

# 华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

### 1.2

## § 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×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金

	和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。	华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	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%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>
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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>
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%

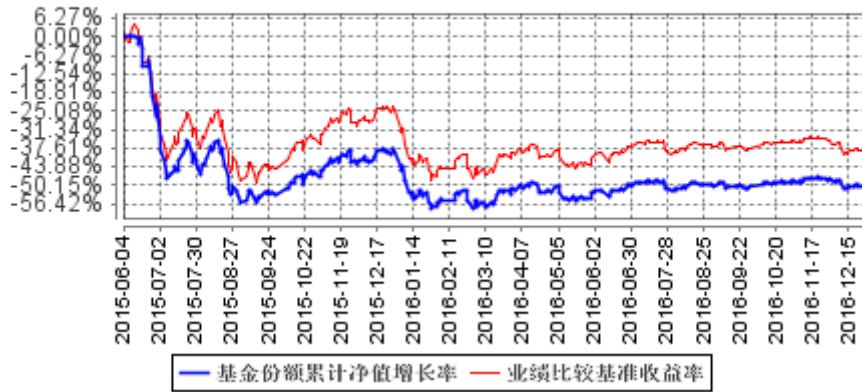
注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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）

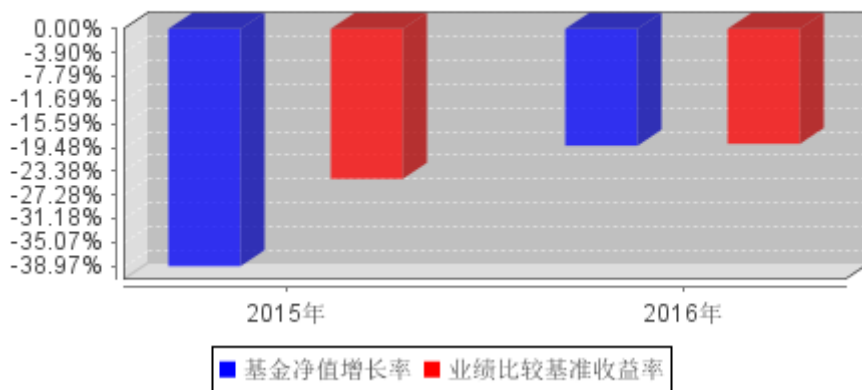
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 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、	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

	<p>华宝兴业 中证军工 ETF 基金 经理</p>			<p>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。</p>
--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，中证 1000 指数分级证券投资基金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中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《个人声明书》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

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

# § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：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		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		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		-	-
买入返售金融资产		-	-

应收证券清算款		30,915.98	-
应收利息		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		-	-
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		-	-
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		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		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		212,869,103.61	295,270,982.70
未分配利润		-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		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		-25,231,388.41	-122,638,685.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		455,938.18	177,826.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-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）		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		1,276,838.22	982,595.93
2.托管费		280,904.46	216,171.08
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		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		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“-”号填列）	-82,401,879.09	36,718,142.89	-45,683,736.20
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>          黄小蕙          </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的初始投资成本，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的初始投资成本，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 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。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 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%	-	-

#### 7.4.8.1.2 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。

#### 7.4.8.1.3 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。

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 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。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	982,595.93
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。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

	月 31 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。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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

本基金本期末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。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	华宇软件	2016年12月19日	重大资产重组	17.45	-	-	9,580	219,666.43	167,171.00	-
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	-

					日						
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	-	
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 11 月 29 日	重大资产 重组	16.69		2017 年 2 月 6 日	15.02	6,600	154,503.57	110,154.00	-
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	2016 年	重大资产	23.10	-	-	-	4,700	165,417.58	108,570.00	-



	航	12月5日	重组								
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	先导智能	2016年11月15日	重大资产重组	33.99	2017年2月8日	33.00	2,800	82,595.76	95,172.00	-	
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 22 日	8.86	10,140	79,076.40	81,627.00	-
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	12.93	6,100	76,188.70	71,675.00	-

		日			月 10 日						
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	-	
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	2016 年	重大资产	78.12	2017	71.00	700	47,862.17	54,684.00	-	

	份	11 月 1 日	重组		年 2 月 10 日					
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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.10 金融工具风险及管理

#### 7.4.10.1 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。

#### **7.4.10.2 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)。

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

#### **7.4.10.4 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。

### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.1.1 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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2015 年 12 月 31 日					
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。

#### 7.4.10.4.1.2 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）。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.4.3 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。

#### 7.4.10.4.3.1 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

#### 7.4.10.4.3.2 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。

#### 7.4.11 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股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

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

#### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金未投资股指期货。

### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未投资股指期货。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

### **8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金未投资国债期货。

### **8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金未投资国债期货。

## **8.12 投资组合报告附注**

### **8.12.1**

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 年季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	上海明法投资管理有限公司—明法多策略对冲 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	1000A	0
	1000B	0

有本开放式基金	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)	29, 441, 582. 00	29, 441, 582. 00	271, 827, 940. 54
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	7, 765, 201. 00	7, 765, 201. 00	158, 437, 073. 30
本报告期基金总申购份额	-	-	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；适当的区域分散化。

（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	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司  
2017 年 3 月 28 日