

# 华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2016 年 8 月 5 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51

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	51
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	51
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
8.12	投资组合报告附注	52
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>53</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2	期末上市基金前十名持有人	53
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>54</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>54</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	54
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	55
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4	基金投资策略的改变	55
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8	其他重大事件	57
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>59</b>
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝兴业中证军工 ETF
场内简称	军工行业
基金主代码	512810
交易代码	512810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 5 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	205,791,727.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 8 月 22 日

### 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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p>

	<p>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	中证军工指数
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，跟踪中证军工指数，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>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑安国	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
----------------	-------------------------------

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年8月5日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-10,847,878.72
本期利润	-23,678,461.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0746
本期加权平均净值利润率	-7.69%
本期基金份额净值增长率	-7.33%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	-15,075,355.61
期末可供分配基金份额利润	-0.0733
期末基金资产净值	190,716,371.39
期末基金份额净值	0.9267
3.1.3 累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	-7.33%

注：(1) 本基金合同生效日为2016年8月5日，至披露时点不满一年。

(2) 所述基金财务指标不包括持有人认购和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) 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) 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）。

(5) 期末可供分配利润采用期末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	-1.47%	0.94%	-1.28%	0.95%	-0.19%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-7.33%	0.90%	-3.44%	1.03%	-3.89%	-0.13%

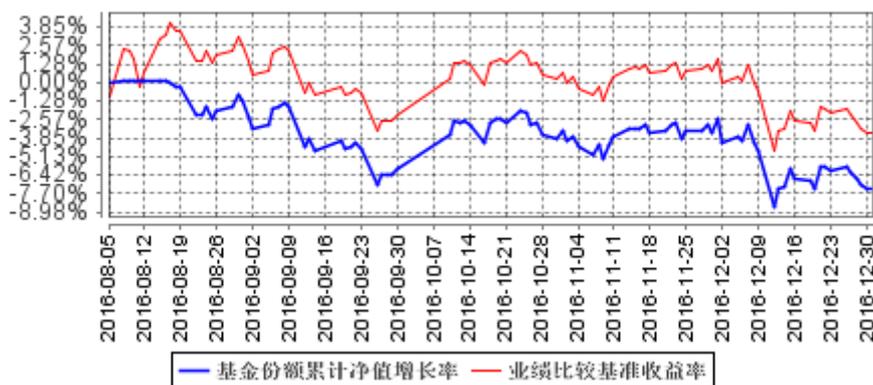
注：1、本基金业绩比较基准为：中证军工指数。

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

(2016年8月5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

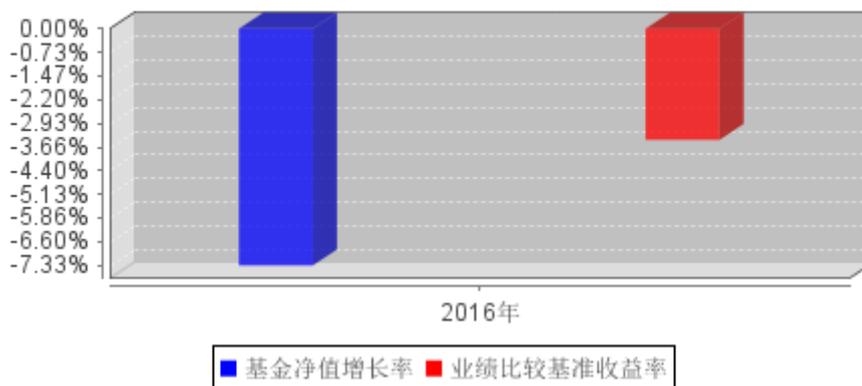


注：1、本基金基金合同生效于2016年8月5日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

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。

### 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2016年8月5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

本基金自合同生效日（2016年8月5日）至报告期末未进行利润分配。

## § 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、华宝兴业上证 180 成长 ETF、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、华宝兴业中证医疗指数分级、华宝兴业中证 1000 指数分级基金经理	2016 年 8 月 5 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、产品开发和量化投资部工作，2012 年 10 月起任华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 8 月起兼任华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业中证军工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 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,中证军工指数下跌了 23.81%。

本基金成立于 2016 年 8 月 5 日,本报告期涵盖了基金的建仓期。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 0.9267 元,本报告期基金份额净值增长率为-7.33%,同期业绩比较基准收益率为-3.44%。

## 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。行业方面，预计 2017 年改革和成长将成为军工板块的主旋律，国防需求升级、国企改革持续推进、军工信息化战略发展、科研院所改制及军民融合战略持续推进等因素将对军工板块形成中长期利好。2016 年底中央经济工作会议把军工列入七大重点混改行业，未来军工行业国企改革进度有望加快。作为军改重要方向，2017 年军民融合改革在政策助推下将进入快车道，政府将大力推进军转民和民参军的进程，加速国防军工领域体制和机构变革，给军工板块带来中长期的巨大投资机会。中证军工指数选取了由十大军工集团控股且主营业务与军工产业相关的上市公司股票以及业务范围涵盖军工领域的其他上市公司股票组成指数样本，能够反映军工主题股票整体走势，建议投资者密切关注中证军工指数带来的投资机会。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分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，实现对中证军工指数的有效跟踪。

#### 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 & 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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20041 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华宝兴业中证军工 ETF 基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 8 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华宝兴业中证军工 ETF 基金 的基金

	<p>管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述华宝兴业中证军工 ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华宝兴业中证军工 ETF 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 8 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞   曹阳
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 邮政编码 200120
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	3,021,821.08
结算备付金		63,365.53
存出保证金		151,331.78
交易性金融资产	7.4.7.2	188,158,463.20
其中：股票投资		188,158,463.20
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	990.69
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		191,395,972.28
<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>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		81,110.59
应付赎回款		-
应付管理人报酬		85,383.49
应付托管费		17,076.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	292,030.12
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	204,000.00
负债合计		679,600.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	205,791,727.00
未分配利润	7.4.7.10	-15,075,355.61
所有者权益合计		190,716,371.39
负债和所有者权益总计		191,395,972.28

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值0.9267元，基金份额总额205,791,727.00份。

2、本会计期间为2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
<b>一、收入</b>		-21,696,894.86
1.利息收入		451,937.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	101,774.62
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		350,162.44
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-9,103,007.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,103,007.31
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-12,830,583.17
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-215,241.44

列)		
<b>减：二、费用</b>		1,981,567.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	622,517.77
2. 托管费	7.4.10.2.2	124,503.58
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	947,887.18
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	286,658.50
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-23,678,461.89
减：所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-23,678,461.89

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月5日(基金合同生效日)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)	544,791,727.00	-	544,791,727.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,678,461.89	-23,678,461.89
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)	-339,000,000.00	8,603,106.28	-330,396,893.72
其中：1.基金申购款	33,000,000.00	-1,350,157.00	31,649,843.00
2.基金赎回款	-372,000,000.00	9,953,263.28	-362,046,736.72
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)	205,791,727.00	-15,075,355.61	190,716,371.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄小慧</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金(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[2016]1154号《关于准予华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准,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《华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集544,791,727.00元(含募集股票市值),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(2016)第981号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2016年8月5日生效,基金合同生效日的基金份额总额544,791,727.00份基金份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]211号核准,本基金于2016年8月22日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于中证军工指数成份股和备选成份股,也可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证军工指数。

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》、《华宝兴业中证军工交易型开放式指数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 8 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 8 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 8 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 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、买入返售金融资产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。

#### 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**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **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**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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) 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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,021,821.08
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,021,821.08

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	200,989,046.37	188,158,463.20	-12,830,583.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	200,989,046.37	188,158,463.20	-12,830,583.17

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	877.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	38.71
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	74.91
合计	990.69

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	292,030.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	292,030.12

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	154,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	204,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	544,791,727.00	544,791,727.00
本期申购	33,000,000.00	33,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-372,000,000.00	-372,000,000.00
本期末	205,791,727.00	205,791,727.00

注：

1. 本基金自2016年7月11日起至2016年8月1日止期间公开发售，共募集有效净认购资金544,791,727.00元。根据《华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内无因认购资金产生的利息收入而折算的基金份额。
2. 根据《华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年8月21日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2016年8月22日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-10,847,878.72	-12,830,583.17	-23,678,461.89
本期基金份额交易产生的变动数	3,507,859.98	5,095,246.30	8,603,106.28
其中：基金申购款	-703,167.10	-646,989.90	-1,350,157.00
基金赎回款	4,211,027.08	5,742,236.20	9,953,263.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,340,018.74	-7,735,336.87	-15,075,355.61

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	77,648.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,375.19
其他	750.92
合计	101,774.62

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,131,147.09
股票投资收益——赎回差价收入	-3,971,860.22
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-9,103,007.31

**7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	192,286,953.37
减：卖出股票成本总额	197,418,100.46
买卖股票差价收入	-5,131,147.09

**7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
赎回基金份额对价总额	362,046,736.72
减：现金支付赎回款总额	191,982,637.72
减：赎回股票成本总额	174,035,959.22
赎回差价收入	-3,971,860.22

### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年8月5日(基金合同生效日)至2016 年12月31日
1. 交易性金融资产	-12,830,583.17
——股票投资	-12,830,583.17
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-12,830,583.17

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12

	月 31 日
基金赎回费收入	-
其他	131,555.03
替代损益	-346,796.47
合计	-215,241.44

注：

1. 替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。
2. 其他为本基金网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	947,887.18
银行间市场交易费用	-
合计	947,887.18

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	54,000.00
信息披露费	100,000.00
银行汇划费	1,280.24
上市费	50,000.00
其他	400.00
指数使用费	80,978.26
合计	286,658.50

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等

增值税政策的通知》(财税[2016]140号),要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,自2016年5月1日起执行。

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

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“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
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司(“宝钢财务”)	受宝武集团控制的公司

注:

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

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	622,517.77
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.50%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 X 0.50% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	124,503.58

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 0.10%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 X 0.10% / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

## 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年8月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,021,821.08	77,648.51

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

## 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

## 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	26,695	106,780.00	106,780.00	
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	
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	2,862	60,960.60	60,960.60	
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	
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	1,985	20,723.40	20,723.40	

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	1,438	20,290.18	20,290.18	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	831	19,245.96	19,245.96	-
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	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
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	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000748	长城信息	2016年11月1日	重大资产重组	20.31	-	-	261,306	5,608,251.52	5,307,124.86	-
600151	航天机电	2016年11月11日	重大资产重组	10.97	-	-	340,400	3,883,944.92	3,734,188.00	-

002025	航天电 器	2016年9 月12日	重大资 产重组	25.20	-	-	125,829	3,113,152.69	3,170,890.80	-
600855	航天长 峰	2016年 11月8 日	重大资 产重组	28.89	-	-	92,347	2,966,637.71	2,667,904.83	-
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	78,500	2,641,890.51	2,504,150.00	-
300065	海兰信	2016年 12月8 日	重大资 产重组	38.52	-	-	61,300	2,375,219.77	2,361,276.00	-
002260	德奥通 航	2016年 12月5 日	重大资 产重组	23.10	-	-	69,600	1,800,119.36	1,607,760.00	-
300123	太阳鸟	2016年9 月28日	重大资 产重组	15.08	2017年2 月15日	16.59	70,400	1,035,246.57	1,061,632.00	-

注：

1. 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。

2. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易实施情况暨新增股份上市公告书》，长城电脑向长城信息全体股东发行 A 股股票，以换股比例 1:0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 ETF 基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及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主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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

具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

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

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

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

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,021,821.08	-	-	-	3,021,821.08
结算备付金	63,365.53	-	-	-	63,365.53
存出保证金	151,331.78	-	-	-	151,331.78
交易性金融资产	-	-	-	188,158,463.20	188,158,463.20
应收利息	-	-	-	990.69	990.69
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,236,518.39	-	-	188,159,453.89	191,395,972.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	81,110.59	81,110.59
应付管理人报酬	-	-	-	85,383.49	85,383.49
应付托管费	-	-	-	17,076.69	17,076.69
应付交易费用	-	-	-	292,030.12	292,030.12
其他负债	-	-	-	204,000.00	204,000.00
负债总计	-	-	-	679,600.89	679,600.89
利率敏感度缺口	3,236,518.39	-	-	187,479,853.00	190,716,371.39

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

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

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

**7.4.13.4.2 外汇风险**

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

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证军工指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

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军工指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于中证军工指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	188,158,463.20	98.66
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	188,158,463.20	98.66

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无足够的经验数据进行其他价格风险敏感性分析。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 165,325,686.84 元，属于第二层次的余额为 22,832,776.36 元，无属于第三层次的余额。

##### (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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券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) 基金申购款

2016 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 31,649,843.00 元，其中包括以股票支付的申购款 13,892,811.00 元和以现金支付的申购款 17,757,032.00 元。

(3) 除公允价值和基金申购款外，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	188,158,463.20	98.31
	其中：股票	188,158,463.20	98.31
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	3,085,186.61	1.61
7	其他各项资产	152,322.47	0.08
8	合计	191,395,972.28	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	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	170,823,160.45	89.57
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	2,006,624.00	1.05
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	12,578,216.18	6.60
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	1,514,619.00	0.79
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	186,922,619.63	98.01

### 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	879,213.23	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.02
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	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	186,881.77	0.10
J	金融业	106,780.00	0.06
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	1,235,843.57	0.65

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	2,667,300	18,911,157.00	9.92
2	000768	中航飞机	447,900	9,522,354.00	4.99
3	600893	中航动力	250,108	8,188,535.92	4.29
4	002465	海格通信	555,614	6,472,903.10	3.39
5	600150	中国船舶	220,700	6,093,527.00	3.20
6	600118	中国卫星	189,100	5,907,484.00	3.10
7	000748	长城信息	261,306	5,307,124.86	2.78
8	600879	航天电子	274,600	4,184,904.00	2.19
9	002049	紫光国芯	117,600	3,873,744.00	2.03
10	002013	中航机电	207,700	3,798,833.00	1.99
11	600151	航天机电	340,400	3,734,188.00	1.96
12	000738	中航动控	148,500	3,673,890.00	1.93

13	600038	中直股份	75,300	3,646,026.00	1.91
14	300324	旋极信息	186,240	3,600,019.20	1.89
15	002179	中航光电	97,240	3,528,839.60	1.85
16	300159	新研股份	241,000	3,272,780.00	1.72
17	002025	航天电器	125,829	3,170,890.80	1.66
18	600372	中航电子	169,461	3,145,196.16	1.65
19	600685	中船防务	105,500	3,133,350.00	1.64
20	600435	北方导航	238,400	3,108,736.00	1.63
21	600967	北方创业	211,394	2,868,616.58	1.50
22	002544	杰赛科技	100,095	2,816,673.30	1.48
23	002023	海特高新	195,620	2,707,380.80	1.42
24	600316	洪都航空	137,661	2,706,415.26	1.42
25	600855	航天长峰	92,347	2,667,904.83	1.40
26	002268	卫士通	84,123	2,643,144.66	1.39
27	600391	成发科技	73,700	2,597,925.00	1.36
28	600343	航天动力	122,800	2,581,256.00	1.35
29	002151	北斗星通	78,500	2,504,150.00	1.31
30	000519	江南红箭	167,300	2,492,770.00	1.31
31	000901	航天科技	72,998	2,398,714.28	1.26
32	300065	海兰信	61,300	2,361,276.00	1.24
33	300101	振芯科技	126,100	2,337,894.00	1.23
34	600562	国睿科技	76,479	2,326,491.18	1.22
35	600990	四创电子	30,900	2,246,430.00	1.18
36	600765	中航重机	150,000	2,149,500.00	1.13
37	000801	四川九洲	198,466	2,109,693.58	1.11
38	002368	太极股份	67,482	2,065,624.02	1.08
39	300053	欧比特	141,800	2,009,306.00	1.05
40	600677	航天通信	116,800	2,006,624.00	1.05
41	000733	振华科技	106,500	1,901,025.00	1.00
42	603678	火炬电子	23,407	1,770,739.55	0.93
43	300252	金信诺	57,400	1,705,354.00	0.89
44	002413	雷科防务	141,400	1,637,412.00	0.86
45	002260	德奥通航	69,600	1,607,760.00	0.84
46	300034	钢研高纳	81,237	1,583,309.13	0.83
47	300008	天海防务	62,100	1,514,619.00	0.79
48	600501	航天晨光	81,000	1,477,440.00	0.77
49	002519	银河电子	65,495	1,467,088.00	0.77
50	002253	川大智胜	58,250	1,452,755.00	0.76
51	300045	华力创通	108,000	1,433,160.00	0.75

52	300474	景嘉微	26,200	1,411,394.00	0.74
53	002414	高德红外	60,600	1,380,468.00	0.72
54	002111	威海广泰	61,800	1,322,520.00	0.69
55	300177	中海达	87,000	1,291,950.00	0.68
56	000561	烽火电子	96,200	1,172,678.00	0.61
57	300447	全信股份	20,800	1,153,984.00	0.61
58	002214	大立科技	104,000	1,149,200.00	0.60
59	002338	奥普光电	23,531	1,138,900.40	0.60
60	600184	光电股份	49,354	1,065,059.32	0.56
61	600523	贵航股份	46,400	1,064,416.00	0.56
62	300123	太阳鸟	70,400	1,061,632.00	0.56
63	300114	中航电测	38,095	867,804.10	0.46
64	300354	东华测试	17,200	419,680.00	0.22
65	600996	贵广网络	9,583	180,064.57	0.09
66	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.06
67	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.06
68	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.05
69	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.04
70	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.04
71	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.04
72	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.03
73	603877	太平鸟	2,862	60,960.60	0.03
74	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.03
75	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
76	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.02
77	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.02
78	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
79	002833	弘亚数控	1,365	24,051.30	0.01
80	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
81	603886	元祖股份	1,245	22,036.50	0.01
82	603035	常熟汽饰	1,985	20,723.40	0.01
83	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
84	603228	景旺电子	831	19,245.96	0.01
85	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
86	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
87	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.01
88	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.01
89	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
90	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

91	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
92	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600996	贵广网络	9,583	180,064.57	0.09
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.06
3	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.06
4	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.05
5	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.04
6	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.04
7	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.04
8	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.03
9	603877	太平鸟	2,862	60,960.60	0.03
10	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.03
11	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
12	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.02
13	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.02
14	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
15	002833	弘亚数控	1,365	24,051.30	0.01
16	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
17	603886	元祖股份	1,245	22,036.50	0.01
18	603035	常熟汽饰	1,985	20,723.40	0.01
19	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
20	603228	景旺电子	831	19,245.96	0.01
21	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
22	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
23	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.01
24	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.01
25	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
26	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
27	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
28	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601989	中国重工	50,098,372.88	26.27
2	000768	中航飞机	25,321,297.64	13.28
3	600893	中航动力	23,239,141.98	12.19
4	600271	航天信息	21,109,799.97	11.07
5	600118	中国卫星	17,132,503.70	8.98
6	600150	中国船舶	13,810,989.06	7.24
7	002049	紫光国芯	12,436,342.54	6.52
8	600879	航天电子	11,947,688.72	6.26
9	000748	长城信息	11,787,508.32	6.18
10	002179	中航光电	11,323,714.73	5.94
11	000738	中航动控	11,309,254.32	5.93
12	002465	海格通信	10,954,393.35	5.74
13	300159	新研股份	10,697,768.37	5.61
14	600435	北方导航	10,260,874.83	5.38
15	300324	旋极信息	9,869,558.56	5.17
16	002013	中航机电	9,717,647.11	5.10
17	002544	杰赛科技	9,418,590.41	4.94
18	600038	中直股份	9,225,855.10	4.84
19	600372	中航电子	9,190,435.77	4.82
20	600482	中国动力	8,813,425.73	4.62
21	300101	振芯科技	8,740,494.56	4.58
22	002023	海特高新	8,672,945.61	4.55
23	600343	航天动力	8,464,055.64	4.44
24	600151	航天机电	7,853,937.74	4.12
25	002224	三力士	7,657,439.14	4.02
26	002268	卫士通	7,655,353.27	4.01
27	000901	航天科技	7,526,588.05	3.95
28	600391	成发科技	7,417,585.56	3.89
29	600316	洪都航空	7,101,314.97	3.72
30	600685	中船防务	6,922,766.20	3.63
31	000519	江南红箭	6,650,305.65	3.49

32	600562	国睿科技	6,644,679.85	3.48
33	600967	北方创业	6,623,387.40	3.47
34	300065	海兰信	6,461,647.00	3.39
35	600990	四创电子	6,199,403.16	3.25
36	600765	中航重机	6,185,619.85	3.24
37	002368	太极股份	6,071,288.78	3.18
38	600855	航天长峰	6,057,634.22	3.18
39	000733	振华科技	5,928,234.95	3.11
40	300252	金信诺	5,922,232.95	3.11
41	600677	航天通信	5,822,142.13	3.05
42	300053	欧比特	5,698,263.24	2.99
43	002413	雷科防务	5,692,871.18	2.98
44	000801	四川九洲	5,679,706.50	2.98
45	002414	高德红外	5,662,438.60	2.97
46	603678	火炬电子	5,648,705.75	2.96
47	002151	北斗星通	5,256,167.41	2.76
48	002025	航天电器	5,241,308.91	2.75
49	300034	钢研高纳	4,941,318.78	2.59
50	002253	川大智胜	4,817,362.75	2.53
51	002260	德奥通航	4,609,548.89	2.42
52	300045	华力创通	4,530,421.94	2.38
53	300008	天海防务	4,215,587.04	2.21
54	002519	银河电子	3,936,887.29	2.06

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000768	中航飞机	14,532,915.37	7.62
2	600271	航天信息	7,905,148.13	4.14
3	002049	紫光国芯	7,537,736.46	3.95
4	000738	中航动控	7,226,372.56	3.79
5	002224	三力士	6,852,923.91	3.59
6	002179	中航光电	6,722,615.25	3.52
7	300159	新研股份	6,553,479.73	3.44
8	002013	中航机电	6,232,527.46	3.27

9	002544	杰赛科技	6,019,520.69	3.16
10	300324	旋极信息	5,995,681.38	3.14
11	000748	长城信息	5,992,803.69	3.14
12	300101	振芯科技	5,251,481.71	2.75
13	002023	海特高新	5,095,543.78	2.67
14	002268	卫士通	4,824,063.36	2.53
15	000901	航天科技	4,547,113.26	2.38
16	300252	金信诺	4,189,031.51	2.20
17	002414	高德红外	4,161,711.89	2.18
18	000519	江南红箭	4,119,979.60	2.16
19	300065	海兰信	3,975,131.23	2.08
20	600482	中国动力	3,923,423.81	2.06
21	002368	太极股份	3,872,643.34	2.03

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	554,316,568.05
卖出股票收入（成交）总额	192,286,953.37

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金未投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

**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	151,331.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	990.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	152,322.47

### 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	000748	长城信息	5,307,124.86	2.78	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	601375	中原证券	106,780.00	0.06	新股锁定

## § 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

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
3,077	66,880.64	4,952,242.00	2.41%	200,839,485.00	97.59%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	招商证券股份有限公司	2,978,825.00	1.45%
2	王永明	2,300,000.00	1.12%
3	郭健	2,000,000.00	0.97%
4	范亚文	2,000,000.00	0.97%
5	应裕乔	2,000,000.00	0.97%
6	张惠兰	1,999,000.00	0.97%

7	薛茂泉	1,800,000.00	0.87%
8	周迈	1,105,700.00	0.54%
9	李彦龙	1,099,000.00	0.53%
10	中国大恒（集团）有限公司	1,010,000.00	0.49%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

### 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月5日）基金份额总额	544,791,727.00
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	33,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	372,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	205,791,727.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本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

本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 54,000.00 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(2016年8月5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	
瑞银证券	1	-	-	147,935.06	21.46%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	244,128.61	35.41%	-
申万宏源	1	-	-	23,128.10	3.35%	-
国金证券	1	-	-	914.72	0.13%	-

银河证券	1	-	-	16,693.72	2.42%	-
光大证券	1	-	-	899.16	0.13%	-
华创证券	3	-	-	159,496.19	23.13%	-
广发证券	1	-	-	6,098.98	0.88%	-
方正证券	1	-	-	15,650.03	2.27%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	74,490.43	10.80%	-

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，并能为本基金提供全面的信息服；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均为新增。

### 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
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2016年7月6日
2	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月6日
3	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月6日
4	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2016年7月6日
5	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月6日
6	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金增加发售代理机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月18日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金增加发售代理机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月20日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于	《上海证券报》、《证	2016年7月25日

	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金增加发售代理机构的公告	券时报》和基金管理人网站	
9	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金增加发售代理机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月27日
10	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年7月28日
11	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月6日
12	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月17日
13	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月17日
14	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月22日
15	华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月22日
16	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年8月25日
17	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金、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新增一级交易商的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年9月14日
18	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金、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新增一级交易商的公告	《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站	2016年9月26日
19	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证军工交易型开放式	《上海证券报》、《证券时报》、《证券日	2016年11月2日

	指数证券投资基金、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新增一级交易商的公告	报》和基金管理人网站	
--	---	------------	--

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

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

华宝兴业基金管理有限公司  
 2017年3月28日