

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证 100 指数
基金主代码	240014
交易代码	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
报告期末基金份额总额	432,859,035.19 份
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。

基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	3,312,283.41
2. 本期利润	19,739,815.07
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0454
4. 期末基金资产净值	424,902,432.50
5. 期末基金份额净值	0.9816

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

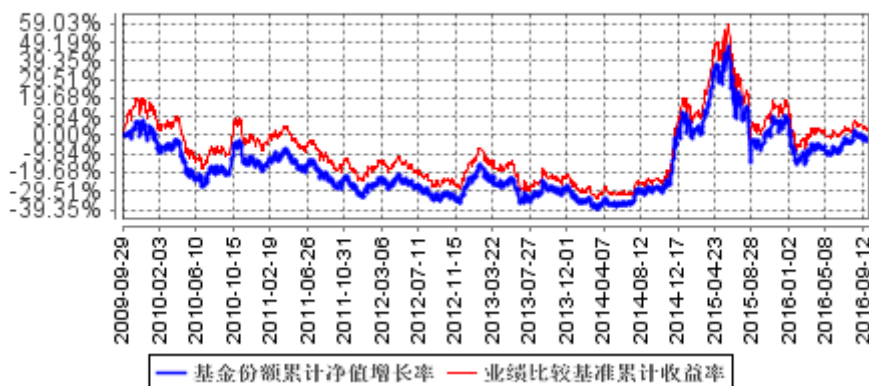
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	4.86%	0.74%	2.67%	0.73%	2.19%	0.01%

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

(2009年9月29日至2016年9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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈建华	本基金基金经理、华宝兴业事件驱动混合基金经理	2012 年 12 月 22 日	-	15 年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作。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。

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占基金资产净值比低于 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年三季度，在地产、汽车和基建行业带动下，工业、投资和消费等经济数据全面反弹，国内经济短期回暖。本报告期沪、深 A 股震荡向上行情，大盘蓝筹在于流动性宽松引发的估值反弹行情，中小创因估值相对较高而表现欠佳；但是行业间差异较大，跟房地产产业链的相关行业，如建筑材料、建筑装饰、家用电器、房地产等有基本面支撑的行业有较好涨幅，而计算机、传媒等行业表现较差。本报告期，沪深 300 和中证 100 指数分别上涨 3.15% 和 2.80%，而中

小板指和创业板分别下跌为 1.58%和 3.50%。

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。

4.5 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 4.86%，同期业绩比较基准收益率为 2.67%，基金表现领先于比较基准 2.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	403,434,218.03	94.72
	其中：股票	403,434,218.03	94.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,331,894.68	5.24
8	其他资产	165,313.45	0.04
9	合计	425,931,426.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	14,358,549.71	3.38
C	制造业	102,415,128.80	24.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,600,427.46	3.67
E	建筑业	16,452,361.22	3.87
F	批发和零售业	2,890,908.76	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	8,235,416.94	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,419,135.25	2.69
J	金融业	201,578,090.32	47.44
K	房地产业	25,158,507.73	5.92
L	租赁和商务服务业	624,588.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,674,309.00	0.39
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	2,327,888.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	402,735,311.19	94.78

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	329,017.74	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,541.58	0.02
E	建筑业	21,239.63	0.00
F	批发和零售业	32,547.63	0.01
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	230,560.26	0.05
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	698,906.84	0.16

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	783,328	26,758,484.48	6.30
2	600016	民生银行	1,692,824	15,675,550.24	3.69
3	601166	兴业银行	961,200	15,350,364.00	3.61
4	000002	万科 A	561,509	14,694,690.53	3.46
5	600036	招商银行	750,760	13,513,680.00	3.18
6	601328	交通银行	1,967,181	10,878,510.93	2.56
7	600519	贵州茅台	36,432	10,853,457.12	2.55
8	600000	浦发银行	627,712	10,350,970.88	2.44
9	600837	海通证券	579,636	9,222,008.76	2.17
10	600030	中信证券	567,768	9,152,420.16	2.15

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002812	创新股份	1,870	119,717.40	0.03
2	603189	网达软件	3,898	105,713.76	0.02
3	603393	新天然气	1,557	85,541.58	0.02
4	300541	先进数通	1,466	66,659.02	0.02
5	300534	陇神戎发	996	55,805.88	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

中证 100 基金截至 2016 年 9 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。

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

中证 100 指数基金截至 2016 年 9 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为，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 9 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。

中证 100 指数基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的民生银行（600016）于 2016 年 8 月 11 日收到北京证监局向公司下发监管关注函（京证监发 2016（175））《关于对中国民生银行股份有限公司的监管关注函》，要求民生银行完善公司治理结构，尽快落实独立董事的选举。

民生银行（600016）于 2016 年 7 月 26 日收到上海证券交易所下发监管工作函（上证公函[2016]0879 号）《关于中国民生银行股份有限公司加强规范运作的监管工作函》，对公司加强规范运作事项提出监管要求。

民生银行（600016）于 2016 年 7 月 25 日收到中国证券投资基金业协会向加银资管下发纪律处分决定书（中基协处分（2016）5 号），加银资管部分资产管理计划违规开展资金池业务，违反了中国证监会《关于进一步加强基金管理公司及其子公司从事特定客户资产管理业务风险管理的通知》和《证券期货经营机构落实资产管理业务“八条底线”禁止行为细则（2015 年 3 月版）》等相关规定。采取暂停受理加银资管资产管理计划备案 6 个月，并责令清理资金池业务的行政监管措施。

民生银行（600016）于 2016 年 7 月 19 日收到上海证券交易所于向公司下发监管工作函（上证公函[2016]0861 号）《关于中国民生银行股份有限公司股东增持事项的监管工作函》，要求公司督促股东披露增持公司股份有关事项。

民生银行（600016）于 2016 年 5 月 17 日收到中国证监会向加银资管下发行政监管措施决定书（〔2016〕49 号）《关于对民生加银资产管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，对加银资管部分资产管理计划较高比例投资于非标资产，但却每周开放申购赎回，违反了《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》相关规定。对此 采取责令改正、并暂停办理加银资管特定客户资产管理计划备案 3 个月的行政监管措施。

民生银行（600016）于 2016 年 4 月 18 日收到深圳证监局向加银基金下发行政监管措施决定书（〔2016〕22 号）《深圳证监局关于对民生加银基金管理有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》，因中国信息安全测评中心出具的《民生加银基金信息系统渗透测试报告》显示加银基金存在多项信息安全漏洞，违反了《证券期货业信息安全保障管理办法》相关规定，深圳证监局决定采取出具警示函的行政监管措施。

中证 100 指数基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的万科 A（000002）于 2016 年 8 月 5 日收到深圳证券交易所《关于对万科企业股份有限公司的关注函》（公司部关注函[2016]第 142 号）要求就股东以及恒大集团收购情况作出说明。

万科 A（000002）于 2016 年 7 月 8 日收到深圳证券交易所《关于对万科企业股份有限公司的关注函》（公司部关注函[2016]第 127 号）要求就股东以及媒体报道情况作出说明。

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五名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,816.93
2	应收证券清算款	133,943.48
3	应收股利	-
4	应收利息	4,536.99
5	应收申购款	13,016.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	165,313.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	435,614,832.73
报告期期间基金总申购份额	7,215,429.10
减：报告期期间基金总赎回份额	9,971,226.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	432,859,035.19

注：总申购份额含红利再投资和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	22,112,742.66
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	22,112,742.66
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	5.11

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业中证 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。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

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

华宝兴业基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日