

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

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金		
基金简称	华宝兴业中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
基金主代码	162413		
交易代码	162413		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日		
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	142,983,595.47 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-16		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
下属分级基金场内简称:	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金份额总额	13,774,157.00 份	13,774,157.00 份	115,435,281.47 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	<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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-26,370,796.33
本期利润	-28,836,843.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1656
本期加权平均净值利润率	-20.72%
本期基金份额净值增长率	-18.33%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-131,275,675.39
期末可供分配基金份额利润	-0.9181
期末基金资产净值	120,955,280.92
期末基金份额净值	0.8459
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-50.16%

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

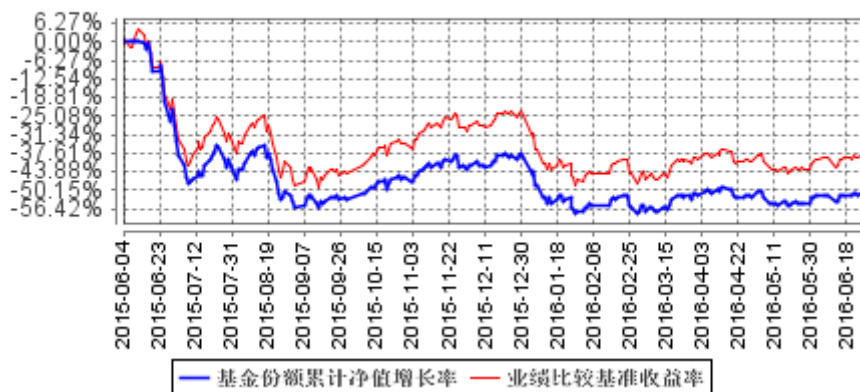
注：1、本基金业绩比较基准为：中证1000指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2015年6月4日至2016年6月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2016年6月30日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100基金、上证180价值ETF、上证180价值ETF联接、新兴产业基金、可转债债券、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业1000分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业中国互联网、华宝兴业核心优势、华宝兴业转型升级、华宝标普美国消费、华宝宝鑫纯债及华宝香港中小，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计157,478,315,809.98元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、 上证 180 成长 ETF、 华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、 华宝兴业中证医疗指数分级基金经理	2015 年 6 月 4 日	-	10 年	金融学硕士、量化投资部总经理助理。2006 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部工作，担任量化投资部高级数量分析师兼任投资经理助理的职务。2012 年 10 月起任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 5 月 21 日起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 4 日起任华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，中证 1000 指数分级证券投资基金在短期内出现过股票资产占基金资产净值低于 90%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

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

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.8459 元，本报告期内基金份额净值增长率为-18.33%，



同期业绩比较基准增长率为-16.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年上半年，中国GDP同比增长6.7%，我国经济呈阶段性企稳态势，下半年经济仍有望趋稳。从财政支出、国债发行规模等指标和发改委对基建投资的支持力度看，政府通过积极财政政策维稳经济的意愿明显，社会融资和新增贷款的稳健增长也可以看出稳增长政策背景下，实体经济对信贷的需求有所转暖，而相应信贷政策的支持力度也相当明显。预计下半年国家将继续保持积极的财政政策和稳健的货币政策，其他产业政策也继续利好证券市场的长远发展。其他的风险因素，如美联储加息预期降低、英国脱欧公投的短期风险释放等，将有利于投资者的风险偏好提升。中证1000指数是小市值股票组合的代表，其成份股为中证800指数样本股之外综合考虑规模和流动性选取1000只股票，全面覆盖了计算机、医药生物、机械设备、化工、电子、房地产、有色金属等28个行业。作为小盘宽基指数的代表，中证1000指数的小盘风格特征明显，投资者可以通过投资中证1000指数在大小盘风格轮动的结构性机会中把握小盘股投资机会。中长期来看，“大众创业、万众创新”经济转型与改革的战略将继续给小市值的股票带来高成长性，伴随这些经济转型与改革的措施真正开始释放红利，小市值公司的创新潜能将不断被挖掘，小盘股未来潜力大，投资价值明显。

本基金为分级基金，为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具。作为指数基金的管理人，我们将严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成份股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证1000指数的有效跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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

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

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## **§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）**

### **6.1 资产负债表**

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款		7,874,902.11	13,943,193.59
结算备付金		2,361.10	266,900.57
存出保证金		32,836.01	164,756.91
交易性金融资产		114,534,195.16	170,287,578.29
其中: 股票投资		114,534,195.16	170,287,578.29
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,458.00	3,414.32
应收股利		-	-
应收申购款		54,423.14	51,297.13
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		122,500,175.52	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6月30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		832,380.32	3,757,175.38
应付赎回款		140,373.58	77,404.07
应付管理人报酬		99,030.03	149,128.30
应付托管费		21,786.61	32,808.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		217,289.52	270,361.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		234,034.54	240,291.69
负债合计		1,544,894.60	4,527,168.92
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		242,682,723.04	295,270,982.70
未分配利润		-121,727,442.12	-115,081,010.81
所有者权益合计		120,955,280.92	180,189,971.89

负债和所有者权益总计		122,500,175.52	184,717,140.81
------------	--	----------------	----------------

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

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-27,473,304.20	-78,577,056.31
1.利息收入		46,186.32	93,538.51
其中：存款利息收入		46,186.32	93,538.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,174,829.54	-6,379,220.48
其中：股票投资收益		-25,548,631.42	-6,480,124.01
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		373,801.88	100,903.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,466,047.07	-72,355,931.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		121,386.09	64,556.94
<b>减：二、费用</b>		1,363,539.20	725,502.82
1. 管理人报酬		696,980.33	226,638.24
2. 托管费		153,335.73	49,860.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		308,105.70	411,089.93
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		205,117.44	37,914.25

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,836,843.40	-79,302,559.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,836,843.40	-79,302,559.13

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	295,270,982.70	-115,081,010.81	180,189,971.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,836,843.40	-28,836,843.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-52,588,259.66	22,190,412.09	-30,397,847.57
其中：1.基金申购款	147,415,790.60	-80,536,137.39	66,879,653.21
2.基金赎回款	-200,004,050.26	102,726,549.48	-97,277,500.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	242,682,723.04	-121,727,442.12	120,955,280.92
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		



证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售,按照每份基金份额 1.00 元计算,本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额,其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华宝中证 1000 基础份额”)、华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华宝中证 1000A 份额”)和华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华宝中证 1000B 份额”)。本基金基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的份额配对转换业务,包括分拆与合并。申请进行分拆的华宝中证 1000 基础份额的场内份额数必须为偶数;申请进行合并的华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额必须同时配对申请,且基金份额数必须为整数且相等。基金份额定期折算的频率为每年折算一次。定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元。当达到不定期折算条件(即华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值达到 1.5000 元或以上,或华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值跌至 0.2500 元或以下)时,本基金将分别对华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额进行份额折算,份额折算后华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的份额配比将保持为 1:1,份额折算后华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金

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

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2016 年 8 月 26 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。



### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

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

注：支付基金管理人 华宝兴业 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

#### 6.4.8.2.2 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6月30日	2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	153,335.73	49,860.40

注：支付基金托管人 中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,874,902.11	44,551.00	13,862,666.98	93,535.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.9.2 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
000806	银河生物	2016年1月12日	重大事项	19.44	2016年7月12日	17.50	20,200	564,377.46	392,688.00	-

		日	停牌		日						
300142	沃森生物	2016年3月22日	重大事项停牌	11.16	-	-	32,800	425,942.61	366,048.00	-	
002555	三七互娱	2016年3月10日	重大事项停牌	21.41	2016年8月16日	19.91	13,800	300,133.20	295,458.00	-	
300208	恒顺众昇	2016年5月18日	重大事项停牌	13.87	2016年7月8日	15.26	20,250	434,876.72	280,867.50	-	
002089	新海宜	2016年1月8日	重大事项停牌	16.88	2016年7月18日	18.55	14,700	330,042.31	248,136.00	-	
600149	廊坊发展	2016年4月13日	重大事项停牌	16.64	2016年7月21日	14.98	14,391	265,536.12	239,466.24	-	
002630	华西能源	2016年4月25日	重大事项停牌	11.06	-	-	21,400	285,588.82	236,684.00	-	
002283	天润曲轴	2016年3月23日	重大事项停牌	17.15	-	-	13,100	257,745.11	224,665.00	-	
300166	东方国信	2016年6月8日	重大事项停牌	27.47	-	-	7,900	277,650.62	217,013.00	-	
600330	天通股份	2016年5月23日	重大事项停牌	13.93	-	-	15,100	229,872.89	210,343.00	-	
600653	申华控股	2016年5月5日	重大事项停牌	3.93	-	-	53,500	352,372.37	210,255.00	-	
002355	兴民钢圈	2016年5月12日	重大事项停牌	19.35	-	-	10,600	149,878.54	205,110.00	-	
300300	汉鼎股份	2016年5月10日	重大事项停牌	30.56	-	-	6,600	205,303.42	201,696.00	-	
000802	北京文化	2016年6月1日	重大事项停牌	23.52	2016年8月22日	21.86	8,500	252,735.17	199,920.00	-	
300332	天壕环境	2016年4月11日	重大事项停牌	9.37	-	-	20,600	254,119.61	193,022.00	-	
600139	西部	2016年	重大	12.31	-	-	15,000	203,221.84	184,650.00	-	

	资源	4月11日	事项停牌								
600577	精达股份	2016年5月3日	重大事项停牌	4.18	-	-	40,300	267,028.23	168,454.00	-	
002445	中南文化	2016年6月14日	重大事项停牌	22.99	-	-	7,300	152,430.17	167,827.00	-	
002331	皖通科技	2016年4月18日	重大事项停牌	16.54		2016年7月11日	15.31	10,080	239,258.97	166,723.20	-
300284	苏交科	2016年5月20日	重大事项停牌	19.49	-	-	8,400	196,622.74	163,716.00	-	
300450	先导智能	2016年3月14日	重大事项停牌	37.81		2016年7月20日	41.59	4,200	123,893.64	158,802.00	-
000932	华菱钢铁	2016年3月28日	重大事项停牌	3.95	-	-	40,200	144,746.69	158,790.00	-	
002617	露笑科技	2016年5月9日	重大事项停牌	15.60	-	-	10,030	116,966.66	156,468.00	-	
002469	三维工程	2016年5月10日	重大事项停牌	10.71	-	-	13,850	135,732.08	148,333.50	-	
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项停牌	50.58	-	-	2,900	153,976.61	146,682.00	-	
000920	南方汇通	2016年2月17日	重大事项停牌	17.80		2016年7月12日	18.10	8,200	148,970.54	145,960.00	-
300173	智慧松德	2016年4月11日	重大事项停牌	16.25	-	-	8,900	141,618.00	144,625.00	-	
002389	南洋科技	2016年2月3日	重大事项停牌	12.95	-	-	11,100	184,856.49	143,745.00	-	
600634	中技控股	2016年6月22日	重大事项停牌	14.41	-	-	9,900	221,476.99	142,659.00	-	
002387	黑牛食品	2016年5月25日	重大事项停牌	16.26	-	-	8,600	149,159.49	139,836.00	-	

600035	楚天高速	2016年4月11日	重大事项停牌	5.06	-	-	27,500	138,875.50	139,150.00	-
002447	壹桥海参	2016年3月9日	重大事项停牌	7.19	-	-	19,100	215,644.77	137,329.00	-
300353	东土科技	2016年6月23日	重大事项停牌	22.09	-	-	6,200	134,099.88	136,958.00	-
002349	精华制药	2016年1月4日	重大事项停牌	25.73	2016年7月18日	23.16	5,250	111,880.00	135,082.50	-
600877	中国嘉陵	2016年3月3日	重大事项停牌	7.38	-	-	18,200	167,219.70	134,316.00	-
300111	向日葵	2016年6月14日	重大事项停牌	4.90	-	-	27,400	156,750.40	134,260.00	-
002289	*ST宇顺	2016年4月29日	重大事项停牌	26.04	-	-	5,100	147,186.56	132,804.00	-
600173	卧龙地产	2016年4月25日	重大事项停牌	8.28	-	-	15,700	138,035.01	129,996.00	-
600209	罗顿发展	2016年2月24日	重大事项停牌	11.13	-	-	11,600	108,678.88	129,108.00	-
600318	新力金融	2016年3月24日	重大事项停牌	26.84	-	-	4,800	129,569.38	128,832.00	-
002631	德尔未来	2016年6月29日	重大事项停牌	26.60	-	-	4,800	140,288.11	127,680.00	-
002567	唐人神	2016年5月16日	重大事项停牌	13.98	-	-	9,100	125,046.68	127,218.00	-
000407	胜利股份	2016年5月23日	重大事项停牌	6.73	-	-	18,700	151,479.65	125,851.00	-
600321	国栋建设	2016年5月6日	重大事项停牌	4.02	-	-	31,200	200,102.30	125,424.00	-
002207	准油股份	2015年12月	重大事项	21.42	-	-	5,800	149,519.63	124,236.00	-

		16日	停牌							
000537	广宇发展	2016年4月13日	重大事项停牌	8.01	2016年7月20日	8.81	15,500	131,448.35	124,155.00	-
300356	光一科技	2016年5月26日	重大事项停牌	48.44	-	-	2,400	115,003.07	116,256.00	-
000409	山东地矿	2016年3月14日	重大事项停牌	10.19	-	-	11,007	137,899.90	112,161.33	-
000757	浩物股份	2016年3月29日	重大事项停牌	10.56	-	-	10,600	127,672.14	111,936.00	-
000936	华西股份	2016年5月24日	重大事项停牌	8.22	2016年7月13日	9.04	13,500	163,242.68	110,970.00	-
300323	华灿光电	2016年4月18日	重大事项停牌	8.99	-	-	12,200	93,426.85	109,678.00	-
002452	长高集团	2016年6月14日	重大事项停牌	12.02	2016年7月12日	10.82	9,000	94,241.13	108,180.00	-
002712	思美传媒	2016年4月11日	重大事项停牌	35.76	2016年8月17日	41.82	3,000	79,146.41	107,280.00	-
002297	博云新材	2016年6月20日	重大事项停牌	13.09	-	-	8,100	108,168.21	106,029.00	-
300223	北京君正	2016年6月3日	重大事项停牌	44.00	-	-	2,400	65,661.02	105,600.00	-
300044	赛为智能	2016年5月12日	重大事项停牌	12.97	-	-	8,100	153,421.80	105,057.00	-
002071	长城影视	2016年6月16日	重大事项停牌	13.64	-	-	7,700	138,357.27	105,028.00	-
600237	铜峰电子	2016年6月30日	重大事项停牌	7.61	2016年7月7日	7.42	13,600	137,835.49	103,496.00	-
300080	易成新能	2016年5月19日	重大事项停牌	7.76	-	-	13,300	115,444.42	103,208.00	-
600986	科达	2016年	重大	15.98	2016年	17.58	6,400	131,025.34	102,272.00	-

	股份	6月27日	事项停牌		7月18日						
002432	九安医疗	2016年6月20日	重大事项停牌	18.14	2016年7月13日	19.95	5,500	138,499.89	99,770.00	-	
002212	南洋股份	2016年5月3日	重大事项停牌	11.28	2016年8月17日	12.41	8,800	92,726.26	99,264.00	-	
000553	沙隆达A	2015年8月5日	重大事项停牌	10.68	-	-	9,100	100,791.00	97,188.00	-	
300355	蒙草抗旱	2016年6月30日	重大事项停牌	7.11	2016年7月6日	7.38	13,500	127,158.02	95,985.00	-	
002246	北化股份	2015年11月23日	重大事项停牌	14.10	-	-	6,800	86,250.01	95,880.00	-	
000159	国际实业	2016年2月23日	重大事项停牌	7.63	-	-	12,500	100,258.87	95,375.00	-	
300298	三诺生物	2016年3月21日	重大事项停牌	20.96	-	-	4,550	118,257.00	95,368.00	-	
600843	上工申贝	2016年2月18日	重大事项停牌	13.71	2016年7月26日	15.08	6,900	104,091.41	94,599.00	-	
002012	凯恩股份	2016年1月19日	重大事项停牌	8.71	2016年7月18日	8.80	10,800	96,200.71	94,068.00	-	
002611	东方精工	2016年3月29日	重大事项停牌	10.84	2016年8月18日	11.92	8,500	130,089.43	92,140.00	-	
300351	永贵电器	2016年6月29日	重大事项停牌	33.93	2016年7月4日	33.30	2,600	92,995.27	88,218.00	-	
000571	新大洲A	2016年1月18日	重大事项停牌	5.71	2016年7月19日	6.28	15,000	144,090.82	85,650.00	-	
002574	明牌珠宝	2016年6月27日	重大事项停牌	13.04	-	-	6,500	73,825.56	84,760.00	-	
002274	华昌化工	2016年6月12日	重大事项停牌	10.50	2016年7月7日	10.65	8,000	94,460.55	84,000.00	-	



300052	中青宝	2016年 6月8日	重大事项 停牌	22.03	-	-	3,800	123,810.96	83,714.00	-
002313	日海通讯	2016年 6月20日	重大事项 停牌	13.59	2016年 7月4日	14.95	6,100	86,484.24	82,899.00	-
000948	南天信息	2016年 6月28日	重大事项 停牌	19.31	2016年 7月12日	21.00	4,200	123,565.13	81,102.00	-
300451	创业软件	2016年 5月30日	重大事项 停牌	44.41	-	-	1,800	109,189.06	79,938.00	-
603808	歌力思	2016年 4月20日	重大事项 停牌	29.13	2016年 7月20日	31.50	2,700	81,509.03	78,651.00	-
600113	浙江东日	2016年 3月25日	重大事项 停牌	12.05	2016年 7月25日	13.24	6,300	87,290.29	75,915.00	-
300334	津膜科技	2016年 5月20日	重大事项 停牌	18.05	-	-	4,200	89,123.87	75,810.00	-
300246	宝莱特	2016年 6月27日	重大事项 停牌	30.31	2016年 7月1日	32.20	2,500	73,348.01	75,775.00	-
600475	华光股份	2016年 5月18日	重大事项 停牌	14.85	-	-	5,100	79,861.79	75,735.00	-
300110	华仁药业	2016年 1月27日	重大事项 停牌	9.53	2016年 7月12日	10.48	7,700	166,165.17	73,381.00	-
600738	兰州民百	2016年 3月23日	重大事项 停牌	8.49	2016年 7月11日	9.34	8,600	77,105.90	73,014.00	-
002046	轴研科技	2016年 5月9日	重大事项 停牌	10.33	2016年 8月22日	11.36	7,000	73,969.19	72,310.00	-
300413	快乐购	2016年 6月20日	重大事项 停牌	24.35	-	-	2,900	96,485.27	70,615.00	-
000968	*ST煤气	2015年 12月24日	重大事项 停牌	8.71	2016年 7月7日	9.06	8,000	60,665.11	69,680.00	-
000018	神州长城	2016年 6月24日	重大事项	12.17	2016年 7月11日	12.88	5,300	60,456.83	64,501.00	-

		日	停牌		日					
000498	山东路桥	2016年6月20日	重大事项停牌	5.76	2016年7月4日	6.11	11,000	75,680.33	63,360.00	-
000551	创元科技	2016年6月7日	重大事项停牌	9.18	2016年7月7日	10.10	6,800	78,643.19	62,424.00	-
000546	金圆股份	2016年6月16日	重大事项停牌	10.54	2016年7月12日	10.95	5,900	58,533.36	62,186.00	-
002379	*ST鲁丰	2016年5月16日	重大事项停牌	3.83	2016年8月16日	4.02	15,400	92,970.02	58,982.00	-
300227	光韵达	2016年6月20日	重大事项停牌	23.79	-	-	2,400	73,991.09	57,096.00	-
603398	邦宝益智	2016年6月28日	重大事项停牌	36.94	2016年7月8日	39.00	1,500	61,735.00	55,410.00	-
000916	华北高速	2016年6月24日	重大事项停牌	5.01	-	-	10,700	59,584.37	53,607.00	-
002713	东易日盛	2016年6月29日	重大事项停牌	29.03	2016年7月20日	31.93	1,800	47,887.68	52,254.00	-
600121	郑州煤电	2016年6月17日	重大事项停牌	4.80	2016年7月1日	5.05	9,900	68,711.10	47,520.00	-
300292	吴通控股	2016年1月25日	重大事项停牌	33.26	2016年7月20日	36.48	400	18,753.38	13,304.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 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。

#### 6.4.9.3.2 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。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 101,914,553.89 元，属于第二层次的余额为 12,619,641.27 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 157,055,834.94 元，第二层次 13,231,743.35 元，无第三层次）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	114,534,195.16	93.50
	其中：股票	114,534,195.16	93.50
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,877,263.21	6.43
7	其他各项资产	88,717.15	0.07
8	合计	122,500,175.52	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,022,058.50	0.84
B	采矿业	1,873,416.33	1.55
C	制造业	75,381,516.41	62.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,020,272.00	2.50
E	建筑业	2,613,834.00	2.16
F	批发和零售业	4,373,936.60	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,372,901.50	2.79
H	住宿和餐饮业	128,847.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,212,568.88	8.44

J	金融业	78,280.00	0.06
K	房地产业	4,822,160.30	3.99
L	租赁和商务服务业	1,052,101.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	1,034,635.90	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	718,723.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	89,792.00	0.07
Q	卫生和社会工作	346,784.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,583,882.00	1.31
S	综合	1,165,833.74	0.96
	合计	112,891,543.16	93.33

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	193,916.00	0.16
C	制造业	936,265.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	512,471.00	0.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,642,652.00	1.36

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	002407	多氟多	12,108	515,679.72	0.43
2	002176	江特电机	24,920	383,768.00	0.32
3	002460	赣锋锂业	11,000	367,950.00	0.30
4	300142	沃森生物	32,800	366,048.00	0.30
5	300136	信维通信	16,220	339,971.20	0.28
6	300383	光环新网	8,800	333,520.00	0.28
7	300159	新研股份	18,100	326,705.00	0.27
8	002070	众和股份	12,400	313,100.00	0.26
9	300156	神雾环保	14,650	301,497.00	0.25
10	300296	利亚德	9,200	291,272.00	0.24

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

#### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	000806	银河生物	20,200	392,688.00	0.32
2	002555	三七互娱	13,800	295,458.00	0.24
3	300166	东方国信	7,900	217,013.00	0.18
4	002289	*ST 宇顺	5,100	132,804.00	0.11
5	002207	准油股份	5,800	124,236.00	0.10

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

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300383	光环新网	276,221.00	0.15
2	000048	康达尔	272,419.00	0.15
3	002176	江特电机	267,821.00	0.15
4	300496	中科创达	262,186.00	0.15
5	300324	旋极信息	256,899.00	0.14
6	000520	长航凤凰	252,475.00	0.14
7	002407	多氟多	251,101.00	0.14
8	600868	梅雁吉祥	248,189.00	0.14
9	600110	诺德股份	238,433.00	0.13
10	002343	慈文传媒	237,770.52	0.13
11	002517	恺英网络	228,788.00	0.13
12	300028	金亚科技	216,970.00	0.12
13	002426	胜利精密	213,501.00	0.12
14	000627	天茂集团	213,266.00	0.12
15	300266	兴源环境	211,711.50	0.12
16	002070	众和股份	207,585.00	0.12
17	300113	顺网科技	207,512.00	0.12
18	002544	杰赛科技	206,598.00	0.11
19	300159	新研股份	204,109.50	0.11
20	300136	信维通信	202,604.00	0.11

注：买入金额不包括相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300113	顺网科技	731,434.40	0.41
2	600682	南京新百	700,394.00	0.39
3	002426	胜利精密	675,230.80	0.37
4	002572	索菲亚	651,603.00	0.36
5	600666	奥瑞德	516,788.00	0.29

6	002131	利欧股份	483,478.00	0.27
7	600687	刚泰控股	467,244.60	0.26
8	002075	沙钢股份	464,212.60	0.26
9	600565	迪马股份	452,784.88	0.25
10	000008	神州高铁	452,374.00	0.25
11	002268	卫士通	443,787.20	0.25
12	002074	国轩高科	436,313.04	0.24
13	300287	飞利信	427,213.00	0.24
14	002366	台海核电	421,798.73	0.23
15	300001	特锐德	420,053.50	0.23
16	002407	多氟多	416,896.00	0.23
17	002589	瑞康医药	391,129.93	0.22
18	300010	立思辰	380,646.60	0.21
19	002512	达华智能	359,461.78	0.20
20	002002	鸿达兴业	329,301.00	0.18

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。



## **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金未投资股指期货。

### **7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未投资股指期货。

## **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金未投资国债期货。

### **7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金未投资国债期货。

## **7.12 投资组合报告附注**

### **7.12.1**

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

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

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

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

规和公司制度的要求。

本报告期内，本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300142	沃森生物	366,048.00	0.30	重大事项停牌

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

1	000806	银河生物	392,688.00	0.32	重大事项停牌
2	002555	三七互娱	295,458.00	0.24	重大事项停牌
3	300166	东方国信	217,013.00	0.18	重大事项停牌
4	002289	*ST 宇顺	132,804.00	0.11	重大事项停牌
5	002207	准油股份	124,236.00	0.10	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1000A	122	112,902.93	12,008,600.00	87.18%	1,765,557.00	12.82%
1000B	589	23,385.67	643,250.00	4.67%	13,130,907.00	95.33%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	4,363	26,457.78	744,671.96	0.65%	114,690,609.51	99.35%
合计	5,074	28,179.66	13,396,521.96	9.37%	129,587,073.51	90.63%

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

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	5,969,246.00	43.34%
2	上海明法投资管理有限公司—明法多策略对冲 1 号基金	5,834,154.00	42.36%
3	陈杰	993,024.00	7.21%
4	上海明法投资管理有限公司—明法 CTA 一号基金	80,000.00	0.58%
5	平安养老保险股份有限公司—平安养老睿富优选 FOF 资产管理产	69,100.00	0.50%
6	孙庆华	60,000.00	0.44%

7	黄维嘉	60,000.00	0.44%
8	郑志坤	49,800.00	0.36%
9	陈敏	40,000.00	0.29%
10	上海千象资产管理有限公司-千象子基金2号	36,000.00	0.26%

1000B

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝兴业中证1000指数分级	37,957.29	0.0329%
	合计	37,957.29	0.0265%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝兴业中证1000指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0

	华宝兴业中证 1000 指数分级	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日） 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	-	-	86,854,771.20
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	117,838,651.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	6,008,956.00	6,008,956.00	-12,017,912.00
本报告期末基金份额总额	13,774,157.00	13,774,157.00	115,435,281.47

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内，基金管理人未有受到稽查或处罚的情况。
- 2、本报告期内，基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。
- 3、本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	42,510,648.40	21.95%	39,591.38	21.97%	-
平安证券	1	41,021,721.37	21.18%	38,203.76	21.20%	-
申万宏源	3	36,433,687.51	18.81%	33,930.84	18.83%	-
华宝证券	1	19,239,406.83	9.93%	17,918.89	9.94%	-
安信证券	1	16,008,090.43	8.26%	14,908.99	8.27%	-
国信证券	1	13,093,551.15	6.76%	12,193.90	6.77%	-
东北证券	1	5,656,098.68	2.92%	5,267.67	2.92%	-
中泰证券	2	5,224,482.49	2.70%	4,761.10	2.64%	-
东兴证券	1	3,676,506.59	1.90%	3,350.40	1.86%	-
华泰证券	1	3,328,476.71	1.72%	3,099.76	1.72%	-
中银国际	1	3,198,781.26	1.65%	2,978.88	1.65%	-
长江证券	1	2,142,850.11	1.11%	1,995.83	1.11%	-
国泰君安	2	1,044,988.61	0.54%	952.37	0.53%	-
方正证券	2	826,048.00	0.43%	769.58	0.43%	-
银河证券	1	288,240.42	0.15%	268.45	0.15%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元无变化。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-



国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司  
2016年8月26日