

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告

2015 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：2016 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 2016 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
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.....	13
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.....	15
§5 托管人报告	15
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
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
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
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	74
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.....	74

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	75
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	75
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12	投资组合报告附注	75
§9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2	期末上市基金前十名持有人	77
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
§10	开放式基金份额变动	78
§11	重大事件揭示	79
11.1	基金份额持有人大会决议	79
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	79
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4	基金投资策略的改变	79
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	79
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	79
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8	其他重大事件	83
§12	备查文件目录	86
12.1	备查文件目录	86
12.2	存放地点	86
12.3	查阅方式	86

§ 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	173,967,475.30 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-16		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
下属分级基金的场内简称	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金份额总额	7,765,201.00 份	7,765,201.00 份	158,437,073.30 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	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。 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。
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
注册地址		上海浦东新区世纪大道 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		上海浦东新区世纪大道 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》
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	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-124,557,018.36
本期利润	-133,451,005.28
加权平均基金份额本期利润	-0.7229
本期加权平均净值利润率	-76.83%
本期基金份额净值增长率	-38.97%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-129,672,978.28
期末可供分配基金份额利润	-0.7454
期末基金资产净值	180,189,971.89
期末基金份额净值	1.0358
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-38.97%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

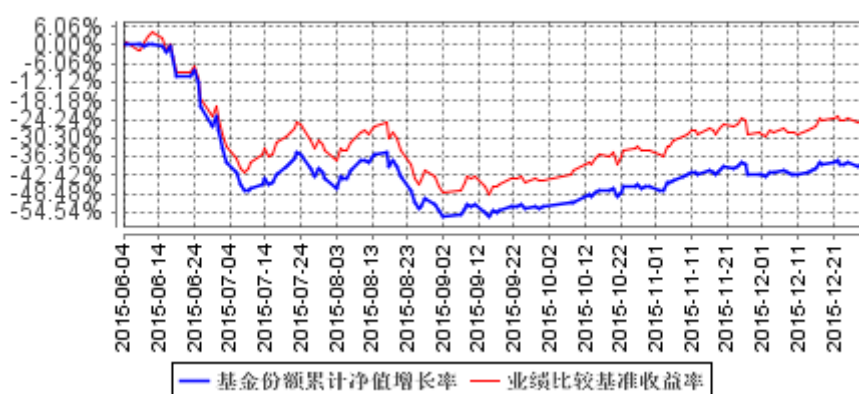
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	29.87%	1.94%	35.30%	2.09%	-5.43%	-0.15%
过去六个月	-20.67%	3.14%	-6.08%	3.21%	-14.59%	-0.07%
自基金合同生效日起至 今	-38.97%	3.23%	-24.63%	3.26%	-14.34%	-0.03%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

(2015 年 6 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日)

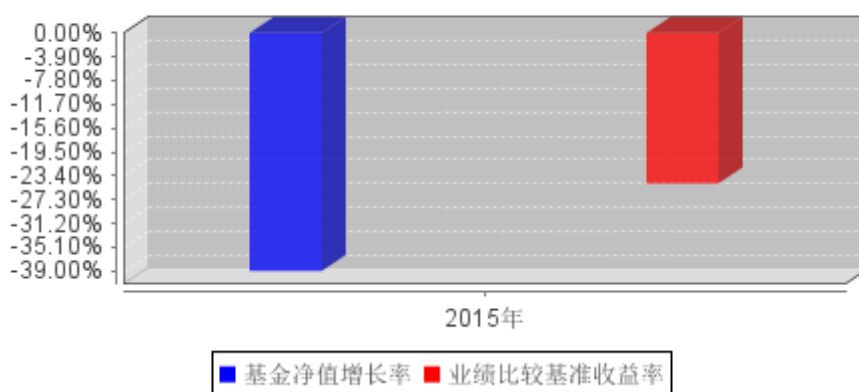
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2015 年 6 月 4 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。
2、按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进

行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金本年度未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 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（2015 年 12 月 31 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、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和华宝兴业转型升级基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 182,703,481,955.16 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、上证 180 成长 ETF、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、华宝兴业中证医疗指数分级基金经理	2015 年 6 月 4 日	-	9 年	硕士。2006 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证

					180 成长交易型开放式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。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用

权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2015 年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及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。

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，分析了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；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利

益输送的可能。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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。

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

2015 年 A 股市场经历了暴涨暴跌的过山车行情，波动幅度空前。上半年，在宽松货币政策和经济转型升级预期的推动下，国企改革、重组并购、互联网、券商等热点板块轮番启动，市场整体呈现单边上涨走势，上证综指的最高涨幅超过 60%，创业板指的最高涨幅更是达到 174%。随着监管层 6 月开始清查场外配资拉开了去杠杆的序幕，A 股市场风云突变，在短短 2 个多月的时间内，上证综指的调整幅度达到 45%，各个板块悉数下跌，行业共性显著上升，大盘数次上演千股涨停、千股跌停的前所未见的场面，上半年单边上涨所累计的风险集中释放。9 月，由于市场风险得到大幅释放，利好政策轮番上阵，市场迎来暴跌后的技术性反弹，之前调整幅度较深的中小板、创业板股票反弹力度较大。随后市场转入振荡寻底阶段。指数方面，中小盘股指数总体表现显著强于大盘蓝筹股指数。其中以创业板指和中小板指为代表的中小盘指数位居涨幅前列，全年分别上涨了 84.41%和 53.70%，而以沪深 300 和中证 100 指数为代表的大盘蓝筹股指数同期涨跌幅分别为 5.58%和-1.52%。

本基金成立于 2015 年 6 月 4 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 1.0358 元，本报告期内基金份额净值增长率为-38.97%，同期业绩比较基准增长率为-24.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外方面，2015 年美国复苏的势头放缓，欧元区经济得到逐步改善，日本表现平稳，而主要新兴市场国家经济持续表现疲软。预计 2016 年全球经济将继续缓慢复苏，目前来看全球经济复苏的主要风险是需求低迷、大宗商品熊市带来的通缩压力，以及美国与其他地区的货币政策分化。国内市场，中国经济增速将进一步探底，我们对中国经济的企稳复苏抱有信心。中央经济工作会议提出 2016 年去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大结构性改革重点任务。随着供给侧改革信号的释放，结构调整步伐将加快，稳增长底线放宽，未来积极财政政策力度有望加大，以托底经济，为转型去化提供条件。货币政策以降准及定向工具为主，将继续维持流动性宽松，有序控制汇率波动及资本流动，人民币汇率贬值空间有限。资本市场在经历了 2015 年下半年的大幅调整和较长时间的震荡整固后，风险释放较为充分。中证 1000 指数是小市值股票组合的代表，其成份股为中证 800 指数样本股之外综合考虑规模和流动性选取 1000 只股票，全面覆盖了计算机、医药生物、机械设备、化工、电子、房地产、有色金属等 28 个行业。作为小盘宽基指数的代表，中证 1000 指数的小盘风格特征明显，投资者可以通过投资中证 1000 指数在大小盘风格轮动的结构性机会中把握小盘股投资机会。中长期来看，“大众创业、万众创新”经济转型与改革的战略将继续给小市值的股票带来高成长性，伴随这些经济转型与改革的措施真正开始释放红利，小市值公司的创新潜能将不断被挖掘，小盘股未来潜力大，投资价值明显。

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

4.6 管理人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《个人承诺书》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。2015 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，不断加强了防控内幕交易等行为的稽核力度；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

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(2016)第 21007 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 1000 指数分级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 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“华宝兴业中证 1000 指数基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 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	<p>一、管理层对财务报表的责任</p> <p>编制和公允列报财务报表是华宝兴业中证 1000 指数基金的基金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>二、注册会计师的责任</p> <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>三、审计意见</p> <p>我们认为,上述华宝兴业中证 1000 指数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</p>

	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 1000 指数基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	张勇
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	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2016 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 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	13,943,193.59
结算备付金		266,900.57
存出保证金		164,756.91
交易性金融资产	7.4.7.2	170,287,578.29
其中：股票投资		170,287,578.29
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	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	3,414.32
应收股利		-
应收申购款		51,297.13
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		184,717,140.81
负债和所有者权益	附注号	本期末

2015 年 12 月 31 日		
负 债:		
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		3,757,175.38
应付赎回款		77,404.07
应付管理人报酬		149,128.30
应付托管费		32,808.25
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	270,361.23
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	240,291.69
负债合计		4,527,168.92
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	295,270,982.70
未分配利润	7.4.7.10	-115,081,010.81
所有者权益合计		180,189,971.89
负债和所有者权益总计		184,717,140.81

注:

1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 华宝中证 1000 份额基金份额净值 1.0358 元, 基金份额总额 158,437,073.30 份; 华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0024 元, 基金份额总额 7,765,201.00 份; 华宝中证 1000B 份额基金份额净值 1.0692 元, 基金份额总额 7,765,201.00 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 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: 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-130,969,927.95
1.利息收入		186,879.21

其中：存款利息收入	7.4.7.11	186,879.21
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-122,460,859.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-122,638,685.64
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	177,826.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,893,986.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	198,039.24
减：二、费用		2,481,077.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	982,595.93
2. 托管费	7.4.10.2.2	216,171.08
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	919,831.82
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	362,478.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-133,451,005.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-133,451,005.28

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	330,711,104.54	-	330,711,104.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-133,451,005.28	-133,451,005.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-35,440,121.84	18,369,994.47	-17,070,127.37
其中：1. 基金申购款	212,083,623.68	-71,742,143.10	140,341,480.58
2. 基金赎回款	-247,523,745.52	90,112,137.57	-157,411,607.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	295,270,982.70	-115,081,010.81	180,189,971.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄小慧</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 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”)。本基金基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的份额配对转换业务，包括分拆与合并。申请进行分拆的华宝中证 1000 基础份额的场内份额数必须为偶数；申请进行合并的华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须为整数且相等。基金份额定期折算的频率为每年折算一次。定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元。当达到不定期折算条件(即华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值达到 1.5000 元或以上，或华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值跌至 0.2500 元或以下)时，本基金将分别对华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额进行份额折算，份额折算后华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的份额配比将保持为 1:1，份额折算后华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券和货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每

个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2016 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 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 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在存续期内，本基金(包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额)不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

差价收入不予征收营业税。

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

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

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

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 2015 年 12 月 31 日
活期存款	13,943,193.59
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	13,943,193.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	179,181,565.21	170,287,578.29	-8,893,986.92

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	179,181,565.21	170,287,578.29	-8,893,986.92

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 2015年12月31日
应收活期存款利息	3,200.57
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	132.11
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	81.62
合计	3,414.32

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 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	270,361.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	270,361.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付指数使用费	50,000.00	-
应付赎回费	291.69	-
预提费用	190,000.00	-
合计	240,291.69	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	330,711,104.54	330,711,104.54
本期申购	147,346,212.22	212,083,623.68
本期赎回(以“-”号填列)	-172,544,574.02	-247,523,745.52
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-131,545,267.44	-
本期末	173,967,475.30	295,270,982.70

注：

1. 本基金的基金份额包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。本期申购含申购的华宝中证 1000 基础份额和配对转入的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额，本期赎回含赎回的华宝中证 1000 基础份额和配对转出的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。
2. 本基金自 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 5 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 330,638,859.16 元。根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 72,245.38 元在本基金成立后，折算为 72,245.38 份基

金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 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，本基金于 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 15 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 2015 年 6 月 16 日起开始办理。

4. 本基金在 2015 年度共发生以下 2 次折算：

(1) 根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝兴业基金管理有限公司 2015 年 7 月 8 日发布的《关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的管理人华宝兴业基金管理有限公司以 2015 年 7 月 6 日为不定期折算基准日，对本基金进行不定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 252,533,954.50 份和 6,837,835.00 份，根据份额折算公式，份额折算比例为 0.581499992，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 146,848,494.54 份和 3,976,201.00 份，份额净值为 1.0000 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 30,138,016.00 份，根据份额折算公式，份额折算比例为 0.157300003，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 4,740,710.00 份，份额净值为 1.0000 元，新增华宝中证 1000 基础份额场内份额 25,569,091.00 份。折算前，华宝中证 1000B 份额总额为 30,138,016.00 份，根据份额折算公式，份额折算比例为 0.157300003，折算后华宝中证 1000B 份额总额为 4,740,710.00 份，份额净值为 1.0000 元。

(2) 根据《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝兴业基金管理有限公司 2015 年 12 月 17 日发布的《关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的管理人华宝兴业基金管理有限公司以 2015 年 12 月 15 日为定期折算基准日，对本基金进行定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 117,556,021.12 份和 35,627,978.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.013219540，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 119,110,057.64 份和 36,301,289.00 份，份额净值为 1.0070 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 7,652,573.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.026439080，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 7,652,573.00 份，份额净值为 1.0000 元。

5. 截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 56,418,243.00 份(其中华宝中证 1000 基础份额为 40,887,841.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 7,765,201.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 117,549,232.30 份，均为华宝中证 1000 基础份额。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登

记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	-124,557,018.36	-8,893,986.92	-133,451,005.28
本期基金份额交易产生的变动数	-5,115,959.92	23,485,954.39	18,369,994.47
其中：基金申购款	-55,490,412.92	-16,251,730.18	-71,742,143.10
基金赎回款	50,374,453.00	39,737,684.57	90,112,137.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-129,672,978.28	14,591,967.47	-115,081,010.81

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	179,212.25
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	6,552.96
其他	1,114.00
合计	186,879.21

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	201,881,098.32
减：卖出股票成本总额	324,519,783.96
买卖股票差价收入	-122,638,685.64

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	177,826.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	177,826.16

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-8,893,986.92
——股票投资	-8,893,986.92
——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	-8,893,986.92

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

基金赎回费收入	196,768.47
其他	1,270.77
合计	198,039.24

注：本基金场外的赎回费率按持有期间递减；场内的赎回费率为 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	919,831.82
银行间市场交易费用	-
合计	919,831.82

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00
信息披露费	150,000.00
基金上市费	65,000.00
银行汇划费用	2,945.72
指数使用费	104,532.78
合计	362,478.50

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

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
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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
	2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	982,595.93
其中：支付销售机构的客户维护费	358,760.46

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	216,171.08

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,943,193.59	179,212.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2015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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
600375	华菱星马	2015-11-18	重大资产重组	7.73	2016-03-23	6.96	11,600	156,163.01	89,668.00	-

600714	金瑞矿业	2015-12-02	重大资产重组	11.84	2016-03-04	13.02	3,800	56,699.80	44,992.00	-
600781	辅仁药业	2015-09-23	重大资产重组	19.36	2016-01-06	21.30	2,800	49,073.51	54,208.00	-
601996	丰林集团	2015-12-10	重大资产重组	9.12	未知	未知	7,700	102,161.17	70,224.00	-
600106	重庆路桥	2015-08-31	重大资产重组	10.54	2016-01-11	11.00	15,500	223,618.78	163,370.00	-
600133	东湖高新	2015-12-28	重要事项未公告	12.10	2016-01-12	10.89	15,800	159,024.78	191,180.00	-
600168	武汉控股	2015-10-08	重大资产重组	9.68	未知	未知	5,500	61,304.69	53,240.00	-
600237	铜峰电子	2015-09-29	重大资产重组	5.73	2016-01-27	6.30	11,000	150,684.29	63,030.00	-
600354	敦煌种业	2015-12-15	重大资产重组	9.88	2016-01-19	8.89	11,200	95,547.46	110,656.00	-
600420	现代制药	2015-10-21	重大资产重组	41.76	2016-03-23	33.44	3,900	152,007.73	162,864.00	-
600469	风神股份	2015-12-28	重大事项	17.19	未知	未知	7,000	103,344.68	120,330.00	-
600502	安徽水利	2015-10-20	重大资产重组	13.67	未知	未知	9,100	177,234.35	124,397.00	-
600565	迪马股份	2015-12-30	重要事项未公告	11.68	2016-01-07	11.03	43,800	558,004.63	511,584.00	-
600568	中珠控股	2015-12-30	重要事项未公告	23.94	2016-01-08	21.55	6,300	137,897.31	150,822.00	-
600595	中孚实业	2015-12-29	重要事项未公告	7.05	2016-01-19	6.35	32,500	218,276.02	229,125.00	-
600682	南京新百	2015-07-01	重大资产重组	32.98	2016-01-27	33.78	22,900	990,572.77	755,242.00	-
600740	山西焦化	2015-12-30	重要事项未公告	6.49	未知	未知	19,100	124,041.02	123,959.00	-
600771	广誉远	2015-11-17	重大资产重组	31.98	2016-03-09	28.78	5,800	263,392.03	185,484.00	-
600982	宁波热电	2015-10-21	重大资产重组	7.54	2016-02-25	6.80	6,700	44,829.51	50,518.00	-
600986	科达股份	2015-12-14	重大资产重组	21.00	未知	未知	7,900	165,710.00	165,900.00	-
600988	赤峰黄金	2015-08-31	重大事项	11.57	2016-01-05	12.73	6,100	135,006.09	70,577.00	-
600990	四创电子	2015-09-01	重大资产重组	62.75	未知	未知	1,800	145,218.42	112,950.00	-
600995	文山电力	2015-09-23	重大资产重组	9.22	2016-01-08	10.14	7,400	78,595.46	68,228.00	-
601058	赛轮金宇	2015-12-28	重要事项未公告	9.00	2016-01-12	8.10	26,000	302,765.53	234,000.00	-
601388	怡球资源	2015-07-28	重大资产重组	23.33	2016-02-15	21.00	14,200	364,444.43	331,286.00	-
002286	保龄宝	2015-08-03	重大资产重组	14.50	2016-02-24	15.95	9,300	157,025.58	134,850.00	-
002360	同德化工	2015-12-03	重大事项	12.32	2016-01-05	11.09	7,700	114,452.43	94,864.00	-
002481	双塔食品	2015-07-07	重大资产重组	13.88	2016-01-04	12.49	26,750	478,263.72	371,290.00	-
002514	宝馨科技	2015-07-08	重大事项	14.80	2016-01-08	16.28	4,400	148,619.54	65,120.00	-

002582	好想你	2015-09-17	重大资产重组	15.62	2016-02-24	17.18	1,700	64,200.16	26,554.00	-
000035	中国天楹	2015-12-14	重大资产重组	15.35	2016-02-18	13.82	11,200	209,672.43	171,920.00	-
000058	深赛格	2015-11-04	重大资产重组	11.85	2016-02-25	13.04	9,100	175,755.19	107,835.00	-
000065	北方国际	2015-10-21	重大资产重组	30.53	2016-03-15	27.48	2,400	113,256.68	73,272.00	-
000153	丰原药业	2015-10-14	重大资产重组	10.44	未知	未知	5,300	89,668.82	55,332.00	-
000553	沙隆达 A	2015-08-05	重大资产重组	10.70	未知	未知	9,100	100,791.00	97,370.00	-
000657	中钨高新	2015-08-05	重大资产重组	16.01	2016-02-25	16.30	9,100	238,961.06	145,691.00	-
000767	漳泽电力	2015-12-30	重大事项	5.77	2016-01-04	6.10	35,100	232,788.02	202,527.00	-
000901	航天科技	2015-08-19	重大资产重组	52.88	2016-02-18	47.59	7,000	495,444.40	370,160.00	-
000909	数源科技	2015-12-28	重大事项	18.68	2016-01-20	16.81	5,500	74,728.15	102,740.00	-
000925	众合科技	2015-11-03	重大资产重组	18.48	未知	未知	5,300	179,562.47	97,944.00	-
000968	煤气化	2015-12-24	重大资产重组	8.71	未知	未知	8,000	60,665.11	69,680.00	-
002020	京新药业	2015-12-29	重大事项	33.55	2016-01-20	30.20	6,200	178,724.00	208,010.00	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大资产重组	13.91	2016-01-21	21.21	35,980	794,738.33	500,481.80	-
002207	准油股份	2015-12-16	重大资产重组	21.42	未知	未知	5,800	149,519.63	124,236.00	-
002228	合兴包装	2015-08-04	重大事项	16.88	2016-02-02	15.21	5,400	200,739.44	91,152.00	-
002231	奥维通信	2015-12-03	重大资产重组	16.36	2016-03-17	16.00	7,000	160,593.90	114,520.00	-
002235	安妮股份	2015-07-02	重大资产重组	29.10	2016-01-12	32.00	7,300	279,839.93	212,430.00	-
002246	北化股份	2015-11-23	重大资产重组	14.12	未知	未知	6,800	86,250.01	96,016.00	-
002313	日海通讯	2015-08-10	重大事项	14.92	2016-01-22	13.90	8,500	119,133.71	126,820.00	-
002320	海峡股份	2015-06-25	重大资产重组	27.43	2016-01-07	24.69	9,100	283,927.66	249,613.00	-
002379	鲁丰环保	2015-10-22	重大事项	4.34	未知	未知	15,400	92,970.02	66,836.00	-
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事项	40.35	2016-03-17	36.32	4,200	211,579.02	169,470.00	-
002434	万里扬	2015-11-25	重大资产重组	23.05	未知	未知	6,700	107,233.46	154,435.00	-
002483	润邦股份	2015-09-30	重大事项	15.65	2016-03-11	10.38	3,400	80,564.66	53,210.00	-
002502	骅威股份	2015-08-20	重大资产重组	32.02	2016-01-14	23.35	4,300	133,972.76	137,686.00	-
002542	中化岩土	2015-12-28	重大事项	13.59	未知	未知	9,700	132,883.65	131,823.00	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大资产重组	29.65	未知	未知	5,500	198,496.67	163,075.00	-

002567	唐人神	2015-11-24	重大事项	12.84	2016-02-25	11.56	6,900	100,745.96	88,596.00	-
002612	朗姿股份	2015-12-22	重大事项	75.46	未知	未知	2,500	158,785.00	188,650.00	-
002622	永大集团	2015-07-02	重大资产重组	25.28	2016-01-08	27.81	6,700	253,537.71	169,376.00	-
002631	德尔未来	2015-11-27	重大事项	29.07	未知	未知	6,400	192,337.47	186,048.00	-
002638	勤上光电	2015-08-29	重大资产重组	15.32	2016-01-19	16.85	6,400	161,398.84	98,048.00	-
002664	信质电机	2015-12-30	重大事项	31.77	2016-03-08	28.59	6,200	230,626.35	196,974.00	-
002707	众信旅游	2015-11-16	重大资产重组	52.62	2015-03-15	47.36	5,000	279,804.11	263,100.00	-
300010	立思辰	2015-12-30	重大事项	31.90	2016-01-08	28.71	12,800	506,535.90	408,320.00	-
300011	鼎汉技术	2015-12-31	重大事项	29.80	2016-01-22	26.82	8,100	238,706.71	241,380.00	-
300025	华星创业	2015-11-26	重大资产重组	30.15	未知	未知	4,200	120,995.64	126,630.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大资产重组	56.68	未知	未知	2,900	153,976.61	164,372.00	-
300049	福瑞股份	2015-11-30	重大资产重组	31.00	2016-01-04	30.95	6,000	202,354.69	186,000.00	-
300054	鼎龙股份	2015-11-23	重大资产重组	24.66	2015-03-14	22.19	8,700	245,775.57	214,542.00	-
300162	雷曼股份	2015-11-02	重大资产重组	23.86	2016-02-29	21.47	3,600	80,583.43	85,896.00	-
300197	铁汉生态	2015-12-30	重大事项	17.11	2016-01-07	16.59	10,100	203,131.46	172,811.00	-
300222	科大智能	2015-08-21	重大资产重组	20.84	2016-01-07	21.16	5,220	156,505.10	108,784.80	-
300238	冠昊生物	2015-11-12	重大资产重组	55.14	未知	未知	5,100	251,803.70	281,214.00	-
300323	华灿光电	2015-12-29	重大事项	10.18	2016-01-04	10.20	10,500	83,090.83	106,890.00	-
300324	旋极信息	2015-12-01	重大资产重组	49.25	2016-03-10	44.33	4,691	186,672.58	231,031.75	-
300326	凯利泰	2015-09-24	重大资产重组	27.92	2016-01-22	23.98	2,100	88,954.05	58,632.00	-
300331	苏大维格	2015-11-16	重大资产重组	25.69	未知	未知	3,300	105,901.35	84,777.00	-
300336	新文化	2015-12-25	重大事项	42.00	未知	未知	6,700	220,035.85	281,400.00	-
300349	金卡股份	2015-11-20	重大资产重组	37.75	未知	未知	1,800	79,001.38	67,950.00	-
300351	永贵电器	2015-10-19	重大资产重组	31.30	2016-02-18	29.80	2,200	107,418.88	68,860.00	-
300355	蒙草抗旱	2015-12-14	重大事项	17.84	2016-02-16	16.06	7,100	153,355.86	126,664.00	-
合计									13,231,743.35	

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌
的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 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

本基金是一只指数型的分级证券投资基金，华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征；华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现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是通过结合定性分析和定量分析方法，估

测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能

自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 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 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1 年至 5 年以 5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,943,193.59	-	-	-	13,943,193.59
结算备付金	266,900.57	-	-	-	266,900.57

存出保证金	164,756.91	-	-	-	164,756.91
交易性金融资产	-	-	-	170,287,578.29	170,287,578.29
应收利息	-	-	-	3,414.32	3,414.32
应收申购款	6,092.21	-	-	45,204.92	51,297.13
资产总计	14,380,943.28	-	-	170,336,197.53	184,717,140.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,757,175.38	3,757,175.38
应付赎回款	-	-	-	77,404.07	77,404.07
应付管理人报酬	-	-	-	149,128.30	149,128.30
应付托管费	-	-	-	32,808.25	32,808.25
应付交易费用	-	-	-	270,361.23	270,361.23
其他负债	-	-	-	240,291.69	240,291.69
负债总计	-	-	-	4,527,168.92	4,527,168.92
利率敏感度缺口	14,380,943.28	-	-	165,809,028.61	180,189,971.89

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 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。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数，通过指

数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 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	170,287,578.29	94.50
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	170,287,578.29	94.50

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 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 2015 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 157,055,834.94 元,属于第二层次的余额为 13,231,743.35 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,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,287,578.29	92.19
	其中:股票	170,287,578.29	92.19
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	14,210,094.16	7.69
7	其他各项资产	219,468.36	0.12
8	合计	184,717,140.81	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,778,879.00	0.99
B	采矿业	3,156,853.74	1.75
C	制造业	109,427,594.24	60.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,039,596.00	2.24
E	建筑业	3,536,801.00	1.96
F	批发和零售业	8,987,749.40	4.99
G	交通运输、仓储和邮政业	5,296,722.80	2.94
H	住宿和餐饮业	235,022.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,825,138.25	9.34
J	金融业	125,955.00	0.07
K	房地产业	7,890,247.00	4.38
L	租赁和商务服务业	1,216,258.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	1,459,990.20	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	902,573.00	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	158,301.00	0.09
Q	卫生和社会工作	298,178.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	2,133,391.00	1.18
S	综合	1,866,558.66	1.04

	合计	169,335,808.29	93.98
--	----	----------------	-------

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	44,992.00	0.02
C	制造业	906,778.00	0.50
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	-	-
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	951,770.00	0.53

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	600682	南京新百	22,900	755,242.00	0.42
2	000806	银河生物	20,900	596,277.00	0.33
3	300113	顺网科技	5,500	557,535.00	0.31
4	300079	数码视讯	43,800	530,856.00	0.29
5	600565	迪马股份	43,800	511,584.00	0.28
6	002075	沙钢股份	35,980	500,481.80	0.28
7	300383	光环新网	8,700	484,677.00	0.27
8	002176	江特电机	27,420	482,592.00	0.27
9	002426	胜利精密	18,500	481,370.00	0.27
10	002407	多氟多	6,300	480,438.00	0.27
11	300208	恒顺众昇	19,450	472,635.00	0.26
12	600666	奥瑞德	9,800	462,952.00	0.26
13	002268	卫士通	8,200	460,922.00	0.26
14	002460	赣锋锂业	7,200	453,096.00	0.25
15	000938	紫光股份	4,600	452,548.00	0.25
16	002491	通鼎互联	22,800	441,864.00	0.25
17	002104	恒宝股份	18,076	433,643.24	0.24
18	300188	美亚柏科	8,500	430,950.00	0.24
19	000410	沈阳机床	17,000	425,340.00	0.24
20	300333	兆日科技	8,600	412,800.00	0.23
21	300142	沃森生物	31,200	411,216.00	0.23
22	300010	立思辰	12,800	408,320.00	0.23
23	300077	国民技术	9,000	406,620.00	0.23
24	600652	游久游戏	18,500	403,670.00	0.22
25	600687	刚泰控股	17,080	402,746.40	0.22
26	300136	信维通信	13,300	393,015.00	0.22
27	300287	飞利信	21,700	392,770.00	0.22
28	000687	华讯方舟	14,400	389,088.00	0.22
29	000516	国际医学	17,500	385,000.00	0.21
30	300156	神雾环保	7,700	384,923.00	0.21
31	300078	思创医惠	7,880	384,544.00	0.21
32	600391	成发科技	7,300	378,578.00	0.21
33	002131	利欧股份	19,200	374,400.00	0.21

34	002467	二六三	17,700	371,523.00	0.21
35	300001	特锐德	12,800	371,200.00	0.21
36	000901	航天科技	7,000	370,160.00	0.21
37	000627	天茂集团	34,400	370,144.00	0.21
38	300101	振芯科技	12,400	365,924.00	0.20
39	300170	汉得信息	18,400	365,240.00	0.20
40	002366	台海核电	5,500	362,725.00	0.20
41	002572	索菲亚	8,400	362,040.00	0.20
42	600756	浪潮软件	7,000	360,010.00	0.20
43	300009	安科生物	8,300	359,224.00	0.20
44	600728	佳都科技	9,600	357,888.00	0.20
45	300020	银江股份	14,500	355,540.00	0.20
46	300367	东方网力	5,100	355,470.00	0.20
47	300216	千山药机	8,000	352,640.00	0.20
48	002123	荣信股份	13,700	351,405.00	0.20
49	300203	聚光科技	10,100	346,329.00	0.19
50	002089	新海宜	15,300	344,403.00	0.19
51	000875	吉电股份	37,100	340,949.00	0.19
52	300207	欣旺达	12,000	337,200.00	0.19
53	300271	华宇软件	7,100	337,108.00	0.19
54	002055	得润电子	8,600	332,476.00	0.18
55	600662	强生控股	20,100	332,253.00	0.18
56	601388	怡球资源	14,200	331,286.00	0.18
57	002474	榕基软件	13,800	330,510.00	0.18
58	600777	新潮实业	19,100	325,273.00	0.18
59	002002	鸿达兴业	12,400	323,268.00	0.18
60	000882	华联股份	56,500	322,615.00	0.18
61	300297	蓝盾股份	15,400	320,474.00	0.18
62	002589	瑞康医药	8,900	319,599.00	0.18
63	600172	黄河旋风	12,600	318,906.00	0.18
64	002224	三力士	14,600	317,112.00	0.18
65	300090	盛运环保	26,900	314,999.00	0.17
66	300159	新研股份	18,900	313,740.00	0.17
67	600343	航天动力	12,200	311,954.00	0.17
68	002067	景兴纸业	34,700	309,871.00	0.17
69	002303	美盈森	22,700	309,855.00	0.17
70	002462	嘉事堂	6,100	308,782.00	0.17
71	002023	海特高新	16,800	308,112.00	0.17
72	002070	众和股份	14,100	307,944.00	0.17

73	002074	国轩高科	8,200	304,220.00	0.17
74	600701	工大高新	12,700	303,911.00	0.17
75	600165	新日恒力	13,050	303,151.50	0.17
76	002260	德奥通航	6,700	302,840.00	0.17
77	600653	申华控股	55,400	300,822.00	0.17
78	000666	经纬纺机	10,000	300,500.00	0.17
79	600210	紫江企业	38,500	300,300.00	0.17
80	300178	腾邦国际	10,300	299,730.00	0.17
81	300347	泰格医药	9,700	298,178.00	0.17
82	002501	利源精制	23,700	298,146.00	0.17
83	002329	皇氏集团	10,640	296,856.00	0.16
84	600667	太极实业	26,500	295,475.00	0.16
85	000802	北京文化	8,700	294,756.00	0.16
86	002095	生意宝	4,000	294,360.00	0.16
87	300096	易联众	11,000	293,370.00	0.16
88	600711	盛屯矿业	38,000	291,460.00	0.16
89	002130	沃尔核材	12,700	291,084.00	0.16
90	600855	航天长峰	7,300	289,664.00	0.16
91	300166	东方国信	9,000	288,270.00	0.16
92	000670	盈方微	18,100	287,066.00	0.16
93	002699	美盛文化	5,600	286,160.00	0.16
94	002318	久立特材	18,700	286,110.00	0.16
95	002512	达华智能	12,647	285,822.20	0.16
96	300098	高新兴	13,520	283,784.80	0.16
97	002471	中超控股	28,200	283,692.00	0.16
98	600650	锦江投资	6,200	283,588.00	0.16
99	002364	中恒电气	10,000	282,100.00	0.16
100	600630	龙头股份	9,500	281,960.00	0.16
101	600495	晋西车轴	26,880	281,433.60	0.16
102	300336	新文化	6,700	281,400.00	0.16
103	300238	冠昊生物	5,100	281,214.00	0.16
104	002019	亿帆鑫富	7,000	280,000.00	0.16
105	002185	华天科技	15,600	279,708.00	0.16
106	002283	天润曲轴	12,500	279,000.00	0.15
107	002215	诺普信	14,500	278,110.00	0.15
108	002389	南洋科技	13,600	277,168.00	0.15
109	002630	华西能源	18,700	276,199.00	0.15
110	600634	中技控股	12,800	276,096.00	0.15
111	300359	全通教育	3,200	275,584.00	0.15

112	600567	山鹰纸业	71,800	272,840.00	0.15
113	002261	拓维信息	7,000	272,300.00	0.15
114	601588	北辰实业	50,700	271,752.00	0.15
115	002031	巨轮智能	16,300	270,906.00	0.15
116	600399	抚顺特钢	28,900	270,793.00	0.15
117	600186	莲花味精	33,700	270,611.00	0.15
118	300379	东方通	2,200	269,918.00	0.15
119	000008	神州高铁	22,900	269,762.00	0.15
120	002047	宝鹰股份	24,000	269,760.00	0.15
121	002550	千红制药	12,200	269,620.00	0.15
122	002421	达实智能	12,300	269,370.00	0.15
123	300339	润和软件	5,600	268,912.00	0.15
124	002555	顺荣三七	5,500	268,730.00	0.15
125	002721	金一文化	8,200	268,632.00	0.15
126	300352	北信源	4,300	268,320.00	0.15
127	300068	南都电源	13,500	267,840.00	0.15
128	300212	易华录	5,800	267,786.00	0.15
129	600130	波导股份	24,300	267,057.00	0.15
130	300075	数字政通	8,500	266,475.00	0.15
131	000089	深圳机场	32,600	266,016.00	0.15
132	300288	朗玛信息	4,300	265,396.00	0.15
133	600862	南通科技	13,300	264,537.00	0.15
134	000601	韶能股份	24,000	264,240.00	0.15
135	002707	众信旅游	5,000	263,100.00	0.15
136	000733	振华科技	10,500	262,500.00	0.15
137	002117	东港股份	5,700	262,314.00	0.15
138	300032	金龙机电	8,600	261,440.00	0.15
139	600626	申达股份	15,800	261,332.00	0.15
140	600730	中国高科	14,900	259,707.00	0.14
141	002522	浙江众成	14,000	259,420.00	0.14
142	300252	金信诺	6,400	258,560.00	0.14
143	002429	兆驰股份	20,300	257,607.00	0.14
144	600562	国睿科技	4,100	254,979.00	0.14
145	600677	航天通信	11,600	254,504.00	0.14
146	600206	有研新材	16,000	254,400.00	0.14
147	000902	新洋丰	8,300	252,735.00	0.14
148	600602	仪电电子	19,700	251,963.00	0.14
149	000801	四川九洲	8,100	250,533.00	0.14
150	600291	西水股份	8,600	250,346.00	0.14

151	002320	海峡股份	9,100	249,613.00	0.14
152	600571	信雅达	4,200	248,136.00	0.14
153	002376	新北洋	13,400	247,632.00	0.14
154	600063	皖维高新	36,600	247,050.00	0.14
155	000158	常山股份	12,100	246,235.00	0.14
156	000016	深康佳 A	35,500	245,305.00	0.14
157	002312	三泰控股	8,800	244,640.00	0.14
158	600255	鑫科材料	45,000	243,900.00	0.14
159	002583	海能达	19,480	243,305.20	0.14
160	600620	天宸股份	11,700	242,658.00	0.13
161	600303	曙光股份	15,800	242,530.00	0.13
162	002288	超华科技	20,700	241,776.00	0.13
163	300011	鼎汉技术	8,100	241,380.00	0.13
164	002411	九九久	12,000	240,600.00	0.13
165	002151	北斗星通	4,600	240,028.00	0.13
166	600577	精达股份	37,200	239,940.00	0.13
167	300171	东富龙	8,000	239,840.00	0.13
168	300269	联建光电	8,000	239,520.00	0.13
169	000958	东方能源	9,300	239,196.00	0.13
170	300047	天源迪科	8,200	238,620.00	0.13
171	002138	顺络电子	16,500	236,775.00	0.13
172	002339	积成电子	9,700	236,680.00	0.13
173	300296	利亚德	9,400	235,000.00	0.13
174	002443	金洲管道	13,200	234,696.00	0.13
175	000851	高鸿股份	15,000	234,450.00	0.13
176	300111	向日葵	35,600	234,248.00	0.13
177	601058	赛轮金宇	26,000	234,000.00	0.13
178	002298	鑫龙电器	12,100	232,441.00	0.13
179	000518	四环生物	32,700	232,170.00	0.13
180	600096	云天化	17,900	232,163.00	0.13
181	600330	天通股份	15,800	232,102.00	0.13
182	002488	金固股份	8,000	232,000.00	0.13
183	000989	九芝堂	7,200	231,984.00	0.13
184	300302	同有科技	3,200	231,840.00	0.13
185	002099	海翔药业	9,700	231,345.00	0.13
186	600363	联创光电	11,300	231,085.00	0.13
187	300324	旋极信息	4,691	231,031.75	0.13
188	600139	西部资源	12,600	230,454.00	0.13
189	300137	先河环保	11,000	230,450.00	0.13

190	002037	久联发展	8,300	230,408.00	0.13
191	000751	锌业股份	35,800	229,836.00	0.13
192	000682	东方电子	31,100	229,829.00	0.13
193	600238	海南椰岛	14,200	229,756.00	0.13
194	600595	中孚实业	32,500	229,125.00	0.13
195	002625	龙生股份	4,700	228,655.00	0.13
196	600836	界龙实业	7,300	228,563.00	0.13
197	000036	华联控股	25,400	227,838.00	0.13
198	002154	报喜鸟	29,800	226,778.00	0.13
199	002600	江粉磁材	19,500	226,590.00	0.13
200	000790	华神集团	13,700	226,050.00	0.13
201	600405	动力源	13,500	225,990.00	0.13
202	600589	广东榕泰	13,400	224,986.00	0.12
203	600297	广汇汽车	17,500	224,700.00	0.12
204	601890	亚星锚链	18,300	224,541.00	0.12
205	300005	探路者	9,800	224,420.00	0.12
206	300310	宜通世纪	3,600	224,388.00	0.12
207	300016	北陆药业	6,300	223,713.00	0.12
208	600767	运盛医疗	10,900	223,123.00	0.12
209	600622	嘉宝集团	13,100	222,569.00	0.12
210	002121	科陆电子	7,500	222,000.00	0.12
211	000422	湖北宜化	28,500	221,445.00	0.12
212	002010	传化股份	9,400	221,370.00	0.12
213	002602	世纪华通	6,500	221,325.00	0.12
214	000760	斯太尔	12,300	220,908.00	0.12
215	300014	亿纬锂能	6,700	219,894.00	0.12
216	002170	芭田股份	16,700	219,104.00	0.12
217	300245	天玑科技	5,200	218,556.00	0.12
218	002433	太安堂	14,700	218,442.00	0.12
219	300285	国瓷材料	4,800	218,400.00	0.12
220	300045	华力创通	8,900	217,694.00	0.12
221	000807	云铝股份	30,200	217,138.00	0.12
222	002197	证通电子	8,100	216,108.00	0.12
223	002581	未名医药	6,200	215,574.00	0.12
224	002326	永太科技	10,200	214,608.00	0.12
225	300054	鼎龙股份	8,700	214,542.00	0.12
226	002448	中原内配	15,000	213,900.00	0.12
227	600550	保变电气	24,300	213,840.00	0.12
228	300004	南风股份	8,000	212,720.00	0.12

229	002235	安妮股份	7,300	212,430.00	0.12
230	002497	雅化集团	24,300	212,382.00	0.12
231	300332	天壕环境	8,700	212,280.00	0.12
232	600818	中路股份	3,800	212,040.00	0.12
233	000735	罗牛山	28,000	211,960.00	0.12
234	300463	迈克生物	1,800	211,302.00	0.12
235	002636	金安国纪	9,300	211,296.00	0.12
236	600269	赣粤高速	37,100	210,728.00	0.12
237	002177	御银股份	19,300	209,405.00	0.12
238	600105	永鼎股份	9,100	209,391.00	0.12
239	300012	华测检测	8,500	209,015.00	0.12
240	002108	沧州明珠	11,800	208,506.00	0.12
241	002649	博彦科技	3,700	208,236.00	0.12
242	600713	南京医药	19,900	208,154.00	0.12
243	002097	山河智能	19,200	208,128.00	0.12
244	002020	京新药业	6,200	208,010.00	0.12
245	000996	中国中期	7,300	206,809.00	0.11
246	002527	新时达	9,400	206,706.00	0.11
247	002658	雪迪龙	7,600	206,644.00	0.11
248	002577	雷柏科技	3,600	205,992.00	0.11
249	600824	益民集团	23,400	205,920.00	0.11
250	002296	辉煌科技	9,600	205,248.00	0.11
251	600775	南京熊猫	10,700	204,905.00	0.11
252	300053	欧比特	5,018	204,483.50	0.11
253	600400	红豆股份	9,100	204,204.00	0.11
254	002494	华斯股份	7,700	204,050.00	0.11
255	002468	艾迪西	5,200	203,476.00	0.11
256	000819	岳阳兴长	5,400	202,824.00	0.11
257	000767	漳泽电力	35,100	202,527.00	0.11
258	300263	隆华节能	7,000	202,300.00	0.11
259	002331	皖通科技	7,400	200,392.00	0.11
260	300128	锦富新材	7,900	200,186.00	0.11
261	002425	凯撒股份	6,900	200,031.00	0.11
262	300131	英唐智控	8,500	199,835.00	0.11
263	002564	天沃科技	16,400	199,752.00	0.11
264	300228	富瑞特装	6,400	199,680.00	0.11
265	300231	银信科技	7,400	198,912.00	0.11
266	000705	浙江震元	10,600	198,856.00	0.11
267	002367	康力电梯	11,800	197,886.00	0.11

268	603308	应流股份	6,300	197,316.00	0.11
269	600624	复旦复华	11,700	197,262.00	0.11
270	300226	上海钢联	3,886	197,020.20	0.11
271	002664	信质电机	6,200	196,974.00	0.11
272	002355	兴民钢圈	9,800	196,588.00	0.11
273	002229	鸿博股份	6,600	196,416.00	0.11
274	002445	中南重工	7,000	196,350.00	0.11
275	000936	华西股份	14,100	196,272.00	0.11
276	300300	汉鼎股份	6,000	196,260.00	0.11
277	600323	瀚蓝环境	12,200	195,810.00	0.11
278	300364	中文在线	1,100	195,800.00	0.11
279	600020	中原高速	28,600	195,624.00	0.11
280	600559	老白干酒	3,249	195,492.33	0.11
281	600185	格力地产	9,200	195,408.00	0.11
282	002610	爱康科技	16,100	195,132.00	0.11
283	600555	九龙山	21,600	194,832.00	0.11
284	002618	丹邦科技	4,000	194,640.00	0.11
285	600552	方兴科技	8,600	194,618.00	0.11
286	002284	亚太股份	9,400	194,392.00	0.11
287	600331	宏达股份	25,900	194,250.00	0.11
288	300183	东软载波	7,200	194,184.00	0.11
289	600288	大恒科技	11,100	194,139.00	0.11
290	600668	尖峰集团	11,000	193,820.00	0.11
291	600856	中天能源	7,200	193,680.00	0.11
292	002476	宝莫股份	19,400	193,612.00	0.11
293	600466	蓝光发展	13,500	193,320.00	0.11
294	600676	交运股份	13,700	193,307.00	0.11
295	300284	苏交科	8,900	192,952.00	0.11
296	300368	汇金股份	3,400	192,848.00	0.11
297	002086	东方海洋	6,500	192,400.00	0.11
298	000920	南方汇通	8,000	192,240.00	0.11
299	300392	腾信股份	4,800	192,096.00	0.11
300	600107	美尔雅	9,200	191,912.00	0.11
301	300007	汉威电子	5,600	191,520.00	0.11
302	600133	东湖高新	15,800	191,180.00	0.11
303	600846	同济科技	15,900	190,164.00	0.11
304	002094	青岛金王	6,100	190,015.00	0.11
305	600621	华鑫股份	13,300	188,993.00	0.10
306	600794	保税科技	26,500	188,680.00	0.10

307	002612	朗姿股份	2,500	188,650.00	0.10
308	002509	天广消防	9,000	188,550.00	0.10
309	300118	东方日升	12,900	187,953.00	0.10
310	600526	菲达环保	10,500	187,215.00	0.10
311	002256	彩虹精化	7,000	187,110.00	0.10
312	002510	天汽模	10,500	186,165.00	0.10
313	600686	金龙汽车	9,700	186,143.00	0.10
314	002631	德尔未来	6,400	186,048.00	0.10
315	300049	福瑞股份	6,000	186,000.00	0.10
316	600033	福建高速	43,600	185,736.00	0.10
317	300157	恒泰艾普	15,200	185,592.00	0.10
318	600771	广誉远	5,800	185,484.00	0.10
319	002245	澳洋顺昌	18,500	185,370.00	0.10
320	300229	拓尔思	5,900	185,260.00	0.10
321	601222	林洋能源	5,031	184,788.63	0.10
322	600438	通威股份	13,000	184,730.00	0.10
323	600149	廊坊发展	12,091	184,508.66	0.10
324	002178	延华智能	13,900	184,314.00	0.10
325	000607	华媒控股	13,000	183,950.00	0.10
326	600527	江南高纤	25,500	183,600.00	0.10
327	002436	兴森科技	9,500	182,875.00	0.10
328	002279	久其软件	2,700	182,790.00	0.10
329	600360	华微电子	18,700	181,951.00	0.10
330	000952	广济药业	7,900	181,700.00	0.10
331	002156	通富微电	9,500	181,355.00	0.10
332	000731	四川美丰	18,800	181,232.00	0.10
333	300135	宝利国际	20,500	181,220.00	0.10
334	300276	三丰智能	7,100	180,766.00	0.10
335	600290	华仪电气	11,700	180,297.00	0.10
336	600285	羚锐制药	13,600	180,200.00	0.10
337	300006	莱美药业	4,500	180,000.00	0.10
338	002717	岭南园林	4,100	179,990.00	0.10
339	002334	英威腾	15,900	179,829.00	0.10
340	601700	风范股份	18,000	179,820.00	0.10
341	300065	海兰信	4,700	179,540.00	0.10
342	002071	长城影视	10,100	179,275.00	0.10
343	002449	国星光电	10,600	179,140.00	0.10
344	601616	广电电气	20,800	179,088.00	0.10
345	300056	三维丝	8,300	179,031.00	0.10

346	000739	普洛药业	21,800	178,760.00	0.10
347	002585	双星新材	13,700	178,648.00	0.10
348	300295	三六五网	3,600	178,560.00	0.10
349	002262	恩华药业	6,100	178,547.00	0.10
350	300458	全志科技	1,500	178,500.00	0.10
351	002321	华英农业	13,500	178,335.00	0.10
352	002496	辉丰股份	6,300	178,290.00	0.10
353	300152	科融环境	15,900	178,239.00	0.10
354	000886	海南高速	25,100	178,210.00	0.10
355	600865	百大集团	8,300	178,201.00	0.10
356	300353	东土科技	7,300	178,120.00	0.10
357	002650	加加食品	21,900	177,828.00	0.10
358	000042	中洲控股	8,500	177,735.00	0.10
359	600638	新黄浦	12,500	177,625.00	0.10
360	300064	豫金刚石	12,900	177,504.00	0.10
361	600800	天津磁卡	15,500	176,545.00	0.10
362	300191	潜能恒信	4,000	176,400.00	0.10
363	002253	川大智胜	3,300	175,890.00	0.10
364	600093	禾嘉股份	10,700	175,159.00	0.10
365	300086	康芝药业	9,950	175,120.00	0.10
366	002447	壹桥海参	18,100	174,665.00	0.10
367	002263	大东南	17,900	174,525.00	0.10
368	000673	当代东方	5,000	174,500.00	0.10
369	002628	成都路桥	23,400	174,330.00	0.10
370	603008	喜临门	7,000	174,300.00	0.10
371	002643	万润股份	4,300	174,279.00	0.10
372	000301	东方市场	27,100	174,253.00	0.10
373	600123	兰花科创	21,700	174,251.00	0.10
374	600501	航天晨光	6,600	174,240.00	0.10
375	600789	鲁抗医药	13,000	173,550.00	0.10
376	600486	扬农化工	5,900	173,106.00	0.10
377	002111	威海广泰	5,700	172,995.00	0.10
378	002432	九安医疗	7,000	172,900.00	0.10
379	600382	广东明珠	10,900	172,874.00	0.10
380	300197	铁汉生态	10,100	172,811.00	0.10
381	600129	太极集团	8,100	172,773.00	0.10
382	002614	蒙发利	8,900	172,571.00	0.10
383	002592	八菱科技	3,900	172,380.00	0.10
384	000035	中国天楹	11,200	171,920.00	0.10

385	002689	博林特	15,300	171,819.00	0.10
386	000571	新大洲 A	20,700	171,810.00	0.10
387	002671	龙泉股份	9,900	171,666.00	0.10
388	002547	春兴精工	12,900	171,312.00	0.10
389	600815	厦工股份	18,300	170,922.00	0.09
390	002222	福晶科技	7,200	170,712.00	0.09
391	002596	海南瑞泽	3,900	170,625.00	0.09
392	600877	中国嘉陵	17,500	170,625.00	0.09
393	300318	博晖创新	6,500	170,625.00	0.09
394	000584	友利控股	13,700	170,291.00	0.09
395	002556	辉隆股份	9,200	170,108.00	0.09
396	000701	厦门信达	6,900	169,740.00	0.09
397	600239	云南城投	23,800	169,694.00	0.09
398	300037	新宙邦	2,900	169,650.00	0.09
399	000506	中润资源	17,700	169,566.00	0.09
400	600965	福成五丰	10,400	169,520.00	0.09
401	002383	合众思壮	4,200	169,470.00	0.09
402	300217	东方电热	10,200	169,422.00	0.09
403	002622	永大集团	6,700	169,376.00	0.09
404	600726	华电能源	24,300	169,371.00	0.09
405	002387	黑牛食品	9,000	168,120.00	0.09
406	002009	天奇股份	8,100	168,075.00	0.09
407	002416	爱施德	9,600	168,000.00	0.09
408	002080	中材科技	6,300	167,706.00	0.09
409	000828	东莞控股	13,200	167,640.00	0.09
410	300205	天喻信息	8,100	167,184.00	0.09
411	000910	大亚科技	10,100	167,054.00	0.09
412	002115	三维通信	10,500	166,635.00	0.09
413	000573	粤宏远 A	19,800	166,518.00	0.09
414	600986	科达股份	7,900	165,900.00	0.09
415	002604	龙力生物	11,200	165,760.00	0.09
416	002167	东方锆业	13,800	165,600.00	0.09
417	002033	丽江旅游	9,400	165,440.00	0.09
418	300369	绿盟科技	3,400	165,376.00	0.09
419	000700	模塑科技	6,800	165,036.00	0.09
420	002369	卓翼科技	12,400	164,920.00	0.09
421	002540	亚太科技	16,500	164,670.00	0.09
422	000576	广东甘化	8,400	164,640.00	0.09
423	300038	梅泰诺	2,900	164,372.00	0.09

424	601636	旗滨集团	32,100	164,031.00	0.09
425	600491	龙元建设	18,000	163,980.00	0.09
426	002441	众业达	7,400	163,910.00	0.09
427	600257	大湖股份	10,900	163,391.00	0.09
428	600106	重庆路桥	15,500	163,370.00	0.09
429	002453	天马精化	14,500	163,125.00	0.09
430	002544	杰赛科技	5,500	163,075.00	0.09
431	000407	胜利股份	19,600	162,876.00	0.09
432	600420	现代制药	3,900	162,864.00	0.09
433	002289	宇顺电子	4,700	162,526.00	0.09
434	002214	大立科技	10,200	161,976.00	0.09
435	000915	山大华特	4,600	161,736.00	0.09
436	002083	孚日股份	20,200	161,600.00	0.09
437	300485	赛升药业	1,100	161,590.00	0.09
438	600479	千金药业	7,700	161,469.00	0.09
439	000957	中通客车	6,600	161,238.00	0.09
440	600708	光明地产	12,600	161,154.00	0.09
441	300083	劲胜精密	3,400	160,888.00	0.09
442	600229	城市传媒	9,000	160,650.00	0.09
443	600684	珠江实业	15,800	160,212.00	0.09
444	000966	长源电力	10,600	159,954.00	0.09
445	600838	上海九百	10,200	159,834.00	0.09
446	300034	钢研高纳	6,100	159,820.00	0.09
447	002348	高乐股份	9,100	159,523.00	0.09
448	000837	秦川机床	11,000	159,280.00	0.09
449	300177	中海达	8,300	159,194.00	0.09
450	002021	中捷资源	13,100	159,165.00	0.09
451	002042	华孚色纺	13,200	159,060.00	0.09
452	002565	上海绿新	13,300	158,935.00	0.09
453	002609	捷顺科技	7,600	158,536.00	0.09
454	600661	新南洋	4,100	158,301.00	0.09
455	002526	山东矿机	13,600	158,032.00	0.09
456	002406	远东传动	12,500	158,000.00	0.09
457	002521	齐峰新材	12,600	157,500.00	0.09
458	300185	通裕重工	17,100	157,149.00	0.09
459	000533	万家乐	15,400	156,772.00	0.09
460	002259	升达林业	14,300	155,870.00	0.09
461	002446	盛路通信	4,200	155,820.00	0.09
462	000752	西藏发展	8,300	155,625.00	0.09

463	300073	当升科技	4,000	155,320.00	0.09
464	300219	鸿利光电	9,750	155,317.50	0.09
465	600590	泰豪科技	9,900	155,133.00	0.09
466	300071	华谊嘉信	10,900	154,780.00	0.09
467	002434	万里扬	6,700	154,435.00	0.09
468	002684	猛狮科技	5,300	154,230.00	0.09
469	002100	天康生物	15,300	153,918.00	0.09
470	600742	一汽富维	5,300	153,912.00	0.09
471	000055	方大集团	10,700	153,866.00	0.09
472	600135	乐凯胶片	7,100	153,786.00	0.09
473	601218	吉鑫科技	22,000	153,780.00	0.09
474	300051	三五互联	5,800	153,700.00	0.09
475	002454	松芝股份	8,000	153,520.00	0.09
476	002516	旷达科技	10,600	152,640.00	0.08
477	300204	舒泰神	4,300	152,392.00	0.08
478	000537	广宇发展	13,000	152,100.00	0.08
479	002561	徐家汇	9,300	151,683.00	0.08
480	002079	苏州固锴	13,900	151,649.00	0.08
481	600470	六国化工	13,300	151,221.00	0.08
482	000554	泰山石油	12,200	150,914.00	0.08
483	600035	楚天高速	23,000	150,880.00	0.08
484	600568	中珠控股	6,300	150,822.00	0.08
485	600322	天房发展	28,100	150,616.00	0.08
486	002184	海得控制	3,500	150,535.00	0.08
487	600209	罗顿发展	11,200	150,192.00	0.08
488	300322	硕贝德	7,700	150,150.00	0.08
489	600308	华泰股份	26,000	150,020.00	0.08
490	300193	佳士科技	11,260	149,870.60	0.08
491	000532	力合股份	5,400	149,472.00	0.08
492	300150	世纪瑞尔	10,300	149,350.00	0.08
493	603456	九洲药业	2,100	149,331.00	0.08
494	000523	广州浪奇	9,900	149,292.00	0.08
495	000987	广州友谊	5,700	149,283.00	0.08
496	600321	国栋建设	28,800	149,184.00	0.08
497	002166	莱茵生物	9,800	148,960.00	0.08
498	300074	华平股份	10,100	148,874.00	0.08
499	002584	西陇化工	3,000	148,800.00	0.08
500	300110	华仁药业	10,600	148,506.00	0.08
501	600012	皖通高速	11,100	148,407.00	0.08

502	600439	瑞贝卡	20,900	148,390.00	0.08
503	603128	华贸物流	12,900	148,350.00	0.08
504	300048	合康变频	7,000	148,330.00	0.08
505	002148	北纬通信	6,500	148,265.00	0.08
506	300224	正海磁材	6,400	148,224.00	0.08
507	000507	珠海港	20,000	148,200.00	0.08
508	000868	安凯客车	15,500	148,180.00	0.08
509	002297	博云新材	10,200	148,002.00	0.08
510	002107	沃华医药	5,700	147,801.00	0.08
511	600467	好当家	13,900	147,618.00	0.08
512	002126	银轮股份	8,000	147,600.00	0.08
513	600592	龙溪股份	8,900	146,939.00	0.08
514	600246	万通地产	19,300	146,680.00	0.08
515	002012	凯恩股份	14,900	146,616.00	0.08
516	600305	恒顺醋业	5,700	146,319.00	0.08
517	600223	鲁商置业	15,900	146,121.00	0.08
518	000536	华映科技	9,900	145,926.00	0.08
519	000657	中钨高新	9,100	145,691.00	0.08
520	600311	ST 荣华	21,100	145,590.00	0.08
521	600480	凌云股份	8,600	145,426.00	0.08
522	600834	申通地铁	7,500	145,350.00	0.08
523	300187	永清环保	2,700	144,990.00	0.08
524	002711	欧浦智网	4,140	144,982.80	0.08
525	002531	天顺风能	10,500	144,375.00	0.08
526	002135	东南网架	11,900	144,109.00	0.08
527	600055	华润万东	3,400	143,888.00	0.08
528	600973	宝胜股份	9,300	143,871.00	0.08
529	603609	禾丰牧业	10,600	143,842.00	0.08
530	300363	博腾股份	5,300	143,789.00	0.08
531	002538	司尔特	11,400	143,754.00	0.08
532	002255	海陆重工	13,800	143,658.00	0.08
533	600616	金枫酒业	11,498	143,495.04	0.08
534	600326	西藏天路	12,700	143,383.00	0.08
535	002162	悦心健康	10,400	143,104.00	0.08
536	000683	远兴能源	25,800	142,932.00	0.08
537	000589	黔轮胎 A	19,700	142,628.00	0.08
538	000096	广聚能源	8,300	142,262.00	0.08
539	000545	金浦钛业	15,700	142,085.00	0.08
540	300052	中青宝	4,900	142,051.00	0.08

541	600735	新华锦	5,900	141,718.00	0.08
542	002626	金达威	7,300	141,693.00	0.08
543	300248	新开普	3,800	141,170.00	0.08
544	600114	东睦股份	8,700	140,592.00	0.08
545	600318	巢东股份	4,600	140,576.00	0.08
546	002035	华帝股份	7,900	140,462.00	0.08
547	300356	光一科技	2,500	140,250.00	0.08
548	600193	创兴资源	9,500	140,125.00	0.08
549	002393	力生制药	2,900	140,070.00	0.08
550	300050	世纪鼎利	3,900	140,010.00	0.08
551	002751	易尚展示	1,300	139,620.00	0.08
552	603718	海利生物	2,700	138,942.00	0.08
553	002469	三维工程	8,600	138,890.00	0.08
554	600830	香溢融通	10,100	138,673.00	0.08
555	002611	东方精工	9,300	138,663.00	0.08
556	600162	香江控股	15,200	138,472.00	0.08
557	002341	新纶科技	8,300	138,195.00	0.08
558	600173	卧龙地产	13,800	138,000.00	0.08
559	600381	青海春天	6,500	137,930.00	0.08
560	300181	佐力药业	11,600	137,924.00	0.08
561	300080	易成新能	12,800	137,856.00	0.08
562	002502	骅威股份	4,300	137,686.00	0.08
563	002484	江海股份	5,300	137,270.00	0.08
564	603678	火炬电子	1,600	137,264.00	0.08
565	002338	奥普光电	1,900	137,237.00	0.08
566	002328	新朋股份	10,000	137,200.00	0.08
567	000517	荣安地产	20,200	137,158.00	0.08
568	000151	中成股份	5,600	136,864.00	0.08
569	600116	三峡水利	6,300	136,710.00	0.08
570	000948	南天信息	5,400	136,674.00	0.08
571	300348	长亮科技	1,800	136,422.00	0.08
572	000797	中国武夷	6,100	136,274.00	0.08
573	002232	启明信息	6,400	136,192.00	0.08
574	000722	湖南发展	7,300	135,999.00	0.08
575	002337	赛象科技	13,200	135,828.00	0.08
576	002324	普利特	4,300	135,794.00	0.08
577	002524	光正集团	12,800	135,680.00	0.08
578	002349	精华制药	3,500	135,450.00	0.08
579	600961	株冶集团	10,100	135,037.00	0.07

580	600488	天药股份	18,300	134,871.00	0.07
581	000606	青海明胶	7,300	134,758.00	0.07
582	000561	烽火电子	9,500	134,710.00	0.07
583	300215	电科院	6,800	134,640.00	0.07
584	000531	穗恒运 A	10,900	134,615.00	0.07
585	600119	长江投资	6,800	134,504.00	0.07
586	300076	GQY 视讯	4,000	134,480.00	0.07
587	002335	科华恒盛	2,800	134,400.00	0.07
588	002171	楚江新材	5,600	134,288.00	0.07
589	300130	新国都	3,600	134,172.00	0.07
590	600798	宁波海运	19,600	134,064.00	0.07
591	000548	湖南投资	11,100	133,755.00	0.07
592	300044	赛为智能	4,900	133,721.00	0.07
593	300190	维尔利	5,500	133,540.00	0.07
594	000409	山东地矿	10,407	133,417.74	0.07
595	002737	葵花药业	2,800	133,308.00	0.07
596	000428	华天酒店	13,000	133,250.00	0.07
597	002640	跨境通	4,000	133,200.00	0.07
598	300030	阳普医疗	6,800	133,008.00	0.07
599	002697	红旗连锁	17,240	132,920.40	0.07
600	603167	渤海轮渡	10,700	132,894.00	0.07
601	000404	华意压缩	14,200	132,770.00	0.07
602	300173	智慧松德	7,400	132,682.00	0.07
603	600987	航民股份	10,100	132,512.00	0.07
604	002486	嘉麟杰	21,100	132,508.00	0.07
605	002172	澳洋科技	8,900	132,432.00	0.07
606	300294	博雅生物	3,400	132,362.00	0.07
607	300175	朗源股份	9,000	132,300.00	0.07
608	300246	宝莱特	3,200	132,160.00	0.07
609	600396	金山股份	18,700	132,022.00	0.07
610	600976	健民集团	3,900	131,937.00	0.07
611	300262	巴安水务	7,100	131,847.00	0.07
612	002542	中化岩土	9,700	131,823.00	0.07
613	603118	共进股份	2,800	131,740.00	0.07
614	600273	嘉化能源	12,500	131,500.00	0.07
615	002362	汉王科技	4,100	131,405.00	0.07
616	002546	新联电子	4,000	130,680.00	0.07
617	002518	科士达	3,700	130,610.00	0.07
618	002372	伟星新材	7,300	130,524.00	0.07

619	002363	隆基机械	5,700	130,245.00	0.07
620	300255	常山药业	7,400	129,574.00	0.07
621	300450	先导股份	1,300	129,207.00	0.07
622	600057	象屿股份	9,900	129,096.00	0.07
623	002322	理工监测	5,100	128,877.00	0.07
624	000757	浩物股份	10,100	128,876.00	0.07
625	002559	亚威股份	8,100	128,871.00	0.07
626	300386	飞天诚信	2,600	128,570.00	0.07
627	002144	宏达高科	4,500	128,160.00	0.07
628	300439	美康生物	3,200	128,064.00	0.07
629	002017	东信和平	6,600	128,040.00	0.07
630	600683	京投银泰	11,800	127,912.00	0.07
631	002398	建研集团	7,600	127,680.00	0.07
632	002666	德联集团	9,600	127,680.00	0.07
633	000043	中航地产	10,600	127,518.00	0.07
634	300303	聚飞光电	11,000	127,380.00	0.07
635	000498	山东路桥	14,200	127,374.00	0.07
636	002571	德力股份	7,400	126,910.00	0.07
637	002313	日海通讯	8,500	126,820.00	0.07
638	603939	益丰药房	3,000	126,690.00	0.07
639	300355	蒙草抗旱	7,100	126,664.00	0.07
640	300025	华星创业	4,200	126,630.00	0.07
641	002274	华昌化工	10,100	126,452.00	0.07
642	000903	云内动力	15,200	126,160.00	0.07
643	600784	鲁银投资	14,400	126,144.00	0.07
644	002617	露笑科技	5,700	125,970.00	0.07
645	000416	民生控股	13,500	125,955.00	0.07
646	000889	茂业通信	7,900	125,452.00	0.07
647	300213	佳讯飞鸿	3,300	125,400.00	0.07
648	600310	桂东电力	13,200	125,400.00	0.07
649	300114	中航电测	2,500	125,275.00	0.07
650	600692	亚通股份	7,800	125,034.00	0.07
651	600336	澳柯玛	15,200	124,944.00	0.07
652	000932	华菱钢铁	38,300	124,858.00	0.07
653	002601	佰利联	3,200	124,672.00	0.07
654	002139	拓邦股份	5,000	124,550.00	0.07
655	600502	安徽水利	9,100	124,397.00	0.07
656	002401	中海科技	4,800	124,320.00	0.07
657	002520	日发精机	4,700	124,315.00	0.07

658	000514	渝开发	10,800	124,308.00	0.07
659	300198	纳川股份	7,900	124,267.00	0.07
660	002207	准油股份	5,800	124,236.00	0.07
661	300139	晓程科技	6,900	123,993.00	0.07
662	600740	山西焦化	19,100	123,959.00	0.07
663	600077	宋都股份	17,000	123,590.00	0.07
664	002060	粤水电	13,400	123,548.00	0.07
665	601566	九牧王	5,400	123,444.00	0.07
666	300129	泰胜风能	13,300	123,424.00	0.07
667	300155	安居宝	6,851	123,318.00	0.07
668	300426	唐德影视	1,500	123,000.00	0.07
669	601107	四川成渝	20,600	122,982.00	0.07
670	600979	广安爱众	16,000	122,880.00	0.07
671	002472	双环传动	4,600	122,820.00	0.07
672	600052	浙江广厦	13,900	122,737.00	0.07
673	300314	戴维医疗	3,600	122,508.00	0.07
674	002487	大金重工	8,600	122,120.00	0.07
675	300307	慈星股份	7,600	122,056.00	0.07
676	600459	贵研铂业	5,800	121,568.00	0.07
677	000949	新乡化纤	22,800	121,068.00	0.07
678	002307	北新路桥	10,700	120,696.00	0.07
679	600222	太龙药业	12,800	120,448.00	0.07
680	600469	风神股份	7,000	120,330.00	0.07
681	002535	林州重机	9,800	120,246.00	0.07
682	600007	中国国贸	6,400	120,192.00	0.07
683	600127	金健米业	16,300	119,316.00	0.07
684	600680	上海普天	2,400	119,208.00	0.07
685	000899	赣能股份	10,300	119,068.00	0.07
686	300298	三诺生物	3,300	118,668.00	0.07
687	000591	桐君阁	5,200	118,456.00	0.07
688	600461	洪城水业	7,300	118,187.00	0.07
689	300223	北京君正	3,200	118,112.00	0.07
690	300384	三联虹普	1,400	117,880.00	0.07
691	300102	乾照光电	11,200	117,824.00	0.07
692	000551	创元科技	8,900	117,658.00	0.07
693	300343	联创股份	1,200	117,576.00	0.07
694	000665	湖北广电	6,000	117,480.00	0.07
695	603588	高能环境	1,500	117,405.00	0.07
696	300380	安硕信息	1,700	117,283.00	0.07

697	600082	海泰发展	16,400	116,932.00	0.06
698	600723	首商股份	10,500	116,655.00	0.06
699	300100	双林股份	3,700	115,884.00	0.06
700	300376	易事特	2,400	115,224.00	0.06
701	600275	武昌鱼	13,000	115,050.00	0.06
702	300377	赢时胜	1,400	115,038.00	0.06
703	300342	天银机电	2,500	115,000.00	0.06
704	300165	天瑞仪器	4,400	114,928.00	0.06
705	002157	正邦科技	5,700	114,570.00	0.06
706	300140	启源装备	4,600	114,540.00	0.06
707	002231	奥维通信	7,000	114,520.00	0.06
708	300272	开能环保	4,200	114,492.00	0.06
709	000159	国际实业	12,300	114,390.00	0.06
710	601689	拓普集团	4,100	114,185.00	0.06
711	002226	江南化工	12,600	113,778.00	0.06
712	300373	扬杰科技	5,300	113,685.00	0.06
713	002116	中国海诚	6,400	113,664.00	0.06
714	002394	联发股份	6,100	113,643.00	0.06
715	600604	市北高新	3,300	113,454.00	0.06
716	000010	深华新	11,200	113,120.00	0.06
717	300465	高伟达	1,300	113,113.00	0.06
718	600990	四创电子	1,800	112,950.00	0.06
719	002206	海利得	7,100	112,890.00	0.06
720	600857	宁波中百	5,700	112,860.00	0.06
721	002716	金贵银业	9,600	112,800.00	0.06
722	600386	北巴传媒	6,400	112,640.00	0.06
723	603100	川仪股份	6,200	112,468.00	0.06
724	601199	江南水务	5,900	112,395.00	0.06
725	600843	上工申贝	6,700	112,359.00	0.06
726	000529	广弘控股	9,300	112,251.00	0.06
727	600814	杭州解百	9,100	112,203.00	0.06
728	002212	南洋股份	8,100	112,185.00	0.06
729	000905	厦门港务	8,400	111,636.00	0.06
730	300335	迪森股份	6,000	111,240.00	0.06
731	600354	敦煌种业	11,200	110,656.00	0.06
732	300378	鼎捷软件	1,900	110,618.00	0.06
733	600858	银座股份	10,000	110,600.00	0.06
734	002227	奥特迅	2,800	110,600.00	0.06
735	002769	普路通	1,400	110,544.00	0.06

736	300172	中电环保	6,400	110,528.00	0.06
737	600080	金花股份	7,700	110,341.00	0.06
738	600716	凤凰股份	9,500	110,295.00	0.06
739	000965	天保基建	16,000	110,080.00	0.06
740	000918	嘉凯城	17,200	110,080.00	0.06
741	603979	金诚信	3,600	109,980.00	0.06
742	000029	深深房 A	8,500	109,820.00	0.06
743	300105	龙源技术	9,800	109,760.00	0.06
744	603126	中材节能	7,700	109,186.00	0.06
745	002438	江苏神通	3,900	108,849.00	0.06
746	601008	连云港	16,100	108,836.00	0.06
747	300360	炬华科技	3,100	108,810.00	0.06
748	300222	科大智能	5,220	108,784.80	0.06
749	300311	任子行	2,800	108,444.00	0.06
750	000863	三湘股份	9,200	108,100.00	0.06
751	000928	中钢国际	6,100	107,909.00	0.06
752	002225	濮耐股份	14,100	107,865.00	0.06
753	000058	深赛格	9,100	107,835.00	0.06
754	601339	百隆东方	14,300	107,679.00	0.06
755	300334	津膜科技	4,400	107,668.00	0.06
756	300312	邦讯技术	2,500	107,250.00	0.06
757	002378	章源钨业	8,900	107,156.00	0.06
758	600698	湖南天雁	14,200	106,926.00	0.06
759	300323	华灿光电	10,500	106,890.00	0.06
760	300289	利德曼	5,350	106,465.00	0.06
761	000811	烟台冰轮	6,900	106,398.00	0.06
762	002198	嘉应制药	9,700	106,118.00	0.06
763	600084	中葡股份	14,300	106,106.00	0.06
764	002165	红宝丽	12,000	105,960.00	0.06
765	601968	宝钢包装	7,900	105,544.00	0.06
766	002554	惠博普	8,100	105,300.00	0.06
767	300451	创业软件	600	105,120.00	0.06
768	600543	莫高股份	8,100	104,814.00	0.06
769	603227	雪峰科技	3,100	104,594.00	0.06
770	600724	宁波富达	13,800	104,466.00	0.06
771	300471	厚普股份	1,400	104,440.00	0.06
772	600609	金杯汽车	20,800	104,416.00	0.06
773	002016	世荣兆业	7,700	104,181.00	0.06
774	600845	宝信软件	1,800	104,076.00	0.06

775	002145	中核钛白	6,800	104,040.00	0.06
776	600313	农发种业	6,800	103,224.00	0.06
777	300424	航新科技	1,300	103,194.00	0.06
778	002182	云海金属	6,400	103,168.00	0.06
779	600523	贵航股份	4,600	103,040.00	0.06
780	600449	宁夏建材	9,200	103,040.00	0.06
781	600101	明星电力	7,200	103,032.00	0.06
782	002586	围海股份	11,600	103,008.00	0.06
783	600283	钱江水利	5,600	102,816.00	0.06
784	000909	数源科技	5,500	102,740.00	0.06
785	300195	长荣股份	4,300	102,727.00	0.06
786	002566	益盛药业	6,300	102,690.00	0.06
787	002756	永兴特钢	1,900	102,600.00	0.06
788	600197	伊力特	7,000	102,550.00	0.06
789	000530	大冷股份	5,400	102,492.00	0.06
790	002712	思美传媒	800	102,400.00	0.06
791	600192	长城电工	9,900	102,366.00	0.06
792	300057	万顺股份	5,600	102,312.00	0.06
793	600658	电子城	7,300	101,981.00	0.06
794	300206	理邦仪器	3,700	101,972.00	0.06
795	601007	金陵饭店	6,600	101,772.00	0.06
796	002391	长青股份	5,700	101,574.00	0.06
797	600287	江苏舜天	8,300	101,509.00	0.06
798	002386	天原集团	12,800	101,504.00	0.06
799	300041	回天新材	3,800	101,460.00	0.06
800	300357	我武生物	2,000	101,400.00	0.06
801	002102	冠福股份	6,800	101,184.00	0.06
802	600981	汇鸿集团	7,800	101,166.00	0.06
803	600078	澄星股份	12,700	100,330.00	0.06
804	600327	大东方	10,000	100,100.00	0.06
805	002597	金禾实业	9,100	100,100.00	0.06
806	603989	艾华集团	2,800	99,932.00	0.06
807	000906	物产中拓	6,200	99,758.00	0.06
808	300370	安控科技	5,100	99,756.00	0.06
809	300438	鹏辉能源	800	99,600.00	0.06
810	600475	华光股份	4,800	99,312.00	0.06
811	603686	龙马环卫	2,500	99,300.00	0.06
812	000789	万年青	11,700	99,216.00	0.06
813	002457	青龙管业	7,400	99,160.00	0.06

814	300358	楚天科技	2,600	99,086.00	0.05
815	300413	快乐购	2,500	99,000.00	0.05
816	601313	江南嘉捷	6,300	98,784.00	0.05
817	300393	中来股份	1,900	98,667.00	0.05
818	300119	瑞普生物	4,900	98,490.00	0.05
819	002638	勤上光电	6,400	98,048.00	0.05
820	002693	双成药业	6,600	98,010.00	0.05
821	000925	众合科技	5,300	97,944.00	0.05
822	300328	宜安科技	2,800	97,832.00	0.05
823	000521	美菱电器	13,400	97,820.00	0.05
824	300164	通源石油	9,100	97,643.00	0.05
825	002529	海源机械	3,800	97,622.00	0.05
826	002700	新疆浩源	6,700	97,619.00	0.05
827	600190	锦州港	17,000	97,580.00	0.05
828	002499	科林环保	3,600	97,560.00	0.05
829	600159	大龙地产	15,800	97,486.00	0.05
830	000553	沙隆达 A	9,100	97,370.00	0.05
831	600128	弘业股份	6,200	97,092.00	0.05
832	600613	神奇制药	4,500	97,020.00	0.05
833	600778	友好集团	7,900	96,933.00	0.05
834	300482	万孚生物	800	96,896.00	0.05
835	600371	万向德农	4,280	96,300.00	0.05
836	600569	安阳钢铁	30,400	96,064.00	0.05
837	002246	北化股份	6,800	96,016.00	0.05
838	300337	银邦股份	10,500	95,760.00	0.05
839	300443	金雷风电	495	95,693.40	0.05
840	300259	新天科技	7,400	95,386.00	0.05
841	603898	好莱客	2,800	95,144.00	0.05
842	300254	仟源医药	2,700	95,094.00	0.05
843	002351	漫步者	3,700	95,053.00	0.05
844	300227	光韵达	2,600	94,900.00	0.05
845	601789	宁波建工	7,700	94,864.00	0.05
846	300440	运达科技	1,100	94,732.00	0.05
847	603818	曲美家居	4,600	94,668.00	0.05
848	600508	上海能源	9,200	94,668.00	0.05
849	300301	长方照明	8,800	94,512.00	0.05
850	600279	重庆港九	5,800	94,482.00	0.05
851	601188	龙江交通	16,300	94,214.00	0.05
852	600802	福建水泥	8,500	94,180.00	0.05

853	600121	郑州煤电	12,900	94,170.00	0.05
854	002381	双箭股份	5,500	93,940.00	0.05
855	601028	玉龙股份	10,000	93,700.00	0.05
856	000419	通程控股	10,400	93,600.00	0.05
857	002606	大连电瓷	5,200	93,600.00	0.05
858	000727	华东科技	9,400	93,154.00	0.05
859	600531	豫光金铅	5,600	92,512.00	0.05
860	600738	兰州民百	8,200	91,840.00	0.05
861	002228	合兴包装	5,400	91,152.00	0.05
862	002096	南岭民爆	3,500	91,035.00	0.05
863	002528	英飞拓	6,700	90,986.00	0.05
864	002605	姚记扑克	3,500	90,335.00	0.05
865	002763	汇洁股份	2,000	90,300.00	0.05
866	002511	中顺洁柔	7,700	89,936.00	0.05
867	000922	佳电股份	6,900	89,907.00	0.05
868	600278	东方创业	4,900	89,866.00	0.05
869	600081	东风科技	4,000	89,840.00	0.05
870	603599	广信股份	1,800	89,532.00	0.05
871	600548	深高速	9,100	89,180.00	0.05
872	603799	华友钴业	3,400	88,944.00	0.05
873	600113	浙江东日	6,000	88,920.00	0.05
874	601999	出版传媒	7,000	88,900.00	0.05
875	002567	唐人神	6,900	88,596.00	0.05
876	300444	双杰电气	2,700	88,506.00	0.05
877	002706	良信电器	1,500	88,500.00	0.05
878	603636	南威软件	900	88,038.00	0.05
879	600897	厦门空港	3,800	87,856.00	0.05
880	300103	达刚路机	3,300	87,747.00	0.05
881	600368	五洲交通	13,300	87,381.00	0.05
882	002302	西部建设	4,900	87,318.00	0.05
883	002733	雄韬股份	2,850	87,238.50	0.05
884	603669	灵康药业	2,500	87,225.00	0.05
885	000713	丰乐种业	6,600	86,724.00	0.05
886	000708	大冶特钢	7,100	86,691.00	0.05
887	000014	沙河股份	3,800	86,678.00	0.05
888	002382	蓝帆医疗	3,100	86,676.00	0.05
889	002046	轴研科技	6,500	86,580.00	0.05
890	300432	富临精工	3,400	86,428.00	0.05
891	002579	中京电子	5,500	86,295.00	0.05

892	300067	安诺其	8,300	86,071.00	0.05
893	603020	爱普股份	1,500	85,980.00	0.05
894	603566	普莱柯	1,500	85,965.00	0.05
895	300162	雷曼股份	3,600	85,896.00	0.05
896	002218	拓日新能	7,800	85,722.00	0.05
897	002519	银河电子	3,600	85,500.00	0.05
898	002747	埃斯顿	1,200	85,416.00	0.05
899	601069	西部黄金	4,000	85,320.00	0.05
900	000570	苏常柴 A	7,800	85,176.00	0.05
901	000022	深赤湾 A	4,400	84,920.00	0.05
902	300331	苏大维格	3,300	84,777.00	0.05
903	600833	第一医药	4,200	84,672.00	0.05
904	002388	新亚制程	7,600	84,132.00	0.05
905	600629	华建集团	3,400	84,116.00	0.05
906	300293	蓝英装备	3,400	83,844.00	0.05
907	000916	华北高速	13,900	83,817.00	0.05
908	002660	茂硕电源	5,300	83,687.00	0.05
909	603789	星光农机	1,900	83,638.00	0.05
910	300084	海默科技	7,200	82,944.00	0.05
911	002677	浙江美大	3,800	82,916.00	0.05
912	000544	中原环保	4,300	82,775.00	0.05
913	603168	莎普爱思	1,500	82,620.00	0.05
914	600203	福日电子	6,000	82,260.00	0.05
915	000637	茂化实华	9,900	81,972.00	0.05
916	600791	京能置业	8,700	81,606.00	0.05
917	300234	开尔新材	3,300	81,510.00	0.05
918	300399	京天利	1,450	81,301.50	0.05
919	002356	浩宁达	2,900	81,229.00	0.05
920	600367	红星发展	6,400	81,088.00	0.05
921	002651	利君股份	6,300	81,081.00	0.04
922	000597	东北制药	7,800	80,886.00	0.04
923	300448	浩云科技	800	80,792.00	0.04
924	601368	绿城水务	4,600	80,592.00	0.04
925	603338	浙江鼎力	1,500	80,055.00	0.04
926	002451	摩恩电气	5,500	80,025.00	0.04
927	300398	飞凯材料	1,000	79,580.00	0.04
928	603012	创力集团	3,000	78,900.00	0.04
929	600218	全柴动力	5,800	78,706.00	0.04
930	600792	云煤能源	12,600	78,624.00	0.04

931	300403	地尔汉字	1,300	78,585.00	0.04
932	603808	歌力思	1,600	78,416.00	0.04
933	600560	金自天正	4,200	77,910.00	0.04
934	603003	龙宇燃油	2,600	77,506.00	0.04
935	601038	一拖股份	5,600	77,448.00	0.04
936	002713	东易日盛	2,400	76,800.00	0.04
937	002543	万和电气	4,200	76,482.00	0.04
938	600295	鄂尔多斯	7,700	76,153.00	0.04
939	600189	吉林森工	5,900	76,051.00	0.04
940	603969	银龙股份	3,800	75,848.00	0.04
941	600225	天津松江	9,000	75,510.00	0.04
942	600782	新钢股份	13,300	75,145.00	0.04
943	300436	广生堂	900	75,087.00	0.04
944	600819	耀皮玻璃	9,500	75,050.00	0.04
945	300406	九强生物	1,600	75,008.00	0.04
946	300449	汉邦高科	700	74,935.00	0.04
947	300468	四方精创	900	74,772.00	0.04
948	300304	云意电气	2,500	74,000.00	0.04
949	603002	宏昌电子	9,600	73,824.00	0.04
950	601677	明泰铝业	4,600	73,600.00	0.04
951	300389	艾比森	1,500	73,515.00	0.04
952	002534	杭锅股份	3,800	73,416.00	0.04
953	000065	北方国际	2,400	73,272.00	0.04
954	000011	深物业 A	5,000	72,600.00	0.04
955	000663	永安林业	4,300	72,326.00	0.04
956	002613	北玻股份	9,200	72,036.00	0.04
957	600359	新农开发	6,000	71,760.00	0.04
958	300082	奥克股份	8,600	71,036.00	0.04
959	600988	赤峰黄金	6,100	70,577.00	0.04
960	300021	大禹节水	4,400	70,224.00	0.04
961	002752	昇兴股份	2,000	70,000.00	0.04
962	000968	煤气化	8,000	69,680.00	0.04
963	300200	高盟新材	4,000	69,440.00	0.04
964	300351	永贵电器	2,200	68,860.00	0.04
965	600995	文山电力	7,400	68,228.00	0.04
966	603600	永艺股份	900	67,995.00	0.04
967	300349	金卡股份	1,800	67,950.00	0.04
968	002114	罗平锌电	3,400	67,184.00	0.04
969	002379	鲁丰环保	15,400	66,836.00	0.04

970	300350	华鹏飞	1,900	65,493.00	0.04
971	603368	柳州医药	700	64,323.00	0.04
972	601798	蓝科高新	4,500	63,585.00	0.04
973	600237	铜峰电子	11,000	63,030.00	0.03
974	002726	龙大肉食	4,100	62,279.00	0.03
975	603116	红蜻蜓	1,900	60,382.00	0.03
976	300209	天泽信息	2,300	59,340.00	0.03
977	603099	长白山	2,500	58,750.00	0.03
978	300326	凯利泰	2,100	58,632.00	0.03
979	000935	四川双马	7,200	57,312.00	0.03
980	300127	银河磁体	3,100	56,358.00	0.03
981	000153	丰原药业	5,300	55,332.00	0.03
982	603123	翠微股份	5,000	54,850.00	0.03
983	002346	柘中股份	2,800	54,796.00	0.03
984	603997	继峰股份	2,000	54,020.00	0.03
985	600168	武汉控股	5,500	53,240.00	0.03
986	002483	润邦股份	3,400	53,210.00	0.03
987	300382	斯莱克	1,100	52,195.00	0.03
988	600982	宁波热电	6,700	50,518.00	0.03
989	603688	石英股份	2,100	50,232.00	0.03
990	603117	万林股份	1,900	48,773.00	0.03
991	603018	设计股份	620	47,653.20	0.03
992	300148	天舟文化	2,700	47,520.00	0.03
993	002731	萃华珠宝	1,400	45,570.00	0.03
994	601015	陕西黑猫	3,900	45,552.00	0.03
995	600623	双钱股份	2,400	45,480.00	0.03
996	002724	海洋王	1,600	44,736.00	0.02
997	603166	福达股份	1,400	37,856.00	0.02
998	300292	吴通控股	500	21,150.00	0.01

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	002481	双塔食品	26,750	371,290.00	0.21
2	002286	保龄宝	9,300	134,850.00	0.07
3	002360	同德化工	7,700	94,864.00	0.05
4	600375	华菱星马	11,600	89,668.00	0.05

5	601996	丰林集团	7,700	70,224.00	0.04
6	002514	宝馨科技	4,400	65,120.00	0.04
7	600781	辅仁药业	2,800	54,208.00	0.03
8	600714	金瑞矿业	3,800	44,992.00	0.02
9	002582	好想你	1,700	26,554.00	0.01

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	300347	泰格医药	2,738,378.96	1.52
2	002303	美盈森	1,933,461.00	1.07
3	002312	三泰控股	1,873,350.25	1.04
4	002262	恩华药业	1,733,977.70	0.96
5	000938	紫光股份	1,652,000.03	0.92
6	000875	吉电股份	1,631,627.00	0.91
7	002104	恒宝股份	1,619,751.94	0.90
8	002439	启明星辰	1,577,663.32	0.88
9	600074	保千里	1,448,891.00	0.80
10	600388	龙净环保	1,428,593.00	0.79
11	300159	新研股份	1,426,519.00	0.79
12	600868	梅雁吉祥	1,384,137.00	0.77
13	300079	数码视讯	1,379,384.00	0.77
14	300085	银之杰	1,353,765.00	0.75
15	300216	千山药机	1,344,587.44	0.75
16	002657	中科金财	1,329,187.00	0.74
17	000410	沈阳机床	1,320,700.00	0.73
18	300001	特锐德	1,309,128.52	0.73
19	601588	北辰实业	1,297,403.00	0.72
20	300101	振芯科技	1,282,623.05	0.71

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	300347	泰格医药	1,746,063.04	0.97
2	002262	恩华药业	1,170,932.84	0.65
3	002439	启明星辰	1,140,796.94	0.63
4	600388	龙净环保	1,041,015.29	0.58
5	600868	梅雁吉祥	1,034,189.35	0.57
6	002303	美盈森	937,995.40	0.52
7	002657	中科金财	916,623.16	0.51
8	600074	保千里	904,164.18	0.50
9	002085	万丰奥威	878,809.53	0.49
10	002572	索菲亚	864,533.00	0.48
11	300085	银之杰	856,807.18	0.48
12	000966	长源电力	771,689.37	0.43
13	002104	恒宝股份	761,886.00	0.42
14	002280	联络互动	747,780.40	0.41
15	000875	吉电股份	743,371.69	0.41
16	600098	广州发展	729,596.00	0.40
17	600236	桂冠电力	706,147.00	0.39
18	300216	千山药机	694,325.88	0.39
19	000938	紫光股份	690,844.92	0.38
20	002312	三泰控股	680,950.62	0.38

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	503,701,349.17
卖出股票收入（成交）总额	201,881,098.32

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

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

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。

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	164,756.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,414.32
5	应收申购款	51,297.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	219,468.36

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	600682	南京新百	755,242.00	0.42	重大资产重组
2	600565	迪马股份	511,584.00	0.28	临时停牌
3	002075	沙钢股份	500,481.80	0.28	重大资产重组

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	002481	双塔食品	371,290.00	0.21	重大资产重组
2	002286	保龄宝	134,850.00	0.07	重大资产重组
3	002360	同德化工	94,864.00	0.05	重大资产重组
4	600375	华菱星马	89,668.00	0.05	重大资产重组
5	601996	丰林集团	70,224.00	0.04	重大资产重组

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1000A	135	57,520.01	6,066,285.00	78.12%	1,698,916.00	21.88%
1000B	323	24,040.87	86,796.00	1.12%	7,678,405.00	98.88%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	4,413	35,902.35	40,096,631.96	25.31%	118,340,441.34	74.69%
合计	4,871	35,714.94	46,249,712.96	26.59%	127,717,762.34	73.41%

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

9.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	6,048,156.00	77.89%
2	陈杰	1,057,224.00	13.61%
3	黄维嘉	60,000.00	0.77%
4	周昭山	45,576.00	0.59%
5	陈敏	40,000.00	0.52%
6	毛杰	33,400.00	0.43%
7	薛亚萍	32,100.00	0.41%
8	张春雷	30,000.00	0.39%
9	孙大威	29,400.00	0.38%
10	邵文杰	26,079.00	0.34%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	宋伟铭	1,968,400.00	25.35%
2	江淼	865,413.00	11.14%
3	吴海晏	493,900.00	6.36%
4	周昭山	252,100.00	3.25%

5	侯明新	170,000.00	2.19%
6	伍勇	167,600.00	2.16%
7	戴国梁	153,900.00	1.98%
8	张星	153,500.00	1.98%
9	王跃文	124,400.00	1.60%
10	王绪岩	120,000.00	1.55%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝兴业中证 1000 指数分级	5,864.43	0.0037%
	合计	5,864.43	0.0034%

注：期末本公司基金从业人员未持有本基金的 A 级份额和 B 级份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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

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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	147,346,212.22
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	-172,544,574.02
基金合同生效日起至报告	-21,676,381.00		-88,192,505.44

期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)		-21,676,381.00	
本报告期末基金份额总额	7,765,201.00	7,765,201.00	158,437,073.30

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 40,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2015 年 6 月 4 日）起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年

11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

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	
安信证券	1	22,472,304.71	3.18%	20,929.07	3.26%	-
财富里昂	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	2	8,705,478.31	1.23%	7,925.53	1.23%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	27,430,996.22	3.89%	25,546.51	3.98%	-
东兴证券	1	139,444,456.79	19.76%	124,739.04	19.43%	-
方正证券	2	9,113,038.52	1.29%	8,304.56	1.29%	-
高华证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	218,722,433.72	31.00%	199,124.10	31.01%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	1	95,449,525.46	13.53%	86,973.17	13.55%	-
国泰君安	2	16,359,412.17	2.32%	15,072.61	2.35%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	37,206,804.20	5.27%	33,873.77	5.28%	-
华泰联合	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
金元证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
日信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	3,224,451.00	0.46%	2,935.48	0.46%	-
申万宏源	3	9,492,725.68	1.35%	8,840.50	1.38%	-
西南证券	1	9,327,313.05	1.32%	8,686.66	1.35%	-
信达证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	6,342,347.91	0.90%	5,779.74	0.90%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	45,270,352.36	6.42%	41,214.34	6.42%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	1	33,152,157.44	4.70%	30,182.01	4.70%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	2	7,707,198.76	1.09%	7,023.49	1.09%	-
中投证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	1	250,044.80	0.04%	227.87	0.04%	-
中信证券	2	15,911,406.39	2.26%	14,658.73	2.28%	-
中银国际	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况况稳定；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
安信证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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

中银国际	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金场内申购费率的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 12 月 22 日
2	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 12 月 18 日
3	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 12 月 17 日
4	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 1000A 停复牌的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 12 月 16 日
5	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 12 月 10 日
6	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 12 月 10 日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 11 月 30 日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券有限责任公司申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 10 月 20 日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加申万宏源西部证券有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 8 月 3 日
10	华宝兴业基金管理有限公司	《中国证券报》、《证	2015 年 7 月 27 日

	关于旗下部分开放式基金增加中信期货有限公司为代销机构的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
11	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 14 日
12	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金不定期份额折算后 1000A 和 1000B 前收盘价调整的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 8 日
13	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 8 日
14	关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间 1000A、1000B 停复牌的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 7 日
15	华宝兴业基金管理有限公司关于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增加场外代销机构的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 7 日
16	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金不定期份额折算期间 1000B 的风险提示公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 6 日
17	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 6 日
18	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 6 日
19	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 7 月 3 日
20	华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2015 年 7 月 1 日
21	华宝兴业中证 1000 指数分级	《证券日报》、《上海	2015 年 6 月 16 日

	证券投资基金之 1000A 与 1000B 基金份额上市交易提示性公告	证券报》以及基金管理人网站	
22	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金增加场外代销机构的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 16 日
23	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金参加部分代销机构定期定额投资及电子渠道申购费率优惠活动的提示性公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 16 日
24	关于华宝中证 1000A 份额约定年基准收益率的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 11 日
25	关于开通华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 11 日
26	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 11 日
27	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000A 与 1000B 上市交易公告书	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 11 日
28	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同生效公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 6 月 6 日
29	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金提前结束募集的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
30	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金份额上网发售提示性公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 25 日
31	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金增加场外代销机构的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 25 日
32	关于调整华宝兴业中证 1000 指数分级基金网上直销汇款交易和官方淘宝店认购费率优惠的公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
33	关于调整华宝兴业中证 1000	《证券日报》、《上海	2015 年 5 月 21 日

	指数分级基金网上直销汇款交易和官方淘宝店认购费率优惠的公告	证券报》以及基金管理人网站	
34	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金份额发售公告	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日
35	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日
36	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同摘要	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日
37	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日
38	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书	《证券日报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日

§ 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 1000 指数分级证券投资基金基金合同；
 华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业中证 1000 指数分级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
2016 年 3 月 28 日