

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告（摘要）

2017 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：2017 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示

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 2017 年 8 月 22 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 2017 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	115,245,905.82 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	7,727,250.00 份	7,727,250.00 份	99,791,405.82 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	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-2,070,606.67
本期利润	-8,806,504.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0701
本期加权平均净值利润率	-8.95%
本期基金份额净值增长率	-8.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-104,649,618.07
期末可供分配基金份额利润	-0.9081
期末基金资产净值	85,060,569.37
期末基金份额净值	0.7381
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-55.03%

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	3.58%	1.03%	3.34%	1.03%	0.24%	0.00%
过去三个月	-9.06%	1.10%	-9.96%	1.10%	0.90%	0.00%
过去六个月	-8.81%	1.00%	-11.47%	1.01%	2.66%	-0.01%
过去一年	-9.76%	0.98%	-13.84%	1.00%	4.08%	-0.02%
自基金合同	-55.03%	2.23%	-45.87%	2.26%	-9.16%	-0.03%

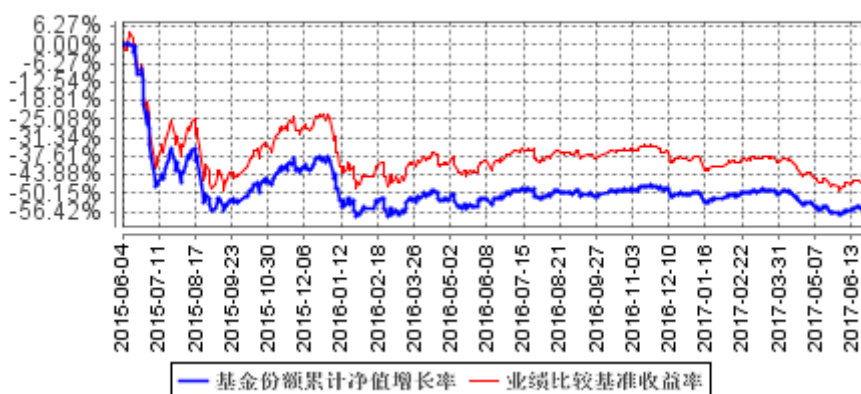
生效日起至 今						
------------	--	--	--	--	--	--

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 2017 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（2017 年 6 月 30 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、中国互联网基金、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、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金及新优享基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 122,557,514,320.78 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	2015 年 6 月 4 日	-	11 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

	证医疗指数分级、华宝兴业中证军工 ETF、华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数 (LOF) 基金经理				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。2017 年 1 月兼任华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。
张奇	本基金基金经理助理、上证 180 价值 ETF、华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接、上证 180 成长 ETF、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、华宝兴业中证医疗指数分级、华宝兴业中证军工 ETF 基金经理助理	2017 年 4 月 6 日	-	7 年	本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2015 年 5 月起兼任上证 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基金经理助理，2017 年 4 月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金、华宝兴业中证 1000 指数分级证券投

					资基金、华宝兴业中证 军工交易型开放式指 数证券投资基金基金 经理助理
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

2017 年上半年，中国经济增长强劲。从需求端来看，基建投资维持强劲增速、房地产投资处于高位、制造业投资温和反弹、出口增速显著复苏；从生产端来看，供给侧结构性改革推动的工业品价格上升助推了企业的补库存周期。6 月 A 股成功进入 MSCI 指数打通了未来海外资金直接投资中国 A 股的渠道，将为 A 股市场注入新鲜血液，提升 A 股长期配置价值。从市场表现来看，今年上半年 A 股在家电、食品饮料、银行、保险等一线白马板块的带动下稳健上涨，大盘蓝筹股势头强劲，小市值股票表现则相对较差，沪市股票整体强于深市。指数方面，市场风格继续分化，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股表现较好，分别上涨了 15.13% 和 10.78%；而以创业板指和中证 1000 指数为代表的中小盘股表现较弱，分别下跌了 7.34% 和 12.07%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-8.81%，同期业绩比较基准收益率为-11.47%，基金表现领先比较基准 2.66%。

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 年下半年，中国经济增速可能或适度放缓，压力来自去库存、房地产调控、金融去杠杆等因素。但总体库存水平不高，地产投资仍可能超预期，加之外围经济复苏对出口的带动，制造业总体情况平稳，全年完成经济增长目标的压力不大。十九大前后，国内将进入结构性改革的时间窗口，政府有望加快实体改革的步伐。在此市场环境下，我们认为资本市场未来将继续维持结构性行情，当下注重上市公司盈利能力和盈利质量和的投资风格有望延续，行业龙头股和优质白马股有望进一步受到资金的追捧和青睐，投资者可以更多关注资产长期配置价值以及估值修复带来的机会。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。2017 年上半年 A 股市场延续风格分化行情，但分化的程度随着估值的有效纠偏而有所收敛，小市值公司经历了大幅调整后风险得到一定的释放，部分股票有望在下

半年或将迎来阶段性的修复行情，投资者可以通过投资中证 1000 指数在大小盘风格轮动的过程中把握小盘股的投资机会。

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 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		5,080,602.31	6,424,942.83
结算备付金		-	2,637.42
存出保证金		2,717.98	16,128.15
交易性金融资产		80,679,350.32	99,470,723.98
其中：股票投资		80,679,350.32	99,470,723.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	30,915.98
应收利息		1,117.13	1,415.86
应收股利		-	-
应收申购款		8,410.10	6,987.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		85,772,197.84	105,953,751.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	279,606.56
应付赎回款		85,865.06	38,276.78
应付管理人报酬		71,953.05	91,342.86
应付托管费		15,829.65	20,095.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		203,538.88	207,679.76

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		334,441.83	340,120.62
负债合计		711,628.47	977,122.03
所有者权益：			
实收基金		189,145,351.32	212,869,103.61
未分配利润		-104,084,781.95	-107,892,474.27
所有者权益合计		85,060,569.37	104,976,629.34
负债和所有者权益总计		85,772,197.84	105,953,751.37

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7381 元，基金份额总额 115,245,905.82 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-7,953,840.33	-27,473,304.20
1.利息收入		22,169.81	46,186.32
其中：存款利息收入		22,169.81	46,186.32
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）		-1,253,874.89	-25,174,829.54
其中：股票投资收益		-1,596,223.96	-25,548,631.42
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		342,349.07	373,801.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-6,735,897.39	-2,466,047.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		13,762.14	121,386.09

减：二、费用		852,663.73	1,363,539.20
1. 管理人报酬		488,355.17	696,980.33
2. 托管费		107,438.10	153,335.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		61,802.72	308,105.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		195,067.74	205,117.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,806,504.06	-28,836,843.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,806,504.06	-28,836,843.40

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	212,869,103.61	-107,892,474.27	104,976,629.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,806,504.06	-8,806,504.06
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）	-23,723,752.29	12,614,196.38	-11,109,555.91
其中：1.基金申购款	5,024,169.42	-2,651,383.39	2,372,786.03
2.基金赎回款	-28,747,921.71	15,265,579.77	-13,482,341.94
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）	189,145,351.32	-104,084,781.95	85,060,569.37
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 黄小薏 </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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 330,638,859.16 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金

利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额，其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

基金份额的净值按如下原则计算：华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%，华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后，根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出华宝中证 1000B 份额的基

金份额参考净值。

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

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

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]第 272 号文审核同意，本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有

人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

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

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 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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、会计估计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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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（“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

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。

根据中国证监会于 2017 年 7 月 21 日发布的《关于核准华宝兴业基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可（2017）1321 号），中国证监会已核准“领先资产管理有限公司”将持有的我公司 49%的股权转让给 Warburg Pincus Asset Management, L.P.。我公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜，敬请投资者知悉。

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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华宝证券	192,771.74	0.52%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华宝证券	179.55	0.53%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	488,355.17	696,980.33
其中：支付销售机构的客户维护费	178,727.56	231,558.16

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1%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 1% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,438.10	153,335.73

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	5,080,602.31	21,912.24	7,874,902.11	44,551.00

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（2017 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

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
000029	深深	2016	重	11.17	-	-	6,200	81,266.58	69,254.00	-

	房 A	2017 年 9 月 14 日	重大事项停牌							
000034	神州数码	2017 年 3 月 21 日	重大事项停牌	24.45	2017 年 7 月 18 日	22.01	7,000	185,876.62	171,150.00	-
000038	深大通	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	31.74	-	-	800	41,710.00	25,392.00	-
000409	山东地矿	2017 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.83	2017 年 7 月 6 日	9.01	6,686	74,603.11	65,723.38	-
000506	中润资源	2017 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.75	-	-	11,800	98,875.67	103,250.00	-
000571	新大洲 A	2017 年 5 月 15 日	重大事项停牌	8.11	2017 年 8 月 14 日	8.41	13,800	131,423.02	111,918.00	-
000673	当代东方	2017 年 1 月 18 日	重大事项停牌	13.53	-	-	8,500	130,307.85	115,005.00	-
000682	东方电子	2016 年 10 月 10 日	重大事	5.20	2017 年 8 月 7 日	5.60	22,500	136,149.74	117,000.00	-

		日	项 停 牌		日					
000700	模塑科技	2017年6月28日	重大 事 项 停 牌	8.09	2017年8月16日	8.00	9,400	93,345.03	76,046.00	-
000836	鑫茂科技	2017年5月24日	重大 事 项 停 牌	6.05	-	-	25,600	200,317.55	154,880.00	-
000838	财信发展	2017年5月2日	重大 事 项 停 牌	6.59	-	-	9,300	107,711.31	61,287.00	-
000885	同力水泥	2017年5月8日	重大 事 项 停 牌	19.29	2017年7月20日	21.22	2,000	36,160.00	38,580.00	-
000889	茂业通信	2017年4月14日	重大 事 项 停 牌	16.71	-	-	5,300	68,505.35	88,563.00	-
002070	*ST众和	2017年5月2日	重大 事 项 停 牌	10.17	-	-	10,700	239,410.64	108,819.00	-
002141	贤丰控股	2017年5月2日	重大 事 项 停	7.15	-	-	12,000	133,628.86	85,800.00	-

			牌							
002162	悦心健康	2016年12月22日	重大事项停牌	6.61	2017年7月5日	6.80	9,000	79,791.24	59,490.00	-
002255	海陆重工	2017年3月6日	重大事项停牌	10.06	2017年7月21日	9.05	9,300	93,818.07	93,558.00	-
002256	兆新股份	2017年6月5日	重大事项停牌	4.39	-	-	19,900	121,773.78	87,361.00	-
002260	德奥通航	2016年12月5日	重大事项停牌	23.10	-	-	4,700	165,417.58	108,570.00	-
002263	大东南	2017年4月24日	重大事项停牌	3.28	-	-	27,800	134,622.34	91,184.00	-
002331	皖通科技	2017年5月2日	重大事项停牌	14.16	-	-	5,880	138,780.91	83,260.80	-
002348	高乐股份	2017年5月11日	重大事项停牌	7.01	2017年7月27日	6.70	10,000	89,524.73	70,100.00	-
002356	赫美	2017	重	25.41	-	-	1,900	50,080.01	48,279.00	-

	集团	年 6 月 14 日	大 事 项 停 牌							
002418	康盛 股份	2017 年 3 月 20 日	重 大 事 项 停 牌	9.31	2017 年 7 月 10 日	9.30	12,100	108,411.04	112,651.00	-
002427	尤夫 股份	2017 年 5 月 22 日	重 大 事 项 停 牌	25.11	2017 年 7 月 21 日	23.00	5,100	109,699.04	128,061.00	-
002447	壹桥 股份	2017 年 5 月 2 日	重 大 事 项 停 牌	9.00	-	-	14,100	156,163.45	126,900.00	-
002464	金利 科技	2017 年 1 月 23 日	重 大 事 项 停 牌	43.13	2017 年 7 月 26 日	38.82	3,040	124,050.11	131,115.20	-
002499	科林 环保	2017 年 4 月 20 日	重 大 事 项 停 牌	28.92	2017 年 7 月 11 日	26.03	2,400	54,347.80	69,408.00	-
002504	*ST 弘高	2017 年 5 月 2 日	重 大 事 项 停 牌	8.10	-	-	10,798	113,517.53	87,463.80	-
002509	天广 中茂	2017 年 6 月 12	重 大 事 项 停 牌	9.20	-	-	34,704	232,918.30	319,276.80	-

		日	项 停 牌								
002547	春兴精工	2017年2月20日	重大 事 项 停 牌	10.89	2017年8月18日	9.80	13,000	132,724.74	141,570.00	-	
002567	唐人神	2017年6月5日	重大 事 项 停 牌	9.70	2017年8月14日	9.54	6,750	61,656.15	65,475.00	-	
002586	围海股份	2017年4月18日	重大 事 项 停 牌	9.87	-	-	6,600	60,643.11	65,142.00	-	
002596	海南瑞泽	2017年5月22日	重大 事 项 停 牌	8.29	-	-	10,200	92,024.56	84,558.00	-	
002600	江粉磁材	2017年2月27日	重大 事 项 停 牌	11.46	2017年8月9日	6.25	12,600	125,648.71	144,396.00	-	
002606	大连电瓷	2017年3月2日	重大 事 项 停 牌	20.87	-	-	7,000	54,647.67	146,090.00	-	
002610	爱康科技	2017年5月12日	重大 事 项 停	2.44	2017年8月2日	2.44	47,500	161,450.90	115,900.00	-	

			牌							
002619	巨龙管业	2017年5月24日	重大事件停牌	6.37	-	-	9,180	110,197.27	58,476.60	-
002622	融钰集团	2017年4月20日	重大事件停牌	12.30	-	-	14,200	201,920.01	174,660.00	-
002625	龙生股份	2017年4月13日	重大事件停牌	36.36	-	-	3,800	182,008.42	138,168.00	-
002638	勤上股份	2017年4月26日	重大事件停牌	8.14	-	-	16,350	138,724.52	133,089.00	-
002650	加加食品	2017年4月20日	重大事件停牌	5.88	-	-	14,600	104,109.12	85,848.00	-
002675	东诚药业	2017年1月3日	重大事件停牌	14.26	2017年7月17日	12.84	6,000	93,540.00	85,560.00	-
002684	猛狮科技	2017年4月20日	重大事件停牌	21.22	-	-	4,800	100,880.56	101,856.00	-
002711	欧浦	2017	重	18.79	2017	11.94	4,980	83,322.76	93,574.20	-

	智网	年 6 月 26 日	大事项停牌		年 7 月 17 日					
002756	永兴特钢	2017 年 6 月 30 日	重大事项停牌	28.20	-	-	3,400	90,193.35	95,880.00	-
002781	奇信股份	2017 年 5 月 31 日	重大事项停牌	29.44	-	-	1,000	43,865.00	29,440.00	-
300030	阳普医疗	2017 年 5 月 16 日	重大事项停牌	11.62	2017 年 8 月 15 日	11.62	4,600	105,222.79	53,452.00	-
300065	海兰信	2016 年 12 月 8 日	重大事项停牌	24.47	2017 年 7 月 6 日	23.07	6,450	151,400.58	157,831.50	-
300075	数字政通	2017 年 6 月 29 日	重大事项停牌	20.94	2017 年 7 月 17 日	18.86	4,400	145,746.70	92,136.00	-
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	重大事项停牌	18.50	2017 年 7 月 7 日	18.88	5,100	90,130.91	94,350.00	-
300098	高新兴	2017 年 6 月 22 日	重大事	12.90	2017 年 7 月 3 日	13.18	8,220	117,069.37	106,038.00	-

		日	项 停 牌		日					
300100	双林 股份	2017 年 4 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	25.96	-	-	2,500	73,983.32	64,900.00	-
300109	新开 源	2017 年 3 月 27 日	重 大 事 项 停 牌	46.46	-	-	1,400	79,325.16	65,044.00	-
300145	中金 环境	2017 年 6 月 28 日	重 大 事 项 停 牌	16.92	-	-	13,500	217,383.06	228,420.00	-
300148	天舟 文化	2017 年 1 月 25 日	重 大 事 项 停 牌	15.57	2017 年 8 月 1 日	14.01	9,100	143,615.64	141,687.00	-
300149	量子 高科	2016 年 12 月 15 日	重 大 事 项 停 牌	19.37	-	-	6,300	118,635.93	122,031.00	-
300151	昌红 科技	2017 年 4 月 11 日	重 大 事 项 停 牌	11.53	2017 年 8 月 18 日	10.38	5,300	67,919.50	61,109.00	-
300152	科融 环境	2017 年 5 月 12 日	重 大 事 项 停	7.89	2017 年 7 月 12 日	7.41	12,100	114,779.85	95,469.00	-

			牌							
300198	纳川股份	2017年4月20日	重大事项停牌	5.75	-	-	10,880	72,422.96	62,560.00	-
300209	天泽信息	2017年2月10日	重大事项停牌	27.72	-	-	2,500	71,855.11	69,300.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重大事项停牌	21.65	2017年7月27日	19.49	3,800	137,671.32	82,270.00	-
300271	华宇软件	2017年6月22日	重大事项停牌	16.59	2017年7月4日	16.80	9,880	219,642.60	163,909.20	-
300276	三丰智能	2017年6月29日	重大事项停牌	16.50	2017年7月7日	16.95	2,800	64,052.49	46,200.00	-
300278	华昌达	2017年4月26日	重大事项停牌	16.59	2017年8月10日	15.90	4,600	79,283.08	76,314.00	-
300298	三诺生物	2017年5月17日	重大事项停牌	16.27	2017年7月17日	16.09	3,420	73,322.36	55,643.40	-
300322	硕贝	2017	重	17.02	2017	15.32	6,100	107,053.92	103,822.00	-

	德	年 2 月 23 日	大 事 项 停 牌		年 8 月 7 日					
300364	中文 在线	2017 年 2 月 13 日	重 大 事 项 停 牌	37.28	-	-	3,006	171,353.62	112,063.68	-
300367	东方 网力	2016 年 12 月 15 日	重 大 事 项 停 牌	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	9,150	253,787.05	183,000.00	-
300388	国祯 环保	2017 年 6 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	21.15	2017 年 7 月 10 日	21.06	2,300	51,098.69	48,645.00	-
300413	快乐 购	2017 年 4 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	20.29	-	-	4,200	129,359.13	85,218.00	-
300440	运达 科技	2017 年 2 月 20 日	重 大 事 项 停 牌	13.12	-	-	4,800	85,388.22	62,976.00	-
300459	金科 娱乐	2017 年 6 月 30 日	重 大 事 项 停 牌	12.40	-	-	8,900	98,759.39	110,360.00	-
300518	盛讯 达	2016 年 12 月 13 日	重 大 事 项 停 牌	113.30	2017 年 7 月 10 日	101.97	600	76,314.00	67,980.00	-

		日	项 停 牌		日					
600057	象屿 股份	2017 年 6 月 27 日	重 大 事 项 停 牌	10.17	2017 年 7 月 4 日	10.17	10,900	119,907.97	110,853.00	-
600136	当代 明诚	2017 年 2 月 14 日	重 大 事 项 停 牌	15.07	-	-	4,200	103,646.82	63,294.00	-
600165	新日 恒力	2017 年 4 月 10 日	重 大 事 项 停 牌	16.84	2017 年 7 月 20 日	15.16	8,650	97,660.21	145,666.00	-
600172	黄河 旋风	2017 年 6 月 30 日	重 大 事 项 停 牌	8.23	2017 年 7 月 14 日	8.00	18,660	192,637.58	153,571.80	-
600193	创兴 资源	2017 年 6 月 1 日	重 大 事 项 停 牌	6.77	-	-	6,300	105,313.74	42,651.00	-
600239	云南 城投	2017 年 6 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	5.22	-	-	21,000	98,566.79	109,620.00	-
600255	鑫科 材料	2017 年 6 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	4.04	-	-	33,100	195,360.61	133,724.00	-

600318	新力金融	2017年4月27日	牌 重 大 事 项 停 牌	10.73	2017年8月8日	11.50	7,200	97,324.58	77,256.00	-
600490	鹏欣资源	2017年2月21日	重 大 事 项 停 牌	7.91	-	-	28,800	238,364.06	227,808.00	-
600559	老白干酒	2017年1月23日	重 大 事 项 停 牌	22.69	-	-	5,672	131,098.82	128,697.68	-
600568	中珠医疗	2017年4月25日	重 大 事 项 停 牌	19.16	2017年7月27日	6.15	7,500	149,698.18	143,700.00	-
600577	精达股份	2017年6月26日	重 大 事 项 停 牌	4.80	2017年7月10日	4.50	21,900	144,740.01	105,120.00	-
600602	云赛智联	2017年6月22日	重 大 事 项 停 牌	7.51	2017年7月4日	7.80	11,500	117,372.67	86,365.00	-
600634	富控互动	2017年4月19日	重 大 事 项 停 牌	18.03	2017年7月17日	17.21	8,500	189,629.30	153,255.00	-
600653	申华	2017	重	3.26	-	-	32,900	215,114.28	107,254.00	-

	控股	年 5 月 8 日	重大事项停牌							
600764	中电广通	2017 年 6 月 29 日	重大事项停牌	33.25	2017 年 7 月 7 日	33.98	3,100	98,422.18	103,075.00	-
601028	玉龙股份	2017 年 6 月 23 日	重大事项停牌	8.40			7,300	70,459.05	61,320.00	-
601069	西部黄金	2017 年 4 月 17 日	重大事项停牌	26.26			4,000	79,202.57	105,040.00	-
603126	中材节能	2017 年 6 月 27 日	重大事项停牌	16.46			4,600	59,331.01	75,716.00	-
603299	井神股份	2017 年 5 月 31 日	重大事项停牌	10.47			2,400	41,082.14	25,128.00	-
603861	白云电器	2017 年 6 月 15 日	重大事项停牌	24.27			1,600	49,300.00	38,832.00	-

注：本基金截至 2017 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 2017 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 71,052,325.76 元，属于第二层次的余额为 9,627,024.56 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 90,728,184.34 元，第二层次 8,742,539.64 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 2017 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。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。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。

(3) 除公允价值和增值税外，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	80,679,350.32	94.06
	其中：股票	80,679,350.32	94.06
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	5,080,602.31	5.92
7	其他各项资产	12,245.21	0.01
8	合计	85,772,197.84	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	907,314.00	1.07
B	采矿业	1,480,830.60	1.74
C	制造业	51,071,143.72	60.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,172,072.40	2.55
E	建筑业	2,766,268.92	3.25
F	批发和零售业	3,169,164.00	3.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,416,822.40	2.84
H	住宿和餐饮业	45,513.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,994,526.46	8.22
J	金融业	141,256.00	0.17

K	房地产业	3,319,096.10	3.90
L	租赁和商务服务业	1,186,805.30	1.40
M	科学研究和技术服务业	622,895.50	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	957,426.80	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	327,778.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	1,527,135.68	1.80
S	综合	894,227.78	1.05
	合计	80,000,276.66	94.05

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	采矿业	-	-
C	制造业	522,487.86	0.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	87,463.80	0.10
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	69,122.00	0.08
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	-	-
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	679,073.66	0.80

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	002509	天广中茂	34,704	319,276.80	0.38
2	600110	诺德股份	21,500	302,935.00	0.36
3	600004	白云机场	16,000	295,360.00	0.35
4	300142	沃森生物	20,100	248,436.00	0.29
5	002185	华天科技	31,900	230,956.00	0.27
6	300145	中金环境	13,500	228,420.00	0.27
7	000820	神雾节能	6,000	227,880.00	0.27
8	600490	鹏欣资源	28,800	227,808.00	0.27
9	300197	铁汉生态	17,080	226,822.40	0.27
10	002035	华帝股份	8,720	211,024.00	0.25

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 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	000682	东方电子	22,500	117,000.00	0.14
2	002070	*ST 众和	10,700	108,819.00	0.13
3	002504	*ST 弘高	10,798	87,463.80	0.10
4	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.09
5	000916	华北高速	10,700	69,122.00	0.08

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 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	002035	华帝股份	349,846.00	0.33
2	600004	白云机场	315,047.00	0.30
3	000820	神雾节能	244,154.00	0.23
4	300145	中金环境	233,483.00	0.22
5	600252	中恒集团	225,849.00	0.22
6	600320	振华重工	177,482.00	0.17
7	000088	盐田港	175,042.00	0.17
8	002429	兆驰股份	174,039.00	0.17
9	600797	浙大网新	171,783.00	0.16
10	600779	水井坊	168,810.00	0.16
11	002647	民盛金科	159,553.00	0.15
12	000615	京汉股份	151,734.00	0.14
13	600803	新奥股份	136,216.00	0.13
14	600076	康欣新材	134,602.00	0.13
15	002108	沧州明珠	134,103.00	0.13
16	000881	中广核技	123,235.76	0.12
17	601666	平煤股份	118,056.00	0.11
18	000921	海信科龙	114,611.01	0.11
19	600337	美克家居	110,322.00	0.11
20	600132	重庆啤酒	109,919.00	0.10

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	002411	必康股份	279,630.00	0.27
2	603799	华友钴业	279,613.40	0.27
3	002583	海能达	224,028.40	0.21

4	002601	龙鳞佰利	201,522.00	0.19
5	300383	光环新网	193,825.00	0.18
6	002429	兆驰股份	180,642.00	0.17
7	300618	寒锐钴业	163,233.00	0.16
8	002852	道道全	162,638.33	0.15
9	002108	沧州明珠	156,174.00	0.15
10	600401	*ST 海润	148,473.00	0.14
11	002035	华帝股份	143,987.00	0.14
12	000766	通化金马	142,009.00	0.14
13	600848	上海临港	138,336.00	0.13
14	000932	*ST 华菱	128,252.00	0.12
15	300376	易事特	125,134.00	0.12
16	600577	精达股份	122,499.00	0.12
17	601375	中原证券	120,673.20	0.11
18	300323	华灿光电	119,965.00	0.11
19	300583	赛托生物	115,614.04	0.11
20	002709	天赐材料	107,029.40	0.10

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	13,933,815.76
卖出股票收入（成交）总额	24,393,068.07

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

中证 1000 指数分级基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的天广中茂（002509）于 2017 年 5 月 9 日收到福建证监局警告。因公司未对非经营性资金占用事项履行临时报告的信息披露义务，决定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九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	2,717.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,117.13
5	应收申购款	8,410.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,245.21

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	002509	天广中茂	319,276.80	0.38	重大事项停牌
2	300145	中金环境	228,420.00	0.27	重大事项停牌
3	600490	鹏欣资源	227,808.00	0.27	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	000682	东方电子	117,000.00	0.14	重大事项停牌
2	002070	*ST 众和	108,819.00	0.13	重大事项停牌
3	002504	*ST 弘高	87,463.80	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	94	82,204.79	7,226,411.00	93.52%	500,839.00	6.48%
1000B	381	20,281.50	446,709.00	5.78%	7,280,541.00	94.22%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	3,949	25,270.04	606,927.97	0.61%	99,184,477.85	99.39%
合计	4,424	26,050.16	8,280,047.97	7.18%	106,965,857.85	92.82%

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	6,254,646.00	80.94%
2	上海明泐投资管理有限公司—明泐多策略对冲 1 号基金	793,702.00	10.27%
3	北京天演资本管理有限公司—星辰之天演 2 号私募证券投资基金	162,952.00	2.11%
4	李时龙	135,248.00	1.75%
5	孙大威	29,400.00	0.38%
6	邵文杰	26,079.00	0.34%
7	张殿刚	25,619.00	0.33%
8	魏永斌	23,597.00	0.31%
9	夏永清	22,800.00	0.30%
10	江利雄	19,200.00	0.25%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	祝东华	690,354.00	8.93%
2	黄梅	570,221.00	7.38%

3	吴天爵	462,100.00	5.98%
4	易方达基金—民生银行—杭州银行股份有限公司	416,309.00	5.39%
5	何凤珍	297,700.00	3.85%
6	谢锦星	223,800.00	2.90%
7	张珊珊	213,200.00	2.76%
8	杨玉锋	186,700.00	2.42%
9	刘文卿	155,800.00	2.02%
10	王杰	135,837.00	1.76%

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	0.00	0.0000%
	1000B	0.00	0.0000%
	华宝兴业中证 1000 指数分级	86,939.67	0.0871%
	合计	86,939.67	0.0754%

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	12,008,007.00	12,008,007.00	105,684,936.59
本报告期基金总申购份额	-	-	3,061,239.39
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	17,516,284.16
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-4,280,757.00	-4,280,757.00	8,561,514.00
本报告期期末基金份额总额	7,727,250.00	7,727,250.00	99,791,405.82

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

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强因个人原因，自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

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

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。

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	
中泰证券	2	14,774,339.30	39.81%	13,463.86	39.46%	-
海通证券	1	7,128,220.48	19.21%	6,638.81	19.46%	-
招商证券	2	5,959,360.15	16.06%	5,430.71	15.92%	-
安信证券	1	2,620,910.41	7.06%	2,441.67	7.16%	-
申万宏源	3	1,562,691.73	4.21%	1,455.30	4.27%	-
华泰证券	1	1,129,156.20	3.04%	1,051.51	3.08%	-
兴业证券	2	970,013.21	2.61%	884.01	2.59%	-
天风证券	2	549,199.02	1.48%	511.75	1.50%	-
国泰君安	2	504,814.75	1.36%	461.12	1.35%	-
银河证券	1	434,714.00	1.17%	404.84	1.19%	-
东吴证券	1	378,145.47	1.02%	352.14	1.03%	-
国金证券	1	285,416.00	0.77%	265.88	0.78%	-
中银国际	1	245,683.69	0.66%	228.84	0.67%	-
华宝证券	1	192,771.74	0.52%	179.55	0.53%	-
华创证券	1	155,984.80	0.42%	145.26	0.43%	-
信达证券	1	82,421.64	0.22%	76.76	0.22%	-
东北证券	1	72,444.48	0.20%	67.47	0.20%	-
方正证券	2	62,688.90	0.17%	57.12	0.17%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	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：资质雄厚，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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中航证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日