11 月 8 日	重大资产重组	9.15	2017 年 3 月 21 日	10.97	7,300	106,899.31	66,795.00	-	
600876	洛阳玻璃	2016 年 9 月 8 日	重大资产重组	25.61	2017 年 3 月 10 日	28.17	2,600	69,859.92	66,586.00	-	
002567	唐人神	2016 年 12 月 22 日	重大事项	12.64	2017 年 1 月 3 日	12.75	5,200	71,455.24	65,728.00	-	

					日						
300276	三丰智能	2016年9月12日	重大资产重组	18.15	-	-	3,500	80,065.62	63,525.00	-	
002162	悦心健康	2016年12月22日	重大事项	6.61	-	-	9,000	79,791.24	59,490.00	-	
002579	中京电子	2016年12月5日	重大资产重组	13.68		2017年3月1日	14.29	4,100	58,859.87	56,088.00	-
300473	德尔股份	2016年11月1日	重大资产重组	78.12		2017年2月10日	71.00	700	47,862.17	54,684.00	-
000916	华北高速	2016年6月24日	重大资产重组	5.01	-	-	-	10,700	59,584.37	53,607.00	-
300449	汉邦高科	2016年11月11日	重大资产重组	48.44		2017年2月24日	43.88	1,000	53,861.63	48,440.00	-
002724	海洋王	2016年12月29日	重大事项未公告	25.84	-	-	-	1,700	35,582.58	43,928.00	-

注：本基金截至 2016 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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“风险和收益相匹配”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在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。

#### **7.4.13.2 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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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 7.4.12 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,424,942.83	-	-	-	6,424,942.83
结算备付金	2,637.42	-	-	-	2,637.42
存出保证金	16,128.15	-	-	-	16,128.15
交易性金融资产	-	-	-	99,470,723.98	99,470,723.98
应收证券清算款	-	-	-	30,915.98	30,915.98
应收利息	-	-	-	1,415.86	1,415.86
应收申购款	1,148.81	-	-	5,838.34	6,987.15
资产总计	6,444,857.21	-	-	99,508,894.16	105,953,751.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	279,606.56	279,606.56
应付赎回款	-	-	-	38,276.78	38,276.78

应付管理人报酬	-	-	-	91,342.86	91,342.86
应付托管费	-	-	-	20,095.45	20,095.45
应付指数使用费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	207,679.76	207,679.76
其他负债	-	-	-	290,120.62	290,120.62
负债总计	-	-	-	977,122.03	977,122.03
利率敏感度缺口	6,444,857.21	-	-	98,531,772.13	104,976,629.34
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	99,470,723.98	94.76	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	99,470,723.98	94.76	170,287,578.29	94.50

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)	上年度末(2015 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	5,151,891.32	-

	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-5,151,891.32	-
--	--------------------------	---------------	---

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。

#### 7.4.14 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 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 90,728,184.34 元，属于第二层次的余额为 8,742,539.64 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 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	99,470,723.98	93.88
	其中：股票	99,470,723.98	93.88
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	6,427,580.25	6.07
7	其他各项资产	55,447.14	0.05
8	合计	105,953,751.37	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	1,097,264.00	1.05
B	采矿业	1,500,171.40	1.43
C	制造业	64,164,173.12	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,797,755.00	2.67
E	建筑业	3,070,517.78	2.92
F	批发和零售业	3,955,013.20	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	2,480,375.00	2.36
H	住宿和餐饮业	126,567.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,550,908.15	8.15
J	金融业	100,737.00	0.10
K	房地产业	4,472,146.80	4.26
L	租赁和商务服务业	1,321,060.53	1.26
M	科学研究和技术服务业	763,323.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	770,399.00	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,604.00	0.08
Q	卫生和社会工作	450,451.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	1,548,563.62	1.48
S	综合	1,054,911.12	1.00
	合计	98,303,940.72	93.64

### 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	-	-
C	制造业	829,164.06	0.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,536.00	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	53,607.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,612.20	0.07
J	金融业	54,480.00	0.05
K	房地产业	70,384.00	0.07
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	1,166,783.26	1.11

### 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所有股票投资明细

#### 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	002411	必康股份	9,900	267,795.00	0.26
2	600110	诺德股份	24,700	263,302.00	0.25
3	300142	沃森生物	23,100	251,790.00	0.24
4	600490	鹏欣资源	31,700	247,260.00	0.24
5	600868	梅雁吉祥	40,700	245,421.00	0.23
6	000059	华锦股份	20,600	245,140.00	0.23
7	000516	国际医学	30,600	241,740.00	0.23
8	002343	慈文传媒	5,350	241,659.50	0.23
9	600401	海润光伏	101,300	235,016.00	0.22
10	600856	中天能源	17,000	234,600.00	0.22

11	000048	康达尔	6,100	231,312.00	0.22
12	300090	盛运环保	19,800	229,680.00	0.22
13	603799	华友钴业	6,400	225,088.00	0.21
14	600172	黄河旋风	11,900	212,772.00	0.20
15	300079	数码视讯	29,500	211,220.00	0.20
16	002622	融钰集团	14,400	209,952.00	0.20
17	002383	合众思壮	4,200	207,900.00	0.20
18	300203	聚光科技	6,800	207,740.00	0.20
19	002462	嘉事堂	4,600	200,882.00	0.19
20	002501	利源精制	16,300	200,001.00	0.19
21	601058	赛轮金宇	49,140	199,999.80	0.19
22	300208	恒顺众昇	11,450	196,940.00	0.19
23	300077	国民技术	12,100	196,625.00	0.19
24	600226	升华拜克	18,800	196,460.00	0.19
25	000518	四环生物	22,100	196,248.00	0.19
26	000932	华菱钢铁	32,300	195,738.00	0.19
27	002138	顺络电子	11,300	195,603.00	0.19
28	002108	沧州明珠	9,600	195,552.00	0.19
29	002583	海能达	14,780	195,243.80	0.19
30	300068	南都电源	10,100	194,627.00	0.19
31	600502	安徽水利	19,380	193,412.40	0.18
32	300207	欣旺达	13,900	193,210.00	0.18
33	300431	暴风集团	4,200	193,200.00	0.18
34	300383	光环新网	7,700	192,192.00	0.18
35	600620	天宸股份	11,750	190,232.50	0.18
36	600568	中珠医疗	7,600	190,000.00	0.18
37	000836	鑫茂科技	25,900	185,444.00	0.18
38	300367	东方网力	9,150	183,366.00	0.17
39	300216	千山药机	5,400	183,222.00	0.17
40	002509	天广中茂	14,440	183,099.20	0.17
41	600885	宏发股份	5,700	182,115.00	0.17
42	002023	海特高新	13,000	179,920.00	0.17
43	600711	盛屯矿业	25,500	179,010.00	0.17
44	002668	奥马电器	2,500	177,375.00	0.17
45	300376	易事特	3,700	177,304.00	0.17
46	002047	宝鹰股份	18,900	176,715.00	0.17
47	600567	山鹰纸业	48,800	176,656.00	0.17
48	600391	成发科技	5,000	176,250.00	0.17
49	300285	国瓷材料	4,500	175,995.00	0.17

50	002389	南洋科技	7,600	175,408.00	0.17
51	000882	华联股份	38,200	174,574.00	0.17
52	600777	新潮能源	43,400	174,034.00	0.17
53	600343	航天动力	8,200	172,364.00	0.16
54	600084	中葡股份	14,400	171,504.00	0.16
55	002522	浙江众成	9,500	170,905.00	0.16
56	000520	长航凤凰	21,600	170,640.00	0.16
57	300352	北信源	8,690	168,672.90	0.16
58	002606	大连电瓷	3,500	168,630.00	0.16
59	600577	精达股份	40,300	168,454.00	0.16
60	002326	永太科技	10,300	167,993.00	0.16
61	002102	冠福股份	32,800	167,608.00	0.16
62	300271	华宇软件	9,580	167,171.00	0.16
63	300065	海兰信	4,300	165,636.00	0.16
64	002185	华天科技	13,700	165,496.00	0.16
65	002601	佰利联	13,050	165,213.00	0.16
66	300347	泰格医药	6,100	164,761.00	0.16
67	002117	东港股份	5,500	164,725.00	0.16
68	300197	铁汉生态	12,980	164,586.40	0.16
69	300458	全志科技	1,800	164,574.00	0.16
70	000875	吉电股份	25,000	164,250.00	0.16
71	002421	达实智能	24,800	163,184.00	0.16
72	300078	思创医惠	6,280	162,714.80	0.16
73	600255	鑫科材料	33,600	162,624.00	0.15
74	000901	航天科技	4,900	161,014.00	0.15
75	600590	泰豪科技	8,600	160,992.00	0.15
76	600652	游久游戏	12,500	160,625.00	0.15
77	600130	波导股份	16,500	159,720.00	0.15
78	000902	新洋丰	14,100	158,766.00	0.15
79	002610	爱康科技	48,100	157,287.00	0.15
80	002630	华西能源	12,700	156,591.00	0.15
81	600562	国睿科技	5,140	156,358.80	0.15
82	002067	景兴纸业	23,400	156,312.00	0.15
83	000034	神州数码	7,000	156,240.00	0.15
84	300188	美亚柏科	7,300	156,147.00	0.15
85	600491	龙元建设	13,500	155,790.00	0.15
86	300020	银江股份	9,800	154,644.00	0.15
87	002429	兆驰股份	15,500	154,380.00	0.15
88	002359	齐星铁塔	5,400	154,278.00	0.15

89	300101	振芯科技	8,300	153,882.00	0.15
90	000410	沈阳机床	11,500	153,640.00	0.15
91	300238	冠昊生物	4,600	153,410.00	0.15
92	600855	航天长峰	5,300	153,117.00	0.15
93	600990	四创电子	2,100	152,670.00	0.15
94	300269	联建光电	6,600	152,592.00	0.15
95	600634	中技控股	8,600	152,564.00	0.15
96	300317	珈伟股份	4,100	152,356.00	0.15
97	300170	汉得信息	12,900	152,349.00	0.15
98	600486	扬农化工	4,000	151,480.00	0.14
99	300185	通裕重工	49,000	151,410.00	0.14
100	002070	众和股份	10,900	151,292.00	0.14
101	600771	广誉远	4,500	150,480.00	0.14
102	002716	金贵银业	6,500	150,410.00	0.14
103	300009	安科生物	7,030	149,879.60	0.14
104	600662	强生控股	13,500	149,715.00	0.14
105	002638	勤上光电	16,250	149,500.00	0.14
106	000807	云铝股份	22,300	149,410.00	0.14
107	000687	华讯方舟	9,700	148,992.00	0.14
108	600209	罗顿发展	11,600	148,828.00	0.14
109	600638	新黄浦	8,400	148,596.00	0.14
110	002464	金利科技	1,900	148,580.00	0.14
111	600330	天通股份	14,200	148,390.00	0.14
112	000150	宜华健康	4,800	148,176.00	0.14
113	300496	中科创达	2,827	147,795.56	0.14
114	002099	海翔药业	17,400	147,552.00	0.14
115	002224	三力士	9,800	147,392.00	0.14
116	002094	青岛金王	4,900	147,000.00	0.14
117	002481	双塔食品	16,200	146,934.00	0.14
118	002151	北斗星通	4,600	146,740.00	0.14
119	002145	中核钛白	23,900	146,507.00	0.14
120	002089	新海宜	10,300	146,157.00	0.14
121	002625	龙生股份	3,900	146,094.00	0.14
122	300148	天舟文化	7,000	146,020.00	0.14
123	000766	通化金马	8,300	145,748.00	0.14
124	300012	华测检测	12,600	145,530.00	0.14
125	600626	申达股份	10,600	145,114.00	0.14
126	002104	恒宝股份	12,276	144,734.04	0.14
127	002570	贝因美	11,000	144,320.00	0.14

128	000036	华联控股	17,100	143,811.00	0.14
129	002167	东方锆业	10,600	143,630.00	0.14
130	000666	经纬纺机	6,700	143,179.00	0.14
131	300118	东方日升	8,700	142,941.00	0.14
132	000573	粤宏远 A	13,300	142,709.00	0.14
133	601588	北辰实业	34,200	142,614.00	0.14
134	600323	瀚蓝环境	9,900	142,164.00	0.14
135	600988	赤峰黄金	9,200	141,864.00	0.14
136	300377	赢时胜	3,800	141,854.00	0.14
137	002643	万润股份	3,900	141,570.00	0.13
138	002447	壹桥股份	14,300	141,284.00	0.13
139	600728	佳都科技	16,680	141,279.60	0.13
140	000957	中通客车	8,900	141,243.00	0.13
141	300011	鼎汉技术	6,800	140,896.00	0.13
142	600116	三峡水利	14,900	140,805.00	0.13
143	600210	紫江企业	26,000	140,660.00	0.13
144	000801	四川九洲	13,200	140,316.00	0.13
145	002262	恩华药业	6,710	140,239.00	0.13
146	600667	太极实业	18,100	139,551.00	0.13
147	300212	易华录	4,100	139,400.00	0.13
148	002434	万里扬	8,700	139,200.00	0.13
149	000601	韶能股份	16,200	139,158.00	0.13
150	002618	丹邦科技	5,500	138,875.00	0.13
151	002550	千红制药	19,200	138,624.00	0.13
152	603111	康尼机电	9,400	138,180.00	0.13
153	300310	宜通世纪	5,660	137,764.40	0.13
154	000751	锌业股份	24,200	137,698.00	0.13
155	300054	鼎龙股份	6,300	137,655.00	0.13
156	002055	得润电子	5,800	137,518.00	0.13
157	600763	通策医疗	4,100	137,514.00	0.13
158	002341	新纶科技	6,500	137,085.00	0.13
159	600072	钢构工程	7,900	136,986.00	0.13
160	600807	天业股份	9,900	135,927.00	0.13
161	002303	美盈森	13,200	135,696.00	0.13
162	300047	天源迪科	6,800	135,320.00	0.13
163	600261	阳光照明	18,700	135,014.00	0.13
164	603588	高能环境	4,300	134,590.00	0.13
165	600273	嘉化能源	14,000	134,540.00	0.13
166	300014	亿纬锂能	4,600	134,320.00	0.13

167	600677	航天通信	7,800	134,004.00	0.13
168	600399	抚顺特钢	19,500	133,965.00	0.13
169	600321	国栋建设	19,400	133,860.00	0.13
170	002284	亚太股份	9,500	133,665.00	0.13
171	300359	全通教育	6,750	133,582.50	0.13
172	600149	廊坊发展	5,691	133,283.22	0.13
173	000683	远兴能源	41,840	133,051.20	0.13
174	002130	沃尔核材	9,400	132,728.00	0.13
175	600745	中茵股份	6,200	132,680.00	0.13
176	600653	申华控股	33,400	132,598.00	0.13
177	600559	老白干酒	5,672	132,441.20	0.13
178	300053	欧比特	9,345	132,418.65	0.13
179	600621	华鑫股份	9,000	132,120.00	0.13
180	002247	帝龙文化	7,300	132,057.00	0.13
181	000533	万家乐	10,300	132,046.00	0.13
182	600848	上海临港	6,800	131,580.00	0.13
183	000928	中钢国际	7,500	131,475.00	0.13
184	600495	晋西车轴	18,080	131,260.80	0.13
185	000650	仁和药业	18,600	131,130.00	0.12
186	002436	兴森科技	19,100	130,835.00	0.12
187	002215	诺普信	11,800	130,744.00	0.12
188	000506	中润资源	11,900	130,662.00	0.12
189	000915	山大华特	3,100	130,603.00	0.12
190	002445	中南文化	8,700	130,587.00	0.12
191	002283	天润曲轴	16,800	130,536.00	0.12
192	000676	智度股份	6,600	130,218.00	0.12
193	600285	羚锐制药	10,200	130,152.00	0.12
194	002468	艾迪西	4,300	129,946.00	0.12
195	000910	大亚圣象	6,800	129,880.00	0.12
196	002256	兆新股份	20,200	129,684.00	0.12
197	300294	博雅生物	2,300	129,605.00	0.12
198	300355	蒙草生态	12,900	129,387.00	0.12
199	002600	江粉磁材	12,600	129,024.00	0.12
200	300228	富瑞特装	10,080	128,923.20	0.12
201	002095	生意宝	3,200	128,128.00	0.12
202	002402	和而泰	12,450	127,488.00	0.12
203	600963	岳阳林纸	15,600	127,452.00	0.12
204	300316	晶盛机电	10,600	126,988.00	0.12
205	600622	嘉宝集团	8,800	126,808.00	0.12

206	600602	云赛智联	13,300	126,749.00	0.12
207	000731	四川美丰	12,700	126,746.00	0.12
208	600571	信雅达	6,600	126,588.00	0.12
209	300111	向日葵	24,000	126,480.00	0.12
210	002467	二六三	12,000	126,240.00	0.12
211	002329	皇氏集团	8,940	126,232.80	0.12
212	002474	榕基软件	9,300	126,108.00	0.12
213	600105	永鼎股份	12,200	126,026.00	0.12
214	002318	久立特材	12,600	126,000.00	0.12
215	600838	上海九百	6,900	125,925.00	0.12
216	600595	中孚实业	22,400	125,888.00	0.12
217	600269	赣粤高速	25,000	125,750.00	0.12
218	002298	中电鑫龙	9,100	125,671.00	0.12
219	000603	盛达矿业	7,700	125,664.00	0.12
220	601011	宝泰隆	17,600	125,488.00	0.12
221	600363	联创光电	7,600	125,400.00	0.12
222	600206	有研新材	12,600	125,244.00	0.12
223	600730	中国高科	10,100	125,139.00	0.12
224	000733	振华科技	7,000	124,950.00	0.12
225	002418	康盛股份	12,200	124,806.00	0.12
226	002364	中恒电气	6,000	124,800.00	0.12
227	002170	芭田股份	13,400	124,486.00	0.12
228	600439	瑞贝卡	14,200	124,108.00	0.12
229	600668	尖峰集团	7,400	123,876.00	0.12
230	000735	罗牛山	17,300	123,868.00	0.12
231	002339	积成电子	6,500	123,760.00	0.12
232	600012	皖通高速	7,500	123,675.00	0.12
233	002313	日海通讯	5,300	123,490.00	0.12
234	000042	中洲控股	6,100	123,464.00	0.12
235	002547	春兴精工	13,000	122,850.00	0.12
236	300284	苏交科	5,900	122,720.00	0.12
237	002043	兔宝宝	10,600	122,642.00	0.12
238	600420	现代制药	3,700	122,544.00	0.12
239	002443	金洲管道	11,200	122,528.00	0.12
240	300309	吉艾科技	5,200	122,512.00	0.12
241	002141	蓉胜超微	12,200	122,488.00	0.12
242	300149	量子高科	6,300	122,346.00	0.12
243	600527	江南高纤	17,200	121,776.00	0.12
244	000989	九芝堂	5,605	121,684.55	0.12

245	000407	胜利股份	13,200	121,572.00	0.12
246	300183	东软载波	4,900	121,128.00	0.12
247	603678	火炬电子	1,600	121,040.00	0.12
248	300128	锦富新材	7,200	120,600.00	0.11
249	601222	林洋能源	14,908	120,307.56	0.11
250	600322	天房发展	19,000	120,270.00	0.11
251	002126	银轮股份	12,400	120,156.00	0.11
252	000802	北京文化	6,200	119,908.00	0.11
253	600400	红豆股份	14,000	119,840.00	0.11
254	300292	吴通控股	13,700	119,601.00	0.11
255	002263	大东南	28,200	119,286.00	0.11
256	603026	石大胜华	3,000	119,220.00	0.11
257	600331	宏达股份	18,700	118,932.00	0.11
258	300364	中文在线	3,006	118,797.12	0.11
259	002036	联创电子	6,200	118,792.00	0.11
260	000996	中国中期	4,900	118,580.00	0.11
261	600238	海南椰岛	9,600	118,464.00	0.11
262	600123	兰花科创	14,700	118,188.00	0.11
263	002709	天赐材料	2,800	118,076.00	0.11
264	603118	共进股份	3,000	118,050.00	0.11
265	000065	北方国际	4,350	117,885.00	0.11
266	300463	迈克生物	4,800	117,840.00	0.11
267	000673	当代东方	8,500	117,810.00	0.11
268	002376	新北洋	9,500	117,800.00	0.11
269	000851	高鸿股份	10,100	117,766.00	0.11
270	600742	一汽富维	7,300	117,749.00	0.11
271	002229	鸿博股份	5,000	117,700.00	0.11
272	000584	友利控股	9,900	117,315.00	0.11
273	600107	美尔雅	6,200	117,304.00	0.11
274	600186	莲花健康	22,800	117,192.00	0.11
275	000035	中国天楹	15,900	117,024.00	0.11
276	000682	东方电子	22,500	117,000.00	0.11
277	002156	通富微电	10,270	116,872.60	0.11
278	002649	博彦科技	3,000	116,700.00	0.11
279	300036	超图软件	6,700	116,580.00	0.11
280	000918	嘉凯城	15,500	116,405.00	0.11
281	601388	怡球资源	30,380	116,355.40	0.11
282	300073	当升科技	2,700	116,289.00	0.11
283	300178	腾邦国际	7,200	116,208.00	0.11

284	300223	北京君正	2,400	116,160.00	0.11
285	002239	奥特佳	7,400	116,106.00	0.11
286	300098	高新兴	7,320	115,948.80	0.11
287	600318	新力金融	3,600	115,920.00	0.11
288	002611	东方精工	6,900	115,851.00	0.11
289	002097	山河智能	12,900	115,455.00	0.11
290	300096	易联众	7,400	115,366.00	0.11
291	002471	中超控股	19,000	115,140.00	0.11
292	002721	金一文化	6,900	115,092.00	0.11
293	300237	美晨科技	6,900	115,092.00	0.11
294	600057	象屿股份	10,000	115,000.00	0.11
295	002188	巴士在线	3,900	114,465.00	0.11
296	600824	益民集团	15,800	114,392.00	0.11
297	600063	皖维高新	24,700	114,361.00	0.11
298	600794	保税科技	18,200	114,296.00	0.11
299	600552	凯盛科技	6,200	114,266.00	0.11
300	002684	猛狮科技	3,500	114,030.00	0.11
301	300336	新文化	5,800	113,970.00	0.11
302	002288	超华科技	14,000	113,820.00	0.11
303	600477	杭萧钢构	11,310	113,665.50	0.11
304	600767	运盛医疗	7,300	113,515.00	0.11
305	600707	彩虹股份	12,600	113,274.00	0.11
306	002497	雅化集团	16,500	113,190.00	0.11
307	600756	浪潮软件	4,900	113,092.00	0.11
308	300252	金信诺	3,800	112,898.00	0.11
309	002121	科陆电子	12,800	112,896.00	0.11
310	600986	科达股份	7,400	112,776.00	0.11
311	002554	惠博普	13,800	112,746.00	0.11
312	300322	硕贝德	6,100	112,728.00	0.11
313	600288	大恒科技	7,500	112,575.00	0.11
314	002031	巨轮智能	33,000	112,530.00	0.11
315	600360	华微电子	12,700	112,522.00	0.11
316	300083	劲胜精密	15,300	112,455.00	0.11
317	002367	康力电梯	8,500	112,285.00	0.11
318	000828	东莞控股	8,900	111,962.00	0.11
319	300318	博晖创新	12,352	111,909.12	0.11
320	002448	中原内配	10,100	111,504.00	0.11
321	002245	澳洋顺昌	12,500	111,500.00	0.11
322	300482	万孚生物	1,500	111,360.00	0.11

323	002564	天沃科技	11,100	111,000.00	0.11
324	000739	普洛药业	14,700	110,691.00	0.11
325	600877	中国嘉陵	11,800	110,448.00	0.11
326	300131	英唐智控	11,500	110,400.00	0.11
327	300005	探路者	6,600	110,154.00	0.10
328	002476	宝莫股份	10,500	109,830.00	0.10
329	600106	重庆路桥	15,600	109,356.00	0.10
330	600382	广东明珠	6,000	109,200.00	0.10
331	002664	信质电机	4,300	109,177.00	0.10
332	300332	天壕环境	11,600	109,040.00	0.10
333	002154	报喜鸟	20,100	108,942.00	0.10
334	002413	雷科防务	9,400	108,852.00	0.10
335	002091	江苏国泰	8,200	108,732.00	0.10
336	300369	绿盟科技	3,200	108,704.00	0.10
337	002538	司尔特	10,800	108,648.00	0.10
338	002260	德奥通航	4,700	108,570.00	0.10
339	600800	天津磁卡	10,500	108,465.00	0.10
340	600290	华仪电气	8,100	108,297.00	0.10
341	601636	旗滨集团	27,900	108,252.00	0.10
342	000016	深康佳 A	24,000	108,240.00	0.10
343	300110	华仁药业	7,000	108,150.00	0.10
344	601890	亚星锚链	12,300	108,117.00	0.10
345	300137	先河环保	7,400	108,040.00	0.10
346	600227	赤天化	14,900	108,025.00	0.10
347	600165	新日恒力	8,850	107,970.00	0.10
348	002488	金固股份	6,500	107,900.00	0.10
349	002446	盛路通信	4,800	107,616.00	0.10
350	300031	宝通科技	5,100	107,508.00	0.10
351	000005	世纪星源	15,900	107,484.00	0.10
352	002511	中顺洁柔	5,400	107,460.00	0.10
353	600713	南京医药	13,500	107,325.00	0.10
354	002433	太安堂	9,900	107,316.00	0.10
355	600096	云天化	11,300	107,237.00	0.10
356	601700	风范股份	12,600	106,722.00	0.10
357	000571	新大洲 A	14,000	106,680.00	0.10
358	002575	群兴玩具	7,600	106,628.00	0.10
359	002331	皖通科技	5,980	106,444.00	0.10
360	000952	广济药业	5,400	106,380.00	0.10
361	000055	方大集团	7,800	106,314.00	0.10

362	600641	万业企业	8,600	106,296.00	0.10
363	002369	卓翼科技	10,400	106,288.00	0.10
364	002147	新光圆成	6,000	105,720.00	0.10
365	000040	东旭蓝天	8,600	105,694.00	0.10
366	002427	尤夫股份	5,100	105,621.00	0.10
367	600173	卧龙地产	9,200	105,616.00	0.10
368	601599	鹿港文化	11,500	105,340.00	0.10
369	002531	天顺风能	15,280	105,126.40	0.10
370	300278	华昌达	4,700	105,045.00	0.10
371	002071	长城影视	7,700	105,028.00	0.10
372	600405	动力源	9,400	104,998.00	0.10
373	300038	梅泰诺	2,400	104,976.00	0.10
374	002596	海南瑞泽	3,500	104,930.00	0.10
375	300034	钢研高纳	5,379	104,836.71	0.10
376	002355	兴民智通	7,700	104,643.00	0.10
377	002387	黑牛食品	6,000	104,460.00	0.10
378	600093	禾嘉股份	7,200	104,400.00	0.10
379	002650	加加食品	14,800	104,192.00	0.10
380	300379	东方通	1,500	104,085.00	0.10
381	000971	高升控股	4,400	104,060.00	0.10
382	002631	德尔未来	5,600	103,992.00	0.10
383	000821	京山轻机	6,400	103,936.00	0.10
384	600303	曙光股份	11,500	103,730.00	0.10
385	000607	华媒控股	8,700	102,834.00	0.10
386	002198	嘉应制药	7,600	102,752.00	0.10
387	600185	格力地产	17,680	102,720.80	0.10
388	300300	汉鼎宇佑	4,900	102,704.00	0.10
389	300221	银禧科技	5,200	102,648.00	0.10
390	002296	辉煌科技	6,500	102,635.00	0.10
391	002322	理工环科	4,300	102,598.00	0.10
392	300368	汇金股份	4,700	102,554.00	0.10
393	000819	岳阳兴长	3,910	102,442.00	0.10
394	002604	龙力生物	9,000	102,330.00	0.10
395	002103	广博股份	5,900	102,247.00	0.10
396	002259	升达林业	10,200	102,204.00	0.10
397	300326	凯利泰	9,173	102,003.76	0.10
398	002042	华孚色纺	8,900	101,994.00	0.10
399	600033	福建高速	29,400	101,724.00	0.10
400	002636	金安国纪	6,200	101,370.00	0.10

401	002585	双星新材	9,200	101,292.00	0.10
402	300302	同有科技	4,540	101,060.40	0.10
403	000863	三湘印象	11,900	101,031.00	0.10
404	002086	东方海洋	8,800	100,848.00	0.10
405	002670	国盛金控	3,000	100,800.00	0.10
406	000416	民生控股	9,100	100,737.00	0.10
407	000925	众合科技	4,100	100,737.00	0.10
408	600531	豫光金铅	11,700	100,386.00	0.10
409	600550	保变电气	16,400	100,204.00	0.10
410	002425	凯撒文化	4,400	100,100.00	0.10
411	600775	南京熊猫	7,200	100,080.00	0.10
412	300224	正海磁材	5,400	100,008.00	0.10
413	300008	天海防务	4,100	99,999.00	0.10
414	002453	天马精化	9,800	99,764.00	0.10
415	002222	福晶科技	7,350	99,592.50	0.09
416	002177	御银股份	13,000	99,580.00	0.09
417	600735	新华锦	4,800	99,552.00	0.09
418	002206	海利得	5,200	99,528.00	0.09
419	600630	龙头股份	6,400	98,816.00	0.09
420	300413	快乐购	4,300	98,814.00	0.09
421	600676	交运股份	11,000	98,670.00	0.09
422	600836	界龙实业	11,400	98,610.00	0.09
423	300037	新宙邦	2,000	98,600.00	0.09
424	600846	同济科技	10,700	98,547.00	0.09
425	600501	航天晨光	5,400	98,496.00	0.09
426	603117	万林股份	5,900	98,471.00	0.09
427	300333	兆日科技	5,800	98,426.00	0.09
428	300157	恒泰艾普	10,700	98,333.00	0.09
429	300426	唐德影视	3,450	98,325.00	0.09
430	002510	天汽模	14,100	97,995.00	0.09
431	600237	铜峰电子	12,100	97,889.00	0.09
432	603718	海利生物	5,485	97,742.70	0.09
433	600480	凌云股份	6,500	97,565.00	0.09
434	000790	泰合健康	7,400	97,458.00	0.09
435	600650	锦江投资	4,200	97,104.00	0.09
436	600789	鲁抗医药	10,000	97,100.00	0.09
437	002323	雅百特	6,400	96,896.00	0.09
438	603368	柳州医药	1,200	96,732.00	0.09
439	300226	上海钢联	2,386	96,442.12	0.09

440	002519	银河电子	4,300	96,320.00	0.09
441	600995	文山电力	7,200	96,264.00	0.09
442	002496	辉丰股份	19,420	96,129.00	0.09
443	600035	楚天高速	15,600	96,096.00	0.09
444	002253	川大智胜	3,850	96,019.00	0.09
445	002037	久联发展	5,600	95,872.00	0.09
446	002502	骅威文化	7,400	95,608.00	0.09
447	002556	辉隆股份	9,200	95,588.00	0.09
448	300295	三六五网	3,300	95,337.00	0.09
449	300450	先导智能	2,800	95,172.00	0.09
450	002559	亚威股份	6,400	95,040.00	0.09
451	600784	鲁银投资	9,700	94,963.00	0.09
452	300339	润和软件	3,100	94,860.00	0.09
453	600616	金枫酒业	7,698	94,685.40	0.09
454	600114	东睦股份	5,500	94,655.00	0.09
455	300406	九强生物	4,300	94,557.00	0.09
456	300231	银信科技	5,100	94,401.00	0.09
457	300222	科大智能	4,720	94,400.00	0.09
458	300348	长亮科技	3,800	94,392.00	0.09
459	000752	西藏发展	5,700	94,392.00	0.09
460	600129	太极集团	5,500	94,325.00	0.09
461	002449	国星光电	7,100	94,288.00	0.09
462	300049	福瑞股份	4,500	94,275.00	0.09
463	300045	华力创通	7,100	94,217.00	0.09
464	000705	浙江震元	7,200	94,104.00	0.09
465	002697	红旗连锁	11,640	94,051.20	0.09
466	300086	康芝药业	6,750	93,960.00	0.09
467	002597	金禾实业	6,000	93,780.00	0.09
468	000626	远大控股	3,800	93,670.00	0.09
469	000797	中国武夷	5,350	93,464.50	0.09
470	002212	南洋股份	5,500	93,280.00	0.09
471	300075	数字政通	5,000	93,200.00	0.09
472	300004	南风股份	6,500	93,145.00	0.09
473	600604	市北高新	4,500	93,015.00	0.09
474	000936	华西股份	9,500	93,005.00	0.09
475	300217	东方电热	21,820	92,953.20	0.09
476	300191	潜能恒信	2,700	92,880.00	0.09
477	002020	京新药业	8,200	92,824.00	0.09
478	000767	漳泽电力	24,100	92,785.00	0.09

479	002166	莱茵生物	7,500	92,775.00	0.09
480	002100	天康生物	10,300	92,391.00	0.09
481	600686	金龙汽车	6,500	92,365.00	0.09
482	600438	通威股份	14,500	92,365.00	0.09
483	000782	美达股份	9,100	92,274.00	0.09
484	002314	南山控股	12,100	92,202.00	0.09
485	300100	双林股份	2,700	91,800.00	0.09
486	300506	名家汇	1,900	91,789.00	0.09
487	000531	穗恒运 A	8,000	91,760.00	0.09
488	300303	聚飞光电	10,400	91,728.00	0.09
489	601069	西部黄金	4,100	91,676.00	0.09
490	600119	长江投资	4,600	91,586.00	0.09
491	300474	景嘉微	1,700	91,579.00	0.09
492	600965	福成股份	7,000	91,560.00	0.09
493	300343	联创互联	3,830	91,537.00	0.09
494	000760	斯太尔	8,400	91,476.00	0.09
495	300476	胜宏科技	4,000	91,400.00	0.09
496	002756	永兴特钢	3,100	91,388.00	0.09
497	002521	齐峰新材	8,500	91,375.00	0.09
498	002197	证通电子	5,600	91,336.00	0.09
499	600555	海航创新	14,600	91,250.00	0.09
500	002542	中化岩土	11,250	91,125.00	0.09
501	300386	飞天诚信	3,600	91,116.00	0.09
502	002080	中材科技	5,200	91,104.00	0.09
503	600740	山西焦化	11,500	90,965.00	0.09
504	002717	岭南园林	3,500	90,930.00	0.09
505	000554	泰山石油	8,200	90,774.00	0.09
506	002334	英威腾	11,200	90,720.00	0.09
507	002033	丽江旅游	6,300	90,720.00	0.09
508	300439	美康生物	3,000	90,570.00	0.09
509	600239	云南城投	16,000	90,560.00	0.09
510	000700	模塑科技	10,800	90,180.00	0.09
511	300152	科融环境	12,200	90,036.00	0.09
512	300485	赛升药业	2,100	89,943.00	0.09
513	000987	越秀金控	6,200	89,838.00	0.09
514	603008	喜临门	4,900	89,670.00	0.09
515	002609	捷顺科技	5,600	89,600.00	0.09
516	600133	东湖高新	10,900	89,598.00	0.09
517	002515	金字火腿	5,200	89,544.00	0.09

518	601028	玉龙股份	8,400	89,460.00	0.09
519	002658	雪迪龙	5,200	89,440.00	0.09
520	600459	贵研铂业	3,900	89,310.00	0.09
521	002484	江海股份	5,420	89,050.60	0.08
522	600113	浙江东日	4,100	89,011.00	0.08
523	000576	广东甘化	5,700	88,920.00	0.08
524	300066	三川智慧	13,400	88,842.00	0.08
525	002226	江南化工	10,300	88,683.00	0.08
526	300076	GQY 视讯	5,800	88,508.00	0.08
527	002527	新时达	6,600	88,506.00	0.08
528	002619	巨龙管业	5,100	88,485.00	0.08
529	000837	秦川机床	10,400	88,192.00	0.08
530	600624	复旦复华	10,230	87,978.00	0.08
531	300028	金亚科技	6,200	87,916.00	0.08
532	000886	海南高速	17,000	87,890.00	0.08
533	002203	海亮股份	10,900	87,854.00	0.08
534	002111	威海广泰	4,100	87,740.00	0.08
535	300064	豫金刚石	7,700	87,395.00	0.08
536	002540	亚太科技	11,100	87,135.00	0.08
537	000043	中航地产	7,100	87,046.00	0.08
538	002504	弘高创意	10,998	86,994.18	0.08
539	300215	电科院	6,500	86,970.00	0.08
540	002655	共达电声	6,200	86,924.00	0.08
541	002178	延华智能	9,400	86,856.00	0.08
542	002301	齐心集团	4,000	86,800.00	0.08
543	000409	山东地矿	6,107	86,719.40	0.08
544	600020	中原高速	19,300	86,657.00	0.08
545	002324	普利特	2,900	86,594.00	0.08
546	002157	正邦科技	13,000	86,580.00	0.08
547	002671	龙泉股份	7,200	86,472.00	0.08
548	000966	长源电力	14,300	86,372.00	0.08
549	002079	苏州固锝	9,400	86,198.00	0.08
550	600526	菲达环保	7,000	86,030.00	0.08
551	603128	华贸物流	8,600	86,000.00	0.08
552	000545	金浦钛业	14,800	85,988.00	0.08
553	000070	特发信息	3,400	85,986.00	0.08
554	002571	德力股份	5,600	85,848.00	0.08
555	600692	亚通股份	5,300	85,807.00	0.08
556	002675	东诚药业	6,000	85,800.00	0.08

557	002584	西陇科学	5,400	85,752.00	0.08
558	000958	东方能源	5,900	85,727.00	0.08
559	002321	华英农业	8,000	85,680.00	0.08
560	603108	润达医疗	2,800	85,568.00	0.08
561	000536	华映科技	5,600	85,512.00	0.08
562	000838	财信发展	9,400	85,446.00	0.08
563	600229	城市传媒	7,500	85,350.00	0.08
564	002192	融捷股份	3,900	85,332.00	0.08
565	300007	汉威电子	4,400	85,228.00	0.08
566	002711	欧浦智网	5,680	85,200.00	0.08
567	300438	鹏辉能源	2,700	85,050.00	0.08
568	300018	中元股份	7,200	84,816.00	0.08
569	600467	好当家	18,800	84,788.00	0.08
570	300351	永贵电器	3,300	84,711.00	0.08
571	300177	中海达	5,700	84,645.00	0.08
572	002516	旷达科技	12,900	84,624.00	0.08
573	000096	广聚能源	5,700	84,360.00	0.08
574	002737	葵花药业	2,500	84,225.00	0.08
575	601789	宁波建工	12,600	84,168.00	0.08
576	002234	民和股份	3,900	84,162.00	0.08
577	600684	珠江实业	10,700	84,102.00	0.08
578	000514	渝开发	7,200	84,096.00	0.08
579	000404	华意压缩	8,400	84,000.00	0.08
580	000811	烟台冰轮	5,600	83,944.00	0.08
581	600987	航民股份	6,800	83,912.00	0.08
582	300050	世纪鼎利	6,400	83,904.00	0.08
583	002148	北纬通信	4,400	83,864.00	0.08
584	002751	易尚展示	1,800	83,592.00	0.08
585	600818	中路股份	2,500	83,450.00	0.08
586	002590	万安科技	4,100	83,312.00	0.08
587	300048	合康变频	10,100	83,022.00	0.08
588	300044	赛为智能	5,700	82,821.00	0.08
589	002472	双环传动	7,300	82,782.00	0.08
590	002393	力生制药	2,000	82,600.00	0.08
591	002231	奥维通信	5,400	82,566.00	0.08
592	000553	沙隆达 A	5,500	82,555.00	0.08
593	300173	智慧松德	5,000	82,550.00	0.08
594	002124	天邦股份	6,800	82,484.00	0.08
595	600082	海泰发展	11,100	82,473.00	0.08

596	300135	宝利国际	13,800	82,386.00	0.08
597	002518	科士达	3,850	82,351.50	0.08
598	600396	金山股份	15,800	82,318.00	0.08
599	603566	普莱柯	3,400	82,212.00	0.08
600	000532	力合股份	4,400	82,192.00	0.08
601	600336	澳柯玛	10,200	82,008.00	0.08
602	300256	星星科技	6,900	81,765.00	0.08
603	600973	宝胜股份	10,140	81,627.00	0.08
604	300262	巴安水务	4,800	81,600.00	0.08
605	300456	耐威科技	1,600	81,488.00	0.08
606	300052	中青宝	3,400	81,260.00	0.08
607	002255	海陆重工	9,300	81,189.00	0.08
608	600726	华电能源	16,400	81,180.00	0.08
609	603636	南威软件	900	81,180.00	0.08
610	300175	朗源股份	6,100	81,130.00	0.08
611	002009	天奇股份	5,600	81,032.00	0.08
612	600310	桂东电力	8,900	80,990.00	0.08
613	000889	茂业通信	5,300	80,931.00	0.08
614	002524	光正集团	7,600	80,864.00	0.08
615	002172	澳洋科技	7,900	80,817.00	0.08
616	300432	富临精工	3,300	80,520.00	0.08
617	600744	华银电力	15,300	80,478.00	0.08
618	300245	天玑科技	4,700	80,417.00	0.08
619	300171	东富龙	5,400	80,406.00	0.08
620	601218	吉鑫科技	14,900	80,013.00	0.08
621	000591	太阳能	5,900	80,004.00	0.08
622	000701	厦门信达	5,200	79,924.00	0.08
623	300056	三维丝	4,800	79,920.00	0.08
624	000537	广宇发展	8,800	79,904.00	0.08
625	600782	新钢股份	23,900	79,826.00	0.08
626	600589	广东榕泰	9,100	79,625.00	0.08
627	600661	新南洋	2,800	79,604.00	0.08
628	300288	朗玛信息	2,900	79,315.00	0.08
629	002662	京威股份	4,800	78,960.00	0.08
630	002279	久其软件	4,600	78,890.00	0.08
631	300205	天喻信息	5,500	78,870.00	0.08
632	600052	浙江广厦	11,200	78,848.00	0.08
633	300467	迅游科技	1,800	78,840.00	0.08
634	000796	凯撒旅游	5,200	78,780.00	0.08

635	002586	围海股份	7,800	78,702.00	0.07
636	600077	宋都股份	14,400	78,624.00	0.07
637	000665	湖北广电	5,500	78,540.00	0.07
638	603308	应流股份	3,900	78,507.00	0.07
639	000657	中钨高新	5,400	78,462.00	0.07
640	002182	云海金属	4,200	78,162.00	0.07
641	000920	南方汇通	5,400	78,138.00	0.07
642	000561	烽火电子	6,400	78,016.00	0.07
643	002021	中捷资源	8,800	77,880.00	0.07
644	002348	高乐股份	10,100	77,871.00	0.07
645	300516	久之洋	800	77,808.00	0.07
646	002537	海立美达	2,400	77,712.00	0.07
647	300447	全信股份	1,400	77,672.00	0.07
648	300232	洲明科技	5,200	77,584.00	0.07
649	300219	鸿利智汇	7,150	77,577.50	0.07
650	300016	北陆药业	4,200	77,574.00	0.07
651	002372	伟星新材	5,020	77,458.60	0.07
652	600830	香溢融通	6,800	77,180.00	0.07
653	300248	新开普	2,700	76,977.00	0.07
654	300160	秀强股份	6,400	76,928.00	0.07
655	600135	乐凯胶片	5,600	76,832.00	0.07
656	600257	大湖股份	7,200	76,680.00	0.07
657	000795	英洛华	12,100	76,593.00	0.07
658	002139	拓邦股份	5,800	76,502.00	0.07
659	002791	坚朗五金	1,400	76,440.00	0.07
660	000564	西安民生	9,000	76,320.00	0.07
661	600246	万通地产	13,200	76,296.00	0.07
662	002214	大立科技	6,900	76,245.00	0.07
663	600313	农发种业	11,550	76,230.00	0.07
664	600865	百大集团	5,600	76,216.00	0.07
665	603686	龙马环卫	2,300	76,176.00	0.07
666	300102	乾照光电	9,100	76,167.00	0.07
667	000498	山东路桥	9,600	76,128.00	0.07
668	000523	广州浪奇	6,700	76,112.00	0.07
669	000058	深赛格	6,900	76,107.00	0.07
670	002346	柘中股份	1,900	75,981.00	0.07
671	600708	光明地产	8,500	75,905.00	0.07
672	600470	六国化工	8,900	75,828.00	0.07
673	600533	栖霞建设	13,500	75,735.00	0.07

674	600834	申通地铁	5,100	75,480.00	0.07
675	000893	东凌国际	6,500	75,335.00	0.07
676	600592	龙溪股份	6,000	75,060.00	0.07
677	600055	万东医疗	4,140	75,016.80	0.07
678	600530	交大昂立	10,000	75,000.00	0.07
679	300041	回天新材	6,000	74,940.00	0.07
680	000151	中成股份	3,800	74,442.00	0.07
681	600007	中国国贸	4,300	74,261.00	0.07
682	002452	长高集团	7,900	74,260.00	0.07
683	600449	宁夏建材	6,100	74,237.00	0.07
684	000922	佳电股份	5,800	74,124.00	0.07
685	000757	浩物股份	6,800	73,984.00	0.07
686	300006	莱美药业	8,738	73,836.10	0.07
687	300198	纳川股份	11,080	73,792.80	0.07
688	002782	可立克	2,700	73,737.00	0.07
689	300155	安居宝	5,851	73,664.09	0.07
690	002626	金达威	5,300	73,617.00	0.07
691	002454	松芝股份	5,400	73,602.00	0.07
692	300074	华平股份	8,000	73,600.00	0.07
693	002349	精华制药	3,650	73,547.50	0.07
694	600843	上工申贝	3,900	73,398.00	0.07
695	300109	新开源	1,500	73,380.00	0.07
696	300246	宝莱特	2,200	73,348.00	0.07
697	001896	豫能控股	7,300	73,073.00	0.07
698	002689	远大智能	10,300	73,027.00	0.07
699	002335	科华恒盛	1,700	72,930.00	0.07
700	300063	天龙集团	2,500	72,825.00	0.07
701	002577	雷柏科技	2,400	72,816.00	0.07
702	300193	佳士科技	7,660	72,770.00	0.07
703	600326	西藏天路	8,600	72,756.00	0.07
704	600191	华资实业	5,200	72,384.00	0.07
705	300307	慈星股份	6,900	72,312.00	0.07
706	300204	舒泰神	4,078	72,302.94	0.07
707	002362	汉王科技	3,200	72,192.00	0.07
708	300363	博腾股份	3,600	72,180.00	0.07
709	000965	天保基建	10,800	72,036.00	0.07
710	300071	华谊嘉信	7,300	71,978.00	0.07
711	600354	敦煌种业	7,900	71,969.00	0.07
712	002328	新朋股份	6,700	71,891.00	0.07

713	002539	云图控股	6,500	71,890.00	0.07
714	300206	理邦仪器	7,550	71,725.00	0.07
715	600090	同济堂	6,100	71,675.00	0.07
716	002432	九安医疗	4,600	71,438.00	0.07
717	002090	金智科技	3,000	71,280.00	0.07
718	300181	佐力药业	7,800	71,214.00	0.07
719	603618	杭电股份	5,900	71,213.00	0.07
720	600523	贵航股份	3,100	71,114.00	0.07
721	600798	宁波海运	13,300	71,022.00	0.07
722	002218	拓日新能	7,900	71,021.00	0.07
723	002017	东信和平	4,500	71,010.00	0.07
724	002565	上海绿新	8,800	70,928.00	0.07
725	002235	安妮股份	4,450	70,844.00	0.07
726	603012	创力集团	6,800	70,516.00	0.07
727	601107	四川成渝	13,900	70,334.00	0.07
728	300051	三五互联	4,800	70,320.00	0.07
729	603227	雪峰科技	8,500	70,210.00	0.07
730	300263	隆华节能	9,500	70,015.00	0.07
731	603989	艾华集团	1,900	69,939.00	0.07
732	600683	京投发展	7,900	69,915.00	0.07
733	000159	国际实业	8,200	69,700.00	0.07
734	300392	腾信股份	4,100	69,659.00	0.07
735	300429	强力新材	2,170	69,440.00	0.07
736	600814	杭州解百	6,100	69,357.00	0.07
737	002060	粤水电	9,000	69,300.00	0.07
738	601799	星宇股份	1,800	69,300.00	0.07
739	000029	深深房 A	6,200	69,254.00	0.07
740	002494	华斯股份	5,000	69,200.00	0.07
741	603979	金诚信	3,880	69,180.40	0.07
742	000868	安凯客车	10,400	69,160.00	0.07
743	603020	爱普股份	3,400	69,156.00	0.07
744	300440	运达科技	2,400	69,096.00	0.07
745	300337	银邦股份	7,000	69,020.00	0.07
746	600136	当代明诚	4,200	69,006.00	0.07
747	300424	航新科技	1,400	68,922.00	0.07
748	603609	禾丰牧业	5,300	68,529.00	0.07
749	603508	思维列控	1,000	68,520.00	0.07
750	300403	地尔汉宇	1,100	68,497.00	0.07
751	600515	海航基础	5,900	68,440.00	0.07

752	603939	益丰药房	2,300	68,172.00	0.06
753	600197	伊力特	4,700	68,103.00	0.06
754	300518	盛讯达	600	68,076.00	0.06
755	601968	宝钢包装	7,100	67,947.00	0.06
756	002617	露笑科技	4,630	67,736.90	0.06
757	000010	美丽生态	8,800	67,672.00	0.06
758	002666	德联集团	8,100	67,554.00	0.06
759	603808	歌力思	2,100	67,389.00	0.06
760	600658	电子城	5,100	67,371.00	0.06
761	600508	上海能源	6,200	67,332.00	0.06
762	300213	佳讯飞鸿	2,400	67,200.00	0.06
763	002196	方正电机	2,800	67,088.00	0.06
764	002535	林州重机	10,280	66,922.80	0.06
765	300353	东土科技	4,400	66,836.00	0.06
766	002337	赛象科技	8,800	66,792.00	0.06
767	300465	高伟达	3,680	66,681.60	0.06
768	600207	安彩高科	7,400	66,674.00	0.06
769	600876	洛阳玻璃	2,600	66,586.00	0.06
770	002499	科林环保	2,400	66,480.00	0.06
771	600193	创兴资源	6,400	66,432.00	0.06
772	300451	创业软件	1,800	66,420.00	0.06
773	002543	万和电气	3,800	66,120.00	0.06
774	300229	拓尔思	4,000	66,040.00	0.06
775	002574	明牌珠宝	5,700	65,949.00	0.06
776	002772	众兴菌业	3,200	65,824.00	0.06
777	000688	建新矿业	7,300	65,773.00	0.06
778	002567	唐人神	5,200	65,728.00	0.06
779	002762	金发拉比	1,700	65,654.00	0.06
780	603100	川仪股份	4,200	65,520.00	0.06
781	300358	楚天科技	3,800	65,512.00	0.06
782	000948	南天信息	3,700	65,490.00	0.06
783	002769	普路通	3,199	65,483.53	0.06
784	600283	钱江水利	5,300	65,455.00	0.06
785	601566	九牧王	3,700	65,453.00	0.06
786	300236	上海新阳	1,700	65,450.00	0.06
787	600080	金花股份	5,200	65,312.00	0.06
788	002115	三维通信	6,200	65,286.00	0.06
789	000018	神州长城	6,100	65,270.00	0.06
790	300495	美尚生态	1,513	65,210.30	0.06

791	002546	新联电子	7,160	64,941.20	0.06
792	300436	广生堂	1,200	64,848.00	0.06
793	600629	华建集团	3,100	64,728.00	0.06
794	600279	重庆港九	8,950	64,619.00	0.06
795	300172	中电环保	6,500	64,480.00	0.06
796	300342	天银机电	2,800	64,400.00	0.06
797	002107	沃华医药	3,900	64,389.00	0.06
798	002381	双箭股份	5,500	64,185.00	0.06
799	002614	蒙发利	4,800	64,032.00	0.06
800	600128	弘业股份	4,200	63,882.00	0.06
801	600168	武汉控股	6,100	63,806.00	0.06
802	300139	晓程科技	4,700	63,685.00	0.06
803	000011	深物业 A	3,400	63,682.00	0.06
804	002062	宏润建设	9,500	63,650.00	0.06
805	300030	阳普医疗	4,600	63,618.00	0.06
806	300276	三丰智能	3,500	63,525.00	0.06
807	000789	万年青	7,900	63,437.00	0.06
808	601007	金陵饭店	4,500	63,405.00	0.06
809	300311	任子行	3,801	63,362.67	0.06
810	000551	创元科技	6,000	63,300.00	0.06
811	002246	北化股份	5,300	63,282.00	0.06
812	300255	常山药业	8,000	63,200.00	0.06
813	603168	莎普爱思	1,500	63,195.00	0.06
814	000428	华天酒店	8,700	63,162.00	0.06
815	002338	奥普光电	1,300	62,920.00	0.06
816	002441	众业达	4,700	62,886.00	0.06
817	300457	赢合科技	1,000	62,580.00	0.06
818	603126	中材节能	5,200	62,400.00	0.06
819	000990	诚志股份	4,000	62,400.00	0.06
820	300209	天泽信息	2,500	62,200.00	0.06
821	300356	光一科技	1,800	62,190.00	0.06
822	300130	新国都	2,500	62,075.00	0.06
823	002733	雄韬股份	3,050	62,067.50	0.06
824	002363	隆基机械	4,960	62,000.00	0.06
825	002137	麦达数字	4,900	61,985.00	0.06
826	300151	昌红科技	5,400	61,938.00	0.06
827	300409	道氏技术	1,800	61,920.00	0.06
828	300021	大禹节水	3,400	61,880.00	0.06
829	601199	江南水务	8,000	61,760.00	0.06

830	002270	华明装备	4,300	61,662.00	0.06
831	002612	朗姿股份	3,400	61,608.00	0.06
832	002274	华昌化工	6,800	61,608.00	0.06
833	600192	长城电工	6,600	61,578.00	0.06
834	603898	好莱客	1,900	61,503.00	0.06
835	002406	远东传动	7,200	61,344.00	0.06
836	002144	宏达高科	2,700	61,074.00	0.06
837	300328	宜安科技	5,180	60,761.40	0.06
838	000548	湖南投资	7,500	60,675.00	0.06
839	300360	炬华科技	3,150	60,606.00	0.06
840	002741	光华科技	3,100	60,512.00	0.06
841	002307	北新路桥	7,200	60,480.00	0.06
842	002380	科远股份	2,100	60,417.00	0.06
843	603456	九洲药业	2,800	60,396.00	0.06
844	002451	摩恩电气	3,800	60,344.00	0.06
845	002171	楚江新材	3,800	60,230.00	0.06
846	300119	瑞普生物	3,500	60,165.00	0.06
847	601339	百隆东方	9,600	59,904.00	0.06
848	600287	江苏舜天	5,600	59,864.00	0.06
849	000909	数源科技	3,800	59,736.00	0.06
850	300140	启源装备	3,700	59,681.00	0.06
851	002351	漫步者	5,000	59,500.00	0.06
852	002162	悦心健康	9,000	59,490.00	0.06
853	600218	全柴动力	5,500	59,235.00	0.06
854	002529	海源机械	2,800	59,192.00	0.06
855	600101	明星电力	4,900	59,045.00	0.06
856	300373	扬杰科技	3,000	59,040.00	0.06
857	300165	天瑞仪器	5,900	59,000.00	0.06
858	300502	新易盛	500	58,890.00	0.06
859	002747	埃斯顿	1,800	58,716.00	0.06
860	002228	合兴包装	11,180	58,695.00	0.06
861	002232	启明信息	4,400	58,564.00	0.06
862	000899	赣能股份	6,300	58,527.00	0.06
863	000905	厦门港务	5,700	58,482.00	0.06
864	002457	青龙管业	5,000	58,050.00	0.06
865	300388	国祯环保	2,600	58,006.00	0.06
866	300366	创意信息	1,700	57,970.00	0.06
867	002438	江苏神通	2,800	57,960.00	0.06
868	002378	章源钨业	5,900	57,761.00	0.06

869	002320	海峡股份	3,700	57,757.00	0.06
870	000546	金圆股份	5,100	57,732.00	0.05
871	300444	双杰电气	2,400	57,600.00	0.05
872	600386	北巴传媒	4,300	57,405.00	0.05
873	002605	姚记扑克	3,400	57,392.00	0.05
874	603116	红蜻蜓	2,600	57,356.00	0.05
875	600159	大龙地产	10,700	57,138.00	0.05
876	000022	深赤湾 A	3,000	57,090.00	0.05
877	300084	海默科技	4,900	57,085.00	0.05
878	300114	中航电测	2,500	56,950.00	0.05
879	300419	浩丰科技	2,000	56,920.00	0.05
880	000722	湖南发展	4,000	56,840.00	0.05
881	601368	绿城水务	4,700	56,823.00	0.05
882	601015	陕西黑猫	5,950	56,763.00	0.05
883	300512	中亚股份	1,700	56,661.00	0.05
884	300471	厚普股份	1,300	56,329.00	0.05
885	300190	维尔利	3,500	56,315.00	0.05
886	600126	杭钢股份	6,700	56,280.00	0.05
887	300443	金雷风电	990	56,212.20	0.05
888	603779	威龙股份	1,300	56,160.00	0.05
889	002579	中京电子	4,100	56,088.00	0.05
890	603999	读者传媒	1,900	55,708.00	0.05
891	002520	日发精机	4,700	55,695.00	0.05
892	600278	东方创业	3,400	55,488.00	0.05
893	600724	宁波富达	9,300	55,335.00	0.05
894	000419	通程控股	7,000	55,230.00	0.05
895	002660	茂硕电源	3,600	54,720.00	0.05
896	300473	德尔股份	700	54,684.00	0.05
897	002592	八菱科技	1,800	54,666.00	0.05
898	300334	津膜科技	3,000	54,540.00	0.05
899	300523	辰安科技	500	54,510.00	0.05
900	002792	通宇通讯	1,000	54,260.00	0.05
901	603818	曲美家居	3,100	54,095.00	0.05
902	000014	沙河股份	2,600	54,054.00	0.05
903	300384	三联虹普	1,300	53,898.00	0.05
904	002184	海得控制	2,600	53,820.00	0.05
905	300484	蓝海华腾	700	53,781.00	0.05
906	300298	三诺生物	2,950	53,513.00	0.05
907	300314	戴维医疗	2,500	53,150.00	0.05

908	002135	东南网架	7,300	53,144.00	0.05
909	002483	润邦股份	4,500	53,055.00	0.05
910	603997	继峰股份	2,700	52,812.00	0.05
911	600738	兰州民百	5,500	52,415.00	0.05
912	002487	大金重工	5,800	52,374.00	0.05
913	300227	光韵达	2,100	52,290.00	0.05
914	603338	浙江鼎力	1,000	52,110.00	0.05
915	002786	银宝山新	2,500	52,025.00	0.05
916	600680	上海普天	1,700	51,986.00	0.05
917	600548	深高速	6,100	51,850.00	0.05
918	000637	茂化实华	6,700	51,791.00	0.05
919	300187	永清环保	4,200	51,744.00	0.05
920	002712	思美传媒	1,800	51,480.00	0.05
921	000570	苏常柴 A	5,300	51,410.00	0.05
922	002801	微光股份	400	51,360.00	0.05
923	300254	仟源医药	2,660	51,311.40	0.05
924	603669	灵康药业	1,700	51,068.00	0.05
925	002114	罗平锌电	2,300	50,968.00	0.05
926	300448	浩云科技	1,695	50,646.60	0.05
927	002726	龙大肉食	2,900	50,547.00	0.05
928	002651	利君股份	4,300	50,439.00	0.05
929	002401	中海科技	3,200	50,144.00	0.05
930	300468	四方精创	900	50,013.00	0.05
931	002016	世荣兆业	5,200	49,764.00	0.05
932	002644	佛慈制药	4,400	49,720.00	0.05
933	002528	英飞拓	6,750	49,680.00	0.05
934	002771	真视通	700	49,308.00	0.05
935	002302	西部建设	6,600	49,104.00	0.05
936	300508	维宏股份	400	48,596.00	0.05
937	300195	长荣股份	2,900	48,546.00	0.05
938	300312	邦讯技术	3,400	48,518.00	0.05
939	603339	四方冷链	1,300	48,464.00	0.05
940	300449	汉邦高科	1,000	48,440.00	0.05
941	002677	浙江美大	4,140	48,438.00	0.05
942	002356	赫美集团	2,000	48,400.00	0.05
943	300511	雪榕生物	1,000	48,360.00	0.05
944	002790	瑞尔特	1,000	48,100.00	0.05
945	002667	鞍重股份	1,700	47,872.00	0.05
946	600162	香江控股	12,050	47,838.50	0.05

947	002763	汇洁股份	1,400	47,810.00	0.05
948	300349	金卡股份	1,500	47,745.00	0.05
949	002752	昇兴股份	2,750	47,492.50	0.05
950	600560	金自天正	2,900	47,473.00	0.05
951	600190	锦州港	11,400	47,424.00	0.05
952	300494	盛天网络	1,500	47,295.00	0.05
953	002788	鹭燕医药	800	47,200.00	0.04
954	603789	星光农机	1,700	47,056.00	0.04
955	603398	邦宝益智	1,400	46,928.00	0.04
956	002703	浙江世宝	1,500	46,230.00	0.04
957	600716	凤凰股份	6,000	46,020.00	0.04
958	600359	新农开发	4,900	46,011.00	0.04
959	002227	奥特迅	1,900	45,923.00	0.04
960	300520	科大国创	600	45,792.00	0.04
961	300380	安硕信息	1,200	45,732.00	0.04
962	002388	新亚制程	4,300	45,623.00	0.04
963	002777	久远银海	500	45,100.00	0.04
964	002287	奇正藏药	1,000	44,290.00	0.04
965	002724	海洋王	1,700	43,928.00	0.04
966	603737	三棵树	600	43,812.00	0.04
967	300389	艾比森	2,008	43,573.60	0.04
968	600613	神奇制药	3,100	43,493.00	0.04
969	002750	龙津药业	2,600	43,238.00	0.04
970	601020	华钰矿业	1,100	43,098.00	0.04
971	603309	维力医疗	1,700	43,027.00	0.04
972	601038	一拖股份	3,800	42,940.00	0.04
973	300162	雷曼股份	3,000	42,900.00	0.04
974	300399	京天利	1,350	42,768.00	0.04
975	600845	宝信软件	2,400	42,336.00	0.04
976	300507	苏奥传感	400	42,200.00	0.04
977	603299	井神股份	2,400	41,784.00	0.04
978	002783	凯龙股份	500	41,725.00	0.04
979	603958	哈森股份	1,400	41,692.00	0.04
980	002713	东易日盛	1,600	41,040.00	0.04
981	300497	富祥股份	700	40,817.00	0.04
982	603599	广信股份	2,400	40,704.00	0.04
983	300381	溢多利	1,700	40,664.00	0.04
984	600081	东风科技	2,700	40,635.00	0.04
985	300519	新光药业	500	40,500.00	0.04

986	603959	百利科技	1,400	40,222.00	0.04
987	002802	洪汇新材	700	40,222.00	0.04
988	603800	道森股份	1,300	39,221.00	0.04
989	300378	鼎捷软件	1,650	39,105.00	0.04
990	300293	蓝英装备	2,300	38,640.00	0.04
991	000885	同力水泥	2,000	38,080.00	0.04
992	603996	中新科技	1,900	37,848.00	0.04
993	300522	世名科技	400	37,804.00	0.04
994	000038	深大通	800	37,080.00	0.04
995	603936	博敏电子	1,100	34,837.00	0.03
996	603861	白云电器	1,100	34,738.00	0.03
997	002781	奇信股份	1,000	32,250.00	0.03
998	603600	永艺股份	600	31,284.00	0.03
999	603166	福达股份	1,540	24,963.40	0.02
1,000	300350	华鹏飞	800	19,904.00	0.02

### 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	300323	华灿光电	12,200	109,678.00	0.10
2	002297	博云新材	8,100	106,029.00	0.10
3	002526	山东矿机	10,100	102,212.00	0.10
4	600979	广安爱众	10,800	85,536.00	0.08
5	600225	天津松江	10,600	70,384.00	0.07
6	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.07
7	300150	世纪瑞尔	7,300	66,795.00	0.06
8	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.06
9	603298	杭叉集团	2,387	57,956.36	0.06
10	601375	中原证券	13,620	54,480.00	0.05
11	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.05
12	000916	华北高速	10,700	53,607.00	0.05
13	603218	日月股份	1,196	49,813.40	0.05
14	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.03
15	603877	太平鸟	1,431	30,480.30	0.03
16	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.02
17	002833	弘亚数控	1,365	24,051.30	0.02
18	603878	武进不锈	462	18,480.00	0.02

19	300587	天铁股份	935	13,192.85	0.01
20	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
21	603886	元祖股份	623	11,027.10	0.01
22	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.01
23	603035	常熟汽饰	992	10,356.48	0.01
24	603239	浙江仙通	305	9,592.25	0.01
25	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.01
26	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.01
27	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.01

## 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	002343	慈文传媒	318,405.52	0.18
2	300383	光环新网	313,309.00	0.17
3	002176	江特电机	310,841.00	0.17
4	002407	多氟多	310,397.00	0.17
5	000048	康达尔	297,352.00	0.17
6	300324	旋极信息	286,843.00	0.16
7	300496	中科创达	282,354.00	0.16
8	000520	长航凤凰	278,118.00	0.15
9	600868	梅雁吉祥	276,200.00	0.15
10	002517	恺英网络	267,587.00	0.15
11	600490	鹏欣资源	265,678.00	0.15
12	300431	暴风集团	246,864.00	0.14
13	600401	海润光伏	246,398.00	0.14
14	002070	众和股份	243,098.00	0.13
15	600110	诺德股份	241,627.00	0.13
16	300159	新研股份	240,733.50	0.13
17	000627	天茂集团	240,241.00	0.13
18	300136	信维通信	239,863.00	0.13
19	002544	杰赛科技	237,504.00	0.13
20	300266	兴源环境	237,015.50	0.13

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	002407	多氟多	852,499.48	0.47
2	300136	信维通信	786,248.15	0.44
3	300113	顺网科技	731,434.40	0.41
4	600682	南京新百	700,394.00	0.39
5	002176	江特电机	693,278.80	0.38
6	002460	赣锋锂业	681,451.40	0.38
7	002426	胜利精密	675,230.80	0.37
8	300156	神雾环保	656,701.25	0.36
9	002572	索菲亚	651,603.00	0.36
10	300159	新研股份	558,552.45	0.31
11	300296	利亚德	540,934.60	0.30
12	000627	天茂集团	531,663.00	0.30
13	600666	奥瑞德	516,788.00	0.29
14	000938	紫光股份	506,253.10	0.28
15	002131	利欧股份	483,478.00	0.27
16	600687	刚泰控股	467,244.60	0.26
17	002075	沙钢股份	464,212.60	0.26
18	300324	旋极信息	456,256.75	0.25
19	600565	迪马股份	452,784.88	0.25
20	000008	神州高铁	452,374.00	0.25

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	111,083,896.68
卖出股票收入（成交）总额	154,098,885.96

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。

## 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

中证 1000 指数分级基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的鹏欣资源（600490）于 2016 年 4 月 19 日收到中国证券监督管理委员会上海证监局立案调查。因公司涉嫌未按规定披露信息，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司进行立案调查。

中证 1000 指数分级基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的梅雁吉祥（600868）于

2016 年 12 月 3 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局警告。因公司在目前无实际控制人，且第一大股东频繁变动的情况下，在 2016 年三季度报中披露了错误的第一大股东信息，虽然及时更正，但在市场中造成了一定的不良影响，对公司予以警示。

中证 1000 指数分级基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的慈文传媒（002343）于 2016 年 12 月 19 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局整改通知。因公司未披露该重大经营合同，要求公司进行整改，并补充披露相关信息。

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。

### 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	16,128.15
2	应收证券清算款	30,915.98
3	应收股利	-
4	应收利息	1,415.86
5	应收申购款	6,987.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,447.14

### 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	000516	国际医学	241,740.00	0.23	重大事项停牌
---	--------	------	------------	------	--------

### 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	300323	华灿光电	109,678.00	0.10	重大事项停牌
2	002297	博云新材	106,029.00	0.10	重大事项停牌
3	002526	山东矿机	102,212.00	0.10	重大事项停牌
4	600979	广安爱众	85,536.00	0.08	重大事项停牌
5	600225	天津松江	70,384.00	0.07	重大事项停牌

## § 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	100	120,080.07	11,575,384.00	96.40%	432,623.00	3.60%
1000B	510	23,545.11	2,544,507.00	21.19%	9,463,500.00	78.81%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	4,120	25,651.68	1,402,077.97	1.33%	104,282,858.62	98.67%
合计	4,730	27,420.92	15,521,968.97	11.97%	114,178,981.62	88.03%

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	6,044,246.00	50.34%

2	上海明泐投资管理有限公司—明泐多策略对冲 1 号基金	5,486,911.00	45.69%
3	周晓虎	50,000.00	0.42%
4	邓凤英	35,000.00	0.29%
5	董淑琴	30,000.00	0.25%
6	孙大威	29,400.00	0.24%
7	上海千象资产管理有限公司—千象磐石 1 号	29,300.00	0.24%
8	邵文杰	26,079.00	0.22%
9	魏永斌	23,597.00	0.20%
10	黄晖	22,115.00	0.18%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	易方达基金—民生银行—杭州银行股份有限公司	1,032,800.00	8.60%
2	祝东华	460,854.00	3.84%
3	上海鸣熙资产管理有限公司—鸣熙量子一号私募基金	400,082.00	3.33%
4	东方汇智—光大银行—天演 1 号特定客户资产管理计划	381,031.00	3.17%
5	银河期货有限公司—银河期货瑞安华丰 1 号资产管理计划	353,000.00	2.94%
6	陆洁华	282,500.00	2.35%
7	张路	236,100.00	1.97%
8	吴天爵	225,000.00	1.87%
9	谢锦星	223,800.00	1.86%
10	曹宜扬	216,300.00	1.80%

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	0.00	0.0000%
	1000B	0.00	0.0000%
	华宝兴业中证 1000 指数分级	72,183.00	0.0683%
	合计	72,183.00	0.0557%

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	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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	1000 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
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	-	-	108, 311, 273. 11
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	156, 876, 395. 99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	4, 242, 806. 00	4, 242, 806. 00	-4, 187, 013. 83
本报告期期末基金份额总额	12, 008, 007. 00	12, 008, 007. 00	105, 684, 936. 59

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

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。

**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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

**11.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

**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**

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

**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	
中信证券	2	50,269,488.57	19.05%	46,817.23	19.08%	-
申万宏源	3	45,466,378.23	17.23%	42,343.11	17.26%	-
平安证券	1	42,525,020.79	16.12%	39,603.82	16.14%	-
华宝证券	1	28,980,461.53	10.99%	26,991.30	11.00%	-
东方证券	2	19,802,042.21	7.51%	18,441.89	7.52%	-
安信证券	1	16,008,090.43	6.07%	14,908.99	6.08%	-
国信证券	1	15,556,732.18	5.90%	14,487.81	5.91%	-
长江证券	1	7,083,935.96	2.69%	6,598.49	2.69%	-
东北证券	1	6,063,115.99	2.30%	5,646.76	2.30%	-

中泰证券	2	5,224,482.49	1.98%	4,761.10	1.94%	-
东兴证券	1	4,619,874.09	1.75%	4,210.03	1.72%	-
方正证券	2	3,801,660.78	1.44%	3,481.22	1.42%	-
华泰证券	1	3,328,476.71	1.26%	3,099.76	1.26%	-
中银国际	1	3,198,781.26	1.21%	2,978.88	1.21%	-
广发证券	2	2,869,509.08	1.09%	2,672.66	1.09%	-
华信证券	1	2,497,140.97	0.95%	2,275.64	0.93%	-
高华证券	1	2,056,519.00	0.78%	1,915.38	0.78%	-
中信建投	1	1,142,895.79	0.43%	1,041.50	0.42%	-
国泰君安	2	1,044,988.61	0.40%	952.37	0.39%	-
海通证券	1	839,209.72	0.32%	781.70	0.32%	-
天风证券	2	649,507.16	0.25%	605.02	0.25%	-
光大证券	1	316,701.00	0.12%	294.93	0.12%	-
银河证券	1	288,240.42	0.11%	268.45	0.11%	-
长城证券	1	181,868.47	0.07%	169.37	0.07%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	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	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：财力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国

人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，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新增的有：天风证券、招商证券。

### 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 12 月 22 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 12 月 19 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝中证 1000A 份额定期份额折算后前收盘价调整的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 12 月 19 日
4	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 1000A 停牌的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 12 月 16 日
5	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时	2016 年 12 月 12 日

	折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告	报》和基金管理人网站	
6	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 12 月 12 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 10 月 13 日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信证券、中信证券(山东)基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 7 月 22 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参加兴业证券基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 7 月 11 日
10	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 7 月 1 日
11	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 6 月 24 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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 5 月 31 日
13	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 5 月 3 日
14	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 4 月 25 日
15	华宝兴业基金管理有限公司	《上海证券报》、《中	2016 年 4 月 12 日

	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	国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	
16	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 3 月 25 日
17	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
18	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
19	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
20	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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
21	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
22	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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝兴业中证 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。

## 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

## 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司  
2017 年 3 月 28 日