

# 华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式 指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华宝兴业中证全指证券公司 ETF   |
| 场内简称       | 券商 ETF   |
| 基金主代码      | 512000   |
| 交易代码       | 512000   |
| 基金运作方式     | 交易型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016 年 8 月 30 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 155,717,683.00 份   |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。   |
| 投资策略       | <p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>1、组合复制策略<br/>本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>2、替代性策略<br/>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p> <p>3、债券投资策略<br/>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>基金资产的投资收益。</p> <p>4、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p>本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全指证券公司指数  |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>   |
| 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  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2016年10月1日—2016年12月31日） |
|-----------------|-----------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 11,304,888.24               |
| 2. 本期利润         | 9,506,012.51                |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0506                      |
| 4. 期末基金资产净值     | 151,053,234.69              |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9700                      |

注：1. 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。

2. 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。

### 3.2 基金净值表现

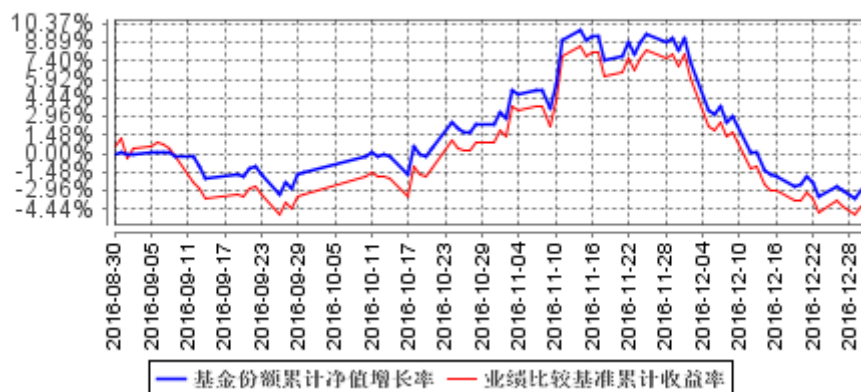
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.45%     | 1.15%         | -0.95%         | 1.18%                 | -0.50% | -0.03% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

(2016 年 8 月 30 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：1、本基金基金合同生效于 2016 年 8 月 30 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。  
2、按照基金合同的约定，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，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                    | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 丰晨成 | 本基金基金经理、华宝兴业上证 180 | 2016 年 8 月 30 日 | -    | 7 年    | 硕士。2009 年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任助理产品经理，数量分析师，投资经理助理，投资经 |

|  |   |  |  |  |
|--|---|--|--|--|
|  | 价值 ETF、<br>华宝兴业<br>上证 180<br>价值 ETF<br>联接基金<br>经理 |  |  | 理等职务。2015 年 11 月任<br>华宝兴业上证 180 价值交易<br>型开放式指数证券投资基金<br>、华宝兴业上证 180 价值<br>交易型开放式指数证券投资<br>基金联接基金基金经理。<br>2016 年 8 月兼任华宝兴业<br>中证全指证券公司交易型<br>开放式指数证券投资基金<br>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、《华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数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。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年四季度，券商股在 10、11 月的市场上涨过程中，伴随着市场转暖成交活跃，券商股上涨势头凌厉，在 12 月份伴随着市场的调整，成交量萎缩，券商股下跌明显，整体上看券商股与市场冷暖的相关性较高，走势弹性较大。

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，在指数权重调整和基金申赎变动时，降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内本基金份额净值增长率为-1.45%，同期业绩比较基准收益率为-0.95%，基金表现落后业绩比较基准 0.50%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 149,516,725.04 | 98.16        |
|    | 其中：股票             | 149,516,725.04 | 98.16        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,084,984.44   | 1.37         |
| 8  | 其他资产              | 721,532.09     | 0.47         |
| 9  | 合计                | 152,323,241.57 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | -              | -            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | 149,341,554.66 | 98.87        |
| 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               | 149,341,554.66 | 98.87        |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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              | -         | -            |
| C  | 制造业              | 97,353.53 | 0.06         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -         | -            |
| E  | 建筑业              | 15,592.23 | 0.01         |
| F  | 批发和零售业           | -         | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 7,564.62  | 0.01         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -         | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -         | -            |
| J  | 金融业              | 54,480.00 | 0.04         |
| 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            | 174,990.38 | 0.12 |

### 5.2.3 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。

## 5.3 报告期末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

### 5.3.1 报告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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600837 | 海通证券 | 1,196,700 | 18,848,025.00 | 12.48        |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 1,168,500 | 18,766,110.00 | 12.42        |
| 3  | 601211 | 国泰君安 | 665,938   | 12,379,787.42 | 8.20         |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 488,483   | 8,724,306.38  | 5.78         |
| 5  | 000776 | 广发证券 | 443,300   | 7,474,038.00  | 4.95         |
| 6  | 600958 | 东方证券 | 451,500   | 7,011,795.00  | 4.64         |
| 7  | 002736 | 国信证券 | 369,900   | 5,751,945.00  | 3.81         |
| 8  | 600999 | 招商证券 | 334,492   | 5,462,254.36  | 3.62         |
| 9  | 601377 | 兴业证券 | 702,400   | 5,373,360.00  | 3.56         |
| 10 | 601099 | 太平洋  | 1,026,400 | 5,285,960.00  | 3.50         |

### 5.3.2 报告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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|-----------|--------------|
| 1  | 601375 | 中原证券 | 13,620 | 54,480.00 | 0.04         |
| 2  | 603218 | 日月股份 | 1,196  | 49,813.40 | 0.03         |
| 3  | 603929 | 亚翔集成 | 2,193  | 15,592.23 | 0.01         |
| 4  | 002838 | 道恩股份 | 681    | 10,405.68 | 0.01         |



|   |        |      |     |           |      |
|---|--------|------|-----|-----------|------|
| 5 | 603035 | 常熟汽饰 | 992 | 10,356.48 | 0.01 |
|---|--------|------|-----|-----------|------|

#### 5.4 报告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投资。

#### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 5.6 报告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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日前十名证券中的海通证券（600837）于 2016 年 11 月 25 日收到中国证监会处罚决定。因公司未按照有关规定对客户的信息进行审查和了解，对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得约 2,865 万元，并处以约 8,595 万元罚款。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日前十名证券中的中信证券（600030）于 2016 年 3 月 16 日收到中国证券监督管理委员会福建监管局《关于对中信证券股份有限公司泉州宝洲路证券营业部采取出具警示函措施的决定》，因公司营业部存在员工违规为客户融资提供便利的问题，决定对营业部采取出具警示函的监督管理措施。

中信证券（600030）于 2016 年 8 月 23 日收到全国中小企业股份转让系统《关于对中信证券股份有限公司采取出具责令改正自律监管措施的决定》。在投资者适当性管理过程中，未依据委托代理协议签署日前一交易日日终的投资者名下证券类资产市值判断适当性，而是错误根据投资者临拒办理业务权限开通手续时点的实时资产市值，为 506 户不符合要求的投资者账户开通全国股转系统合格投资者权限，违反了《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理细则（试行）》第五条关于自然人投资者证券类资产市值计算时点要求的规定。决定对公司采取责令改正的自律监管措施。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211）于 2016 年 1 月 29 日收到全国中小企业股份转让系统公开谴责。因国泰君安以明显低于最近成交价的价格进行卖出申报，造成做市股票尾盘价格大幅波动，严重影响多只股票的正常转让价格，扰乱了正常市场秩序，决定给予国泰君安证券股份有限公司公开谴责。

国泰君安（601211）于 2016 年 2 月 16 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施事先告知书》（沪证监机构字[2016]22 号）。因其场外市场部做市业务部门的绩效考核体系、内部管理与控制方面等存在重大缺陷，导致 2015 年 12 月 31 日做市股票发生一系列报价异常事件，造成恶劣的市场影响。决定限制其新增做市业务三个月，并责令其在规定时间内，每 3 个月对做市业务部门开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海监管局书面报送合规检查报告。并于 2016 年 2 月 26 日，收到上海监管局《关

于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》（沪证监决[2016]15号）。

国泰君安（601211）于 2016 年 6 月 29 日收到中国证监会北京监管局警告。因其作为受托管理人，未能及时发现和制止违规的转借行为，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条和第五十条第二款的规定，决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

国泰君安（601211）于 2016 年 7 月 26 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局整改通知。因其作为国泰君安新利 6 号集合资产管理计划的资产管理人，投资决策和交易执行环节控制存在不足，发生相关异常交易。公司未能切实履行勤勉尽责的管理人义务，未能采取有效措施防范利益冲突，责令公司增加内部合规检查次数，并及时提交合规检查报告。

国泰君安（601211）于 2016 年 8 月 26 日收到中国证券监督管理委员会整改通知。因其内核机构履职的独立性存在缺陷，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》。并且在推荐企业进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。拟责令公司改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告。

国泰君安（601211）于 2016 年 8 月 26 日收到中国证监会警告。因国泰君安在保荐金徽酒首发项目过程中，向中国证监会提交的会后事项承诺函中未如实说明发行人 2015 年利润分配情况，对发行人实施分红事项，未主动向我会履行告知义务，对国泰君安采取了出具警示函的行政监管措施。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的华泰证券（601688）于 2016 年 8 月 23 日收到全国股转公司警示函。因公司在投资者适当性管理过程中存在违规事实，决定对公司采取出具警示函、责令改正的自律监管措施。

华泰证券（601688）于 2016 年 11 月 25 日收到中国证监会处罚决定。因公司未按照有关规定对客户的信息进行审查和了解，对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得约 1,823 万元，并处以约 5,470 万元罚款。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的广发证券（000776）于 2016 年 11 月 24 日收到中国证券监督管理委员会辽宁监管局整改通知。因公司营口学府路证券营业部在代销宝盈新动力 3、7、15 号产品过程中，未能全面、公正、准确地介绍金融产品有关信息，充分说明金融产品的主要风险特征，未能保证金融产品营销人员充分了解所负责推介金融产品的信息，营业部在产品销售过程中的风险揭示不到位，对广发证券股份有限公司营口学府路证券营业部采取责令改正的措施。

广发证券（000776）于 2016 年 11 月 24 日收到中国证监会处罚决定。因公司在未采集上述客户身份识别信息的情况下，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的国信证券（002736）于 2016 年 1 月 9 日收到江苏证监局责令改正措施的决定。因国信证券无锡梁溪路证券营业部个别客户在付款购买金融产品前未签署风险揭示书，个别客户在购买金融产品时，其风险承受能力与产品风险等级不匹配，营业部未按规定与客户签署《金融产品或金融服务不适当警示及客户投资确认书》的问题，责令营业部予以改正。

国信证券（002736）于 2016 年 3 月 29 日收到江苏证监局警告。因营业部在开展代销金融产品业务中，合同签署时没有向个别客户出示相关备查文件，对营业部采取出具警示函的监管措施。

国信证券（002736）于 2016 年 3 月 30 日收到全国中小企业股份转让系统警告。主办券商未严格执行全国股转系统投资者适当性管理的各项要求，未正确履行合格投资者报送义务，构成违规。

国信证券（002736）于 2016 年 4 月 27 日收到中国证券监督管理委员会北京监管局整改通知。因国信证券股份有限公司北京北苑路证券营业部在未申请换发经营证券业务许可证的情况下迁址并更名。但未及时申请变更。决定责令公司增加内部合规检查次数，在 2016 年 5 月 1 日至 2017 年 4 月 30 日期间，每 3 个月对分公司管理的营业部同城迁址、名称变更以及换发证照等相关业务增加一次内部合规检查。

国信证券（002736）于 2016 年 5 月 23 日收到中国证券监督管理委员会天津监管局整改通知。

因营业部个别客户在付款购买金融产品前未签署风险揭示书，个别客户在购买金融产品时，其风险承受能力与产品风险等级不匹配，营业部未按规定与客户签署《金融产品适当性评估告知及客户投资确认书》，责令营业部予以改正。

国信证券（002736）于 2016 年 6 月 14 日收到湖北证监局整改通知。因营业部存在未妥善保存员工通过 95536 客服坐席呼出电话的通话录音，且在经营管理过程中长时间未发现；营业部员工信息公示不规范；负责人年度考核不全面；客户投资者适当性评估资料不完整等问题。责令营业部在 2016 年 6 月 20 日至 2017 年 6 月 19 日期间，每三个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后十个工作日内，报送合规检查报告。

国信证券（002736）于 2016 年 11 月 8 日收到深圳证监局整改通知。因天津、江苏、青岛等地营业部在开展代销金融产品业务中，个别客户在付款购买金融产品前未签署风险揭示书，个别客户在购买金融产品时，其风险承受能力与产品风险等级不匹配，营业部未按规定与客户签署《金融产品适当性评估告知及客户投资确认书》，合同签署时没有向个别客户出示相关备查文件等问题。对公司采取责令改正的监管措施。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的招商证券（600999）于 2016 年 1 月 9 日收到中国证监会广西监管局整改通知。因招商证券股份有限公司南宁民族大道证券营业部存在未实施回访、审查等有效了解客户身份的程序，且在发现客户将本人的信用证券账户提供给他人使用后，未按照证券登记结算机构的业务规则处理，也未及时向证券登记结算机构和证券交易所报告的情况。责令营业部对上述问题予以改正。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的兴业证券（601377）于 2016 年 2 月 20 日收到中国证券监督管理委员会福建监管局整改通知。因公司融资融券强制平仓操作出现差错，导致客户信用账户股票的实际强制平仓数量远超过应当平仓数量；7 月 8 日，公司未经客户同意直接在客户信用账户进行买回操作。责令公司在 2016 年 3 月 1 日至 2017 年 2 月 28 日期间，每 3 个月对融资融券业务进行一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，报送合规检查报告。

兴业证券（601377）于 2016 年 6 月 13 日收到中国证券监督管理委员会立案调查。因公司涉嫌

未按规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。于 2016 年 7 月 9 日收到中国证监会处罚决定，对公司给予警告，没收保荐业务收入 1,200 万元，并处以 2,400 万元罚款；没收承销股票违法所得 2,078 万元，并处以 60 万元罚款。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证全指证券公司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两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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 166,091.00 |
| 2  | 应收证券清算款 | 554,694.00 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 747.09     |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 721,532.09 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 601375 | 中原证券 | 54,480.00      | 0.04         | 新股锁定     |

|   |        |      |           |      |      |
|---|--------|------|-----------|------|------|
| 2 | 002838 | 道恩股份 | 10,405.68 | 0.01 | 新股锁定 |
| 3 | 603035 | 常熟汽饰 | 10,356.48 | 0.01 | 新股锁定 |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 398,117,683.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 165,300,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 407,700,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 155,717,683.00 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
 华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
 华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
 华宝兴业中证全指证券公司交易型开放式指数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。

## 8.2 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。

## 8.3 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 1 月 19 日