

# 华宝兴业中证 100 指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 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.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业中证 100 指数证券投资基金
基金简称	华宝兴业中证 100 指数
基金主代码	240014
前端交易代码	240014
后端交易代码	240015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 29 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	435,614,832.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，力争控制本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的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，实现对中证 100 指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。
风险收益特征	本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。

### 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、	010-67595096

	021-38924558	
传真	021-38505777	010-66275853
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑安国	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 58 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-9,423,478.62
本期利润	-58,991,177.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1338
本期加权平均净值利润率	-14.55%
本期基金份额净值增长率	-12.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-27,830,244.41
期末可供分配基金份额利润	-0.0639
期末基金资产净值	407,784,588.32
期末基金份额净值	0.9361
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-6.39%
-------------	--------

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.16%	0.83%	-0.82%	0.78%	0.98%	0.05%
过去三个月	-0.62%	0.86%	-1.50%	0.80%	0.88%	0.06%
过去六个月	-12.39%	1.65%	-11.97%	1.54%	-0.42%	0.11%
过去一年	-24.87%	2.14%	-25.29%	2.06%	0.42%	0.08%
过去三年	42.55%	1.78%	40.34%	1.74%	2.21%	0.04%
自基金合同生效日起至 今	-6.39%	1.55%	1.39%	1.53%	-7.78%	0.02%

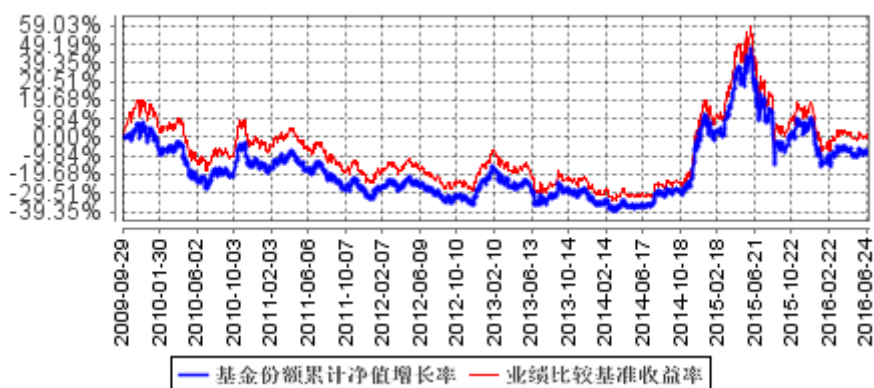
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

### 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

（2009 年 9 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，截至 2009 年 11 月 6 日，本基金已完成建仓且达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈建华	本基金基金经理、	2012 年 12 月 22 日	-	15 年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作。



	<p>华宝兴业事件驱动混合基金经理</p>			<p>2007 年 8 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、华宝兴业上证 180 价值 ETF、华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接基金经理助理，兼任华宝兴业上证 180 成长 ETF、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接基金经理助理，2012 年 12 月起任华宝兴业中证 100 指数型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	-----------------------	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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 100 指数证券投资基金在短期内出现过现金及一年内到期的政府债券低于基金资产净值的 5% 的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评

价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期沪深 A 股大幅下跌，沪深 A 股在年初大幅下跌并触发连续熔断。随后在取消熔断机制后，市场逐渐恢复正常交易并且底部逐渐提高。上半年行业间差异较大，有基本面支撑的新能源汽车、电子、黄金及白酒等行业有较好的涨幅。本报告期中，沪深 300 和中证 100 指数分别下跌 15.47%和 12.65%，而中证 500 和创业板分别下跌为 19.61%和 17.92%

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-12.39%，同期业绩比较基准收益率为-11.97%，基金表现落后于比较基准 0.42%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年，国内经济仍在低位运行，各项经济指标并没有出现持续性的好转，展望下半年，保增长有压力，货币政策继续维持宽松状态，财政政策将更加积极，供给侧改革、国有企业改革等将继续深入；市场面临的不确定性也在增加，IPO 进度加速、人民币汇率承压、海外市场黑天鹅等都有可能使 A 股承压。流动性宽松、估值调整将推动投资者风险偏好的上升，市场仍然会有阶段性机会、结构性机。从目前市场来看，中证 100 指数估值处于历史底部区域，建议投资者多关注下半年这类大蓝筹指数的投资机会。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证 100 指数的有效跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性 & 适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

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

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,785,296.27	25,753,059.72
结算备付金		15,153.90	7,650.21
存出保证金		16,512.84	62,411.43
交易性金融资产	6.4.7.2	386,905,890.57	451,409,659.60
其中：股票投资		386,905,890.57	451,409,659.60
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	484,791.62
应收利息	6.4.7.5	4,407.39	5,800.14
应收股利		-	-
应收申购款		2,940.90	35,357.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		408,730,201.87	477,758,729.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		125,372.86	301,573.21
应付管理人报酬		165,207.88	202,251.19
应付托管费		49,562.35	60,675.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	258,191.46	464,330.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	347,279.00	370,696.65
负债合计		945,613.55	1,399,526.44
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	435,614,832.73	445,815,690.95
未分配利润	6.4.7.10	-27,830,244.41	30,543,512.37
所有者权益合计		407,784,588.32	476,359,203.32
负债和所有者权益总计		408,730,201.87	477,758,729.76

注: 报告截止日 2016 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.9361 元, 基金份额总额 435,614,832.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-57,277,468.05	114,237,183.69
1.利息收入		79,780.38	159,344.98
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	79,780.38	159,344.98
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)		-7,823,214.53	153,770,471.13
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-11,636,136.57	148,656,169.33
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,812,922.04	5,114,301.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-49,567,698.72	-40,340,105.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	33,664.82	647,472.97
<b>减：二、费用</b>		1,713,709.29	4,035,949.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,008,178.96	1,623,842.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	302,453.72	487,152.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	159,403.88	1,655,712.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	243,672.73	269,241.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-58,991,177.34	110,201,234.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-58,991,177.34	110,201,234.09

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	445,815,690.95	30,543,512.37	476,359,203.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-58,991,177.34	-58,991,177.34
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）	-10,200,858.22	617,420.56	-9,583,437.66

其中：1.基金申购款	21,829,218.05	-2,204,186.99	19,625,031.06
2.基金赎回款	-32,030,076.27	2,821,607.55	-29,208,468.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	435,614,832.73	-27,830,244.41	407,784,588.32
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	622,029,847.02	55,485,949.44	677,515,796.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	110,201,234.09	110,201,234.09
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)	-108,657,488.17	-39,457,188.11	-148,114,676.28
其中：1.基金申购款	564,563,115.37	82,802,125.15	647,365,240.52
2.基金赎回款	-673,220,603.54	-122,259,313.26	-795,479,916.80
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)	513,372,358.85	126,229,995.42	639,602,354.27

报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小慧

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 754 号《关于核准华宝兴业中证 100 指数证券投资基金募集的批复》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 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,008,465,719.05 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 184 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,008,751,627.96 份基金份额，其中认购资金利息折合 285,908.91 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 100 指数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，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。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 100 指数，投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-10%(其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%)。本基金力争控制本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的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。



## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	21,785,296.27
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	21,785,296.27

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	423,055,035.47	386,905,890.57	-36,149,144.90
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	423,055,035.47	386,905,890.57	-36,149,144.90

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,392.75
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	6.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.34
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.50
合计	4,407.39

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	258,191.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	258,191.46

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	369.08
预提费用	296,909.92
应付指数许可使用费	50,000.00
合计	347,279.00

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	445,815,690.95	445,815,690.95
本期申购	21,829,218.05	21,829,218.05
本期赎回(以“-”号填列)	-32,030,076.27	-32,030,076.27
本期末	435,614,832.73	435,614,832.73

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	21,249,249.17	9,294,263.20	30,543,512.37
本期利润	-9,423,478.62	-49,567,698.72	-58,991,177.34
本期基金份额交易产生的变动数	-321,339.48	938,760.04	617,420.56
其中：基金申购款	929,753.37	-3,133,940.36	-2,204,186.99
基金赎回款	-1,251,092.85	4,072,700.40	2,821,607.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,504,431.07	-39,334,675.48	-27,830,244.41

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	78,616.83
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	969.50
其他	194.05
合计	79,780.38

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	53,856,260.41
减：卖出股票成本总额	65,492,396.98
买卖股票差价收入	-11,636,136.57

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

单位：人民币元

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,812,922.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,812,922.04

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-49,567,698.72
——股票投资	-49,567,698.72
——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	-49,567,698.72

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,565.02
转出费收入	21,099.80
其他	-
合计	33,664.82

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	159,403.88
银行间市场交易费用	-
合计	159,403.88

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	39,781.56
信息披露费	97,128.36
银行汇划费用	762.81
债券帐户维护费	6,000.00
指数许可使用费	100,000.00
合计	243,672.73

注：根据《华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同》及《中证指数公司指数使用许可协议》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元。

在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.02% / 当年天数。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、注册登记机构、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、基金代销机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华宝证券	22,770,161.05	21.98%	84,807,570.61	7.88%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	21,206.19	22.01%	21,206.19	8.21%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	77,208.71	7.91%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,008,178.96	1,623,842.57
其中：支付销售机构的客户维护费	102,150.17	276,175.47

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	302,453.72	487,152.79

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日



	月 30 日	日
期初持有的基金份额	22,204,874.51	4,902,136.78
期间申购/买入总份额	-	44,367.01
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	92,131.85	-
期末持有的基金份额	22,112,742.66	4,946,503.79
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.08%	0.96%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	21,785,296.27	78,616.83	37,571,593.45	150,429.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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
----------	----------	----------	----------	----------------	----------	------------	-------	------------	------------	----

000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大 事项 停牌	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	581,009	6,825,444.09	10,574,363.80	-
000651	格力 电器	2016 年 2 月 22 日	重大 事项 停牌	22.05	-	-	374,278	6,873,472.35	8,252,829.90	-
600019	宝钢 股份	2016 年 6 月 27 日	重大 事项 停牌	4.90	-	-	383,800	2,023,848.86	1,880,620.00	-

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

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 100 指数。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在经营管理和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。

#### **6.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2015 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.13.3 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，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,785,296.27	-	-	-	21,785,296.27
结算备付金	15,153.90	-	-	-	15,153.90
存出保证金	16,512.84	-	-	-	16,512.84
交易性金融资产	-	-	-	386,905,890.57	386,905,890.57
应收利息	-	-	-	4,407.39	4,407.39
应收申购款	646.13	-	-	2,294.77	2,940.90
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,817,609.14	-	-	386,912,592.73	408,730,201.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,372.86	125,372.86
应付管理人报酬	-	-	-	165,207.88	165,207.88
应付托管费	-	-	-	49,562.35	49,562.35
应付指数使用费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	258,191.46	258,191.46
其他负债	-	-	-	297,279.00	297,279.00
负债总计	-	-	-	945,613.55	945,613.55
利率敏感度缺口	21,817,609.14	-	-	385,966,979.18	407,784,588.32
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,753,059.72	-	-	-	25,753,059.72
结算备付金	7,650.21	-	-	-	7,650.21
存出保证金	62,411.43	-	-	-	62,411.43

交易性金融资产	-	-	-	451,409,659.60	451,409,659.60
应收证券清算款	-	-	-	484,791.62	484,791.62
应收利息	-	-	-	5,800.14	5,800.14
应收申购款	447.32	-	-	34,909.72	35,357.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,823,568.68	-	-	451,935,161.08	477,758,729.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	301,573.21	301,573.21
应付管理人报酬	-	-	-	202,251.19	202,251.19
应付托管费	-	-	-	60,675.36	60,675.36
应付指数使用费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	464,330.03	464,330.03
其他负债	-	-	-	320,696.65	320,696.65
负债总计	-	-	-	1,399,526.44	1,399,526.44
利率敏感度缺口	25,823,568.68	-	-	-450,535,634.64	-476,359,203.32

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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 100 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 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	386,905,890.57	94.88	451,409,659.60	94.76
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	386,905,890.57	94.88	451,409,659.60	94.76

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	21,177,937.82	24,189,725.18
	业绩比较基准下降 5%	-21,177,937.82	-24,189,725.18

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 366,198,076.87 元，属于第二层次的余额为 20,707,813.70 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 428,823,369.41 元，第二层次 22,586,290.19 元，无第三层次)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	386,905,890.57	94.66
	其中：股票	386,905,890.57	94.66
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	21,800,450.17	5.33
7	其他各项资产	23,861.13	0.01
8	合计	408,730,201.87	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,726,757.59	3.12
C	制造业	101,383,310.72	24.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,290,720.43	3.75
E	建筑业	15,328,983.60	3.76
F	批发和零售业	2,911,446.54	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	8,274,896.92	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,940,757.75	3.17
J	金融业	196,288,469.21	48.14
K	房地产业	16,667,771.01	4.09
L	租赁和商务服务业	726,440.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,569,836.80	0.38
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	2,796,500.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	386,905,890.57	94.88

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

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	601318	中国平安	786,228	25,190,745.12	6.18
2	600016	民生银行	1,701,924	15,198,181.32	3.73
3	601166	兴业银行	964,600	14,700,504.00	3.60
4	600036	招商银行	743,260	13,007,050.00	3.19
5	601328	交通银行	1,977,781	11,134,907.03	2.73
6	600519	贵州茅台	36,632	10,693,613.44	2.62
7	000002	万科 A	581,009	10,574,363.80	2.59
8	600000	浦发银行	622,512	9,692,511.84	2.38
9	600030	中信证券	569,768	9,247,334.64	2.27
10	600837	海通证券	582,636	8,984,247.12	2.20
11	000651	格力电器	374,278	8,252,829.90	2.02
12	601288	农业银行	2,557,413	8,183,721.60	2.01
13	600887	伊利股份	441,868	7,365,939.56	1.81
14	601169	北京银行	707,775	7,339,626.75	1.80
15	601398	工商银行	1,560,074	6,926,728.56	1.70
16	601601	中国太保	228,488	6,178,315.52	1.52
17	601766	中国中车	670,686	6,150,190.62	1.51
18	600900	长江电力	475,109	5,934,111.41	1.46
19	601668	中国建筑	1,079,836	5,744,727.52	1.41
20	000333	美的集团	231,982	5,502,613.04	1.35
21	600104	上汽集团	238,657	4,842,350.53	1.19
22	601688	华泰证券	255,134	4,827,135.28	1.18
23	000776	广发证券	285,000	4,776,600.00	1.17
24	601988	中国银行	1,477,489	4,742,739.69	1.16
25	000858	五粮液	139,252	4,529,867.56	1.11
26	601989	中国重工	688,595	4,358,806.35	1.07
27	601818	光大银行	1,151,699	4,330,388.24	1.06
28	000001	平安银行	494,434	4,301,575.80	1.05
29	600048	保利地产	477,167	4,117,951.21	1.01
30	600276	恒瑞医药	99,775	4,001,975.25	0.98
31	600015	华夏银行	389,940	3,856,506.60	0.95
32	300104	乐视网	71,800	3,798,938.00	0.93

33	600999	招商证券	228,326	3,767,379.00	0.92
34	600028	中国石化	760,423	3,589,196.56	0.88
35	600518	康美药业	235,128	3,571,594.32	0.88
36	300059	东方财富	156,136	3,466,219.20	0.85
37	002736	国信证券	192,100	3,313,725.00	0.81
38	600958	东方证券	190,073	3,195,127.13	0.78
39	002304	洋河股份	44,121	3,173,182.32	0.78
40	002415	海康威视	142,479	3,057,599.34	0.75
41	002024	苏宁云商	268,089	2,911,446.54	0.71
42	002594	比亚迪	46,598	2,842,943.98	0.70
43	601390	中国中铁	406,746	2,835,019.62	0.70
44	002739	万达院线	35,000	2,796,500.00	0.69
45	601901	方正证券	365,000	2,795,900.00	0.69
46	601006	大秦铁路	430,301	2,771,138.44	0.68
47	600637	东方明珠	113,000	2,742,510.00	0.67
48	002673	西部证券	105,600	2,730,816.00	0.67
49	000166	申万宏源	322,240	2,710,038.40	0.66
50	600485	信威集团	145,900	2,602,856.00	0.64
51	000063	中兴通讯	181,437	2,601,806.58	0.64
52	601857	中国石油	346,019	2,501,717.37	0.61
53	601186	中国铁建	250,792	2,497,888.32	0.61
54	601377	兴业证券	337,462	2,493,844.18	0.61
55	601628	中国人寿	118,555	2,468,315.10	0.61
56	000538	云南白药	37,662	2,421,666.60	0.59
57	600111	北方稀土	181,267	2,412,663.77	0.59
58	000725	京东方 A	1,015,300	2,345,343.00	0.58
59	601899	紫金矿业	692,785	2,334,685.45	0.57
60	600050	中国联通	609,355	2,321,642.55	0.57
61	000625	长安汽车	169,000	2,310,230.00	0.57
62	600011	华能国际	302,376	2,273,867.52	0.56
63	601985	中国核电	324,600	2,217,018.00	0.54
64	600010	包钢股份	762,900	2,181,894.00	0.54
65	600795	国电电力	720,614	2,111,399.02	0.52
66	600585	海螺水泥	143,968	2,093,294.72	0.51
67	601336	新华保险	50,900	2,056,360.00	0.50
68	600690	青岛海尔	229,800	2,040,624.00	0.50
69	601088	中国神华	143,735	2,022,351.45	0.50
70	600893	中航动力	57,000	1,975,050.00	0.48
71	601211	国泰君安	110,400	1,964,016.00	0.48

72	600705	中航资本	322,200	1,894,536.00	0.46
73	600019	宝钢股份	383,800	1,880,620.00	0.46
74	601669	中国电建	314,900	1,798,079.00	0.44
75	600886	国投电力	256,700	1,694,220.00	0.42
76	600340	华夏幸福	69,400	1,691,972.00	0.41
77	600115	东方航空	250,300	1,654,483.00	0.41
78	601727	上海电气	213,897	1,617,061.32	0.40
79	601600	中国铝业	424,656	1,600,953.12	0.39
80	000069	华侨城 A	245,287	1,569,836.80	0.38
81	002252	上海莱士	40,300	1,518,504.00	0.37
82	000895	双汇发展	71,997	1,503,297.36	0.37
83	601788	光大证券	84,373	1,429,278.62	0.35
84	601998	中信银行	251,901	1,428,278.67	0.35
85	600061	国投安信	79,800	1,422,036.00	0.35
86	601018	宁波港	278,702	1,379,574.90	0.34
87	601618	中国中冶	352,230	1,299,728.70	0.32
88	601111	中国国航	188,273	1,272,725.48	0.31
89	600398	海澜之家	108,300	1,223,790.00	0.30
90	600018	上港集团	234,701	1,196,975.10	0.29
91	601800	中国交建	109,548	1,153,540.44	0.28
92	601225	陕西煤业	205,900	1,064,503.00	0.26
93	600023	浙能电力	208,272	1,060,104.48	0.26
94	002027	分众传媒	44,000	726,440.00	0.18
95	601898	中煤能源	138,586	715,103.76	0.18
96	601633	长城汽车	84,141	710,150.04	0.17
97	600959	江苏有线	43,800	611,448.00	0.15
98	600871	石化油服	130,000	499,200.00	0.12
99	600606	绿地控股	26,200	283,484.00	0.07

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300104	乐视网	4,035,903.00	0.85
2	600958	东方证券	2,969,934.92	0.62

3	002673	西部证券	2,628,686.64	0.55
4	002736	国信证券	2,421,098.13	0.51
5	600019	宝钢股份	2,266,940.36	0.48
6	601336	新华保险	1,855,219.00	0.39
7	601328	交通银行	1,808,888.00	0.38
8	600900	长江电力	1,560,651.94	0.33
9	600061	国投安信	1,376,871.00	0.29
10	600485	信威集团	1,215,304.98	0.26
11	600111	北方稀土	1,211,929.00	0.25
12	601377	兴业证券	1,148,193.00	0.24
13	000001	平安银行	1,098,784.00	0.23
14	601318	中国平安	1,098,114.00	0.23
15	002739	万达院线	1,060,547.00	0.22
16	000776	广发证券	1,044,565.00	0.22
17	601688	华泰证券	970,729.00	0.20
18	601288	农业银行	879,295.00	0.18
19	600585	海螺水泥	781,061.99	0.16
20	600010	包钢股份	765,341.00	0.16

注：买入金额不包括相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	3,715,636.76	0.78
2	601318	中国平安	2,701,093.27	0.57
3	600150	中国船舶	2,405,830.23	0.51
4	600111	北方稀土	2,307,629.00	0.48
5	601169	北京银行	2,294,820.34	0.48
6	600000	浦发银行	2,169,358.77	0.46
7	600340	华夏幸福	1,640,781.00	0.34
8	601988	中国银行	1,639,765.00	0.34
9	600031	三一重工	1,403,532.99	0.29
10	601601	中国太保	1,347,883.40	0.28
11	000001	平安银行	1,340,384.09	0.28
12	600637	东方明珠	1,111,726.40	0.23
13	601377	兴业证券	1,006,664.10	0.21

14	600958	东方证券	954,695.00	0.20
15	601166	兴业银行	936,445.00	0.20
16	000333	美的集团	900,238.95	0.19
17	300059	东方财富	851,838.52	0.18
18	002024	苏宁云商	837,862.44	0.18
19	002736	国信证券	829,499.00	0.17
20	600585	海螺水泥	826,173.93	0.17

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,556,326.67
卖出股票收入（成交）总额	53,856,260.41

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

中证 100 指数基金截至 2016 年 6 月 30 日前十名证券中的中信证券（600030）于 2015 年 11 月 26 收到中国证券监督管理委员会调查通知书，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

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

中证 100 指数基金截至 2016 年 6 月 30 日前十名证券中的海通证券（600837）于 2015 年 8 月 24 收到中国证券监督管理委员会调查通知书，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。于 2015 年 9 月 10 日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书，给予警告并责令其改正，没收违法所得同时处以罚款。

海通证券（600837）于 2015 年 9 月 12 日收到中国证监会行政处罚事先告知书，因公司对第三方交易终端软件未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，未按要求采集客户交易终端信息，情节严重，决定对相关责任人以及公司予以警告处罚，并进行罚款。

海通证券（600837）于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会调查通知书。因公司在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证

券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

中证 100 指数基金截至 2016 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的招商银行（600036）于 2016 年 1 月 9 日收到吉林证监局《关于对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定》。由于吉林省分行在从业人员的资格，销售材料，业务流程等多项内容上存在问题，现要求对上述行为进行改正，并于 2016 年 1 月 31 日前，向吉林证监局提交整改情况的书面报告，并等待检查验收。

本基金为开放式指数基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 100 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七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,512.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,407.39
5	应收申购款	2,940.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,861.13

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。



### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	10,574,363.80	2.59	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
5,681	76,679.25	279,501,345.99	64.16%	156,113,486.74	35.84%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,490,150.73	1.0308%

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 9 月 29 日）基金份额总额	2,008,751,627.96
本报告期期初基金份额总额	445,815,690.95
本报告期基金总申购份额	21,829,218.05
减:本报告期基金总赎回份额	32,030,076.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	435,614,832.73

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日(2009 年 9 月 29 日)起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，基金管理人未有受到稽查或处罚的情况。

2、本报告期内，基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	23,100,544.34	22.29%	21,513.72	22.33%	-
华宝证券	1	22,770,161.05	21.98%	21,206.19	22.01%	-
中信证券	2	15,498,258.00	14.96%	14,433.70	14.98%	-
高华证券	1	8,825,308.61	8.52%	8,219.04	8.53%	-
瑞银证券	1	8,511,258.30	8.21%	7,926.61	8.23%	-
东北证券	1	8,139,257.30	7.86%	7,580.06	7.87%	-
东兴证券	1	5,555,781.71	5.36%	5,062.98	5.25%	-
方正证券	2	5,507,475.31	5.32%	5,129.11	5.32%	-
申万宏源	3	1,823,958.52	1.76%	1,698.61	1.76%	-
国泰君安	2	1,518,452.00	1.47%	1,383.74	1.44%	-
广发证券	2	989,686.95	0.96%	921.73	0.96%	-
中银国际	1	397,000.00	0.38%	369.72	0.38%	-
华泰证券	1	272,344.00	0.26%	253.63	0.26%	-
华创证券	1	240,999.99	0.23%	224.46	0.23%	-
东方证券	2	201,400.00	0.19%	187.56	0.19%	-
长城证券	1	104,833.00	0.10%	97.63	0.10%	-
平安证券	1	92,340.00	0.09%	85.99	0.09%	-
兴业证券	2	67,460.00	0.07%	61.48	0.06%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

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

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元无变动。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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

## 10.8 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旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购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	2016 年 6 月 30 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在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加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	2016 年 6 月 24 日
3	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珠海盈米财富管理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	2016 年 5 月 31 日
4	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中国民生银行股份有限公司直销银行“基金通”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	2016 年 5 月 30 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰资产管理有限公司开通转换、定投业务并参加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	2016 年 5 月 3 日
6	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联泰资产管理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	2016 年 4 月 12 日
7	华宝兴业中证 100 指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2016 年 2 月 24 日
8	华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2016 年 2 月 24 日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 2 月 24 日
10	关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 2 月 24 日
11	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渤海银行申购及定投申购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	2016 年 1 月 27 日
12	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基	基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日

	金开放时间的公告		
13	关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
14	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国都证券有限责任公司申购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	2016 年 1 月 6 日
15	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中国工商银行“2016 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
16	华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
17	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	2016 年 1 月 4 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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 100 指数证券投资基金基金合同；  
 华宝兴业中证 100 指数证券投资基金招募说明书；  
 华宝兴业中证 100 指数证券投资基金托管协议；  
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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 8 月 26 日