（上接B81版）

（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	1,416,828.80	0.93
B	采矿业	2,480,763.33	1.62
C	制造业	92,040,778.02	60.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,515,106.00	2.30
E	建筑业	3,223,843.00	2.11
F	批发和零售业	7,338,272.00	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	4,580,813.60	2.99
H	住宿和餐饮业	192,822.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,878,460.92	9.07
J	金融业	109,624.00	0.07
K	房地产业	6,381,577.50	4.17
L	租赁和商务服务业	1,064,674.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	1,193,354.60	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	788,008.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	136,869.00	0.09
Q	卫生和社会工作	260,680.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	1,790,310.00	1.17
S	综合	1,616,707.61	1.06
	合计	142,009,492.38	92.79

（2）报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

（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。

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

（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	300113	顺网科技	5,900	523,330.00	0.34
2	002407	多氟多	6,700	518,580.00	0.34
3	300079	数码视讯	46,100	472,986.00	0.31
4	002426	胜利精密	19,500	434,265.00	0.28
5	300136	信维通信	14,000	412,860.00	0.27
6	300324	旋极信息	8,391	407,802.60	0.27
7	300367	东方网力	13,350	407,575.50	0.27
8	002019	亿帆鑫富	7,400	397,972.00	0.26
9	000806	银河生物	20,200	392,688.00	0.26
10	002176	江特电机	29,420	391,286.00	0.26

（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

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

4、报告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。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、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。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

（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。

（3）本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	46,022.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,048.80
5	应收申购款	500,697.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	549,769.40

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

i.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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000806	银河生物	392,688.00	0.26	重大资产重组

ii.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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

七、基金的业绩

基金业绩截止日为2016年3月31日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。

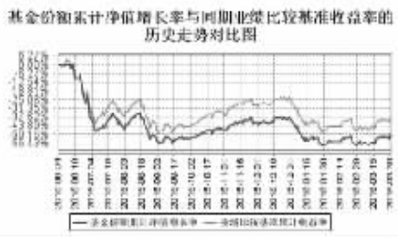
1、净值增长率与同期比较基准收益率比较

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
2015/06/04-2015/12/31	-38.97%	3.23%	-24.63%	3.26%	-14.34%	-0.03%
2016/01/01-2016/03/31	-20.50%	3.28%	-19.36%	3.33%	-1.14%	-0.05%
2015/06/04-2016/03/31	-51.48%	3.23%	-39.21%	3.27%	-12.27%	-0.04%

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

华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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。

八、基金份额的申购和赎回

基金合同生效后，投资者可通过场外、场内两种方式对华宝中证1000份额进行申购与赎回。华宝中证1000A份额与华宝中证1000B份额不接受投资者的申购与赎回，只上市交易。

（一）申购与赎回的场所

华宝中证1000份额的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者可使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构，办理华宝中证1000份额的场外申购与赎回业务。

投资者也可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所系统办理华宝中证1000份额的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格、且经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理华宝中证1000份额的申购与赎回。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理华宝中证1000份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自2015年6月16日起开始办理日常申购赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理华宝中证1000份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且基金管理人决定接受的，其华宝中证1000份额申购、赎回价格为下一开放日华宝中证1000份额申购、赎回的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的华宝中证1000份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购、转托管时基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；

5、场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资者申购华宝中证1000份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

（五）申购与赎回的数量限制

1、投资者通过直销e网金和其他场外销售机构申购本基金单笔最低金额为100元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为每笔100元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。场外销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各场外销售机构的业务规定为准。

2、投资者通过场内销售机构申购时，单笔申购申请的最低金额为50,000元。

3、其他销售机构的投资者欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

4、投资可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。

5、投资者可将其全部或部分华宝中证1000份额赎回。本基金按照份额进行赎回，单笔赎回份额不得低于100份。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的华宝中证1000份额余额不足100份的，在赎回时需一次全部赎回。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

（六）申购与赎回费用

1、申购费用

本基金采取前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的场外申购费率表如下，场内申购费率由场内销售机构参照场外申购费率执行。

申购金额	申购费率
200万（含）以上	每笔1000元
大于等于100万，小于200万	0.6%
100万以下	1.2%

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记费等各项费用。

2、赎回费用

本基金场外的赎回费率表如下：

持有期限	赎回费率
小于1年	0.5%
大于等于1年，小于2年	0.3%
大于等于2年	0

注：此处一年按365日计算

本基金场内的赎回费率为0.5%。

赎回费用由赎回华宝中证1000份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回华宝中证1000份额时收取。不低于赎回费总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、办理华宝中证1000份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

（七）申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

1、申购份额的计算方式

华宝中证1000份额的场外、场内申购均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日华宝中证1000份额的基金份额净值

申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日华宝中证1000份额的基金份额净值

场外申购份额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购份额的计算先按四舍五入方法保留到小数点后两位，再按截尾法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额由场内销售机构返还投资者。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假定某投资者投资100,000元通过场外申购华宝中证1000份额，对应的申购费率为1.2%，申购当日华宝中证1000份额的基金份额净值为1.0861元，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额=100,000/（1+1.2%）=98,814.23元

申购费用=100,000-98,814.23=1,185.77元

申购份额=98,814.23/1.0861=90,980.78份

即：投资者投资100,000元通过场外申购华宝中证1000份额，假定申购当日华宝中证1000份额的基金份额净值为1.0861元，可得到90,980.78份华宝中证1000份额。

例：假定某投资者投资100,000元通过场内申购华宝中证1000份额，对应的申购费率为1.2%，申购当日华宝中证1000份额的基金份额净值为1.0861元，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额=100,000/（1+1.2%）=98,814.23元

申购费用=100,000-98,814.23=1,185.77元

申购份额=98,814.23/1.0861=90,980.78份（四舍五入）=90,980份（截尾）

退款金额=0.78×1.0861=0.84元

即：投资者投资100,000元通过场内申购华宝中证1000份额，假定申购当日华宝中证1000份额的基金份额净值为1.0861元，可得到90,980份华宝中证1000份额。

2、赎回金额的计算方式

华宝中证1000份额的场外、场内赎回均采用份额赎回的方式。赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×赎回当日华宝中证1000份额的基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额—赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者通过场外赎回10,000份华宝中证1000份额，基金份额的持有期限13个月，对应的赎回费率为0.3%，假设赎回当日华宝中证1000份额的基金份额净值是1.1615元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1615=11,615.00元

赎回费用=11,615×0.3%=34.85 元

赎回金额=11,615-34.85=11,580.15元

即：某投资者通过场外赎回10,000份华宝中证1000份额，基金份额的持有期限13个月，对应的赎回费率为0.3%，假设赎回当日华宝中证1000份额的基金份额净值是1.1615元，则其可得到的赎回金额为11,580.15元。

例：某投资者通过场内赎回10,000份华宝中证1000份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日华宝中证1000份额的基金份额净值是1.1502元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1502=11,502.00元

赎回费用=11,502×0.5%=57.51 元

赎回金额=11,502-57.51=11,444.49元

即：某投资者通过场内赎回10,000份华宝中证1000份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日华宝中证1000份额的基金份额净值是1.1502元，则其可得到的赎回金额为11,444.49元。

3、华宝中证1000份额基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日华宝中证1000份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

8、发生基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受申购申请的情形。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。

6、发生基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受赎回申请的情形。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若华宝中证1000份额单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额（包括华宝中证1000份额、华宝中证1000A份额与华宝中证1000B份额）的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的场外处理方式

当华宝中证1000份额出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括华宝中证1000份额、华宝中证1000A份额与华宝中证1000B份额）的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权开以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、巨额赎回的场内处理方式

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相应规则进行处理。

4、暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受华宝中证1000份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

5、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

（十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日华宝中证1000份额的基金份额净值。如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数，并应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日的华宝中证1000份额的基金份额净值。

（十二）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

（十三）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

九、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金标的指数许可使用费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券/期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、基金的上市费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.22%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、基金标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数许可使用费，基金合同生效后的标的指数许可使用费从基金财产中列支。

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。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效日所在季度的指数许可使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度5万元。指数许可使用费将按照上述指数许可协议的约定进行支付。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述“一、基金费用的种类中第4—11项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和/或基金托管费率。基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定，华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金招募说明书》作如下更新：

1、“三、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。

2、“四、基金托管人”更新了基金托管人的相关信息。

3、“五、相关服务机构”更新了本基金代销机构的相关信息。

4、“十三、基金的投资”更新了截至2016年3月31日的基金的投资组合报告。

5、“十四、基金的业绩”更新了截至2016年3月31日的基金业绩数据。

6、“二十六、对基金份额持有人的服务”更新了本基金办理定期定额投资计划的办理场所。

7、“二十七、其他应披露事项”对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要，须与本基金《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司

2016年7月16日

证券代码：600157　证券简称：永泰能源　公告编号：临2016－093
债券代码：122111、122215、122222、122267、136351、136439
债券简称：11永泰债、12永泰01、12永泰02、13永泰债、16永泰01、16永泰02

永泰能源股份有限公司
第九届董事会第四十七次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

永泰能源股份有限公司第九届董事会第四十七次会议通知于2016年7月12日以书面形式和电子邮件发出，会议于2016年7月15日以通讯方式召开，应参与表决董事8人，实参与表决董事8人，会议的召集、召开符合《公司法》、《公司章程》的有关规定。经会议表决，一致审议通过了以下议案：

一、关于公司发行短期融资券的议案

表决结果：同意8票，反对0票，弃权0票，审议通过本议案。

为了优化债务结构，降低财务成本，满足业务发展资金需求，董事会同意公司向中国银行间市场交易商协会申请注册总额不超过人民币40亿元（含40亿元）的短期融资券，并根据市场环境和公司实际资金需求在上述申请注册总额度内分批注册、分期发行。

本议案需提请公司股东大会进行审议，并经向中国银行间市场交易商协会申请注册获准后实施。

二、关于公司为山西沁源康伟森达源煤业有限公司提供担保的议案

表决结果：同意8票，反对0票，弃权0票，审议通过本议案。

董事会同意控股子公司山西康伟集团有限公司的控股子公司山西沁源康伟森达源煤业有限公司（以下简称“森达源煤业”）向国家开发银行股份有限公司申请项目中长期借款24,500万元、期限8年，由公司与全资子公司华兴电力股份公司（以下简称“华兴电力”）为其提供连带责任保证担保。具体借款、担保的内容及方式以签订的相关合同内容为准。该笔担保由森达源煤业提供反担保。

本议案需提请公司股东大会进行审议。

三、关于召开2016年第八次临时股东大会的议案

表决结果：同意8票、反对0票、弃权0票，审议通过本议案。

董事会决定于2016年8月2日以现场方式和网络投票相结合的方式召开2016年第八次临时股东大会，会议审议事项为：1、关于公司发行短期融资券的议案；2、关于公司为山西沁源康伟森达源煤业有限公司提供担保的议案。

永泰能源股份有限公司董事会
二〇一六年七月十六日

证券代码：600157　证券简称：永泰能源　公告编号：临2016－094
债券代码：122111、122215、122222、122267、136351、136439
债券简称：11永泰债、12永泰01、12永泰02、13永泰债、16永泰01、16永泰02

永泰能源股份有限公司
关于拟发行短期融资券的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

为优化债务结构，降低财务成本，满足业务发展资金需求，公司拟向中国银行间市场交易商协会申请注册发行短期融资券，具体内容如下：

一、发行方案

1、发行规模及发行安排

本次申请注册短期融资券总额不超过人民币40亿元（含40亿元），并根据市场环境和公司实际资金需求在上述申请注册总额度内择机分批注册、分期发行。

2、发行期限

本次注册发行短期融资券的期限不超过1年（含1年）。

3、发行利率

本次短期融资券遵循相关规定按面值发行，发行利率根据公司信用评级及发行时的市场情况确定。

4、发行对象

全国银行间债券市场机构投资者。

5、募集资金用途

本次短期融资券主要用于优化债务结构，降低财务成本，满足业务发展资金需求及其他符合国家法律法规及政策要求的企业生产经营活动。

6、决议有效期

本次短期融资券的注册发行决议经公司股东大会审议通过后，在本次短期融资券的注册有效期内持续有效。

二、本次发行的授权事项

为合法、高效地完成本次短期融资券的注册发行工作，董事会提请公司股东大会授权董事会负责本次短期融资券发行的实施，并全权处理与本次发行有关的一切事宜，包括但不限于：

1、确定和修订本次发行的具体金额、期限、发行期数、承销方式及发行时机等具体发行方案；

2、决定聘请为本次发行提供服务的主承销商及其他中介机构；

3、在上述授权范围内，负责修订、签署和申报与本次发行有关的一切协议和法律文件，并办理短期融资券的相关申报、注册手续；

4、如监管政策或市场条件发生变化，可依据监管部门的意见对本次发行的具体方案等相关事项进行相应调整；

5、办理与本次短期融资券发行相关的其它事宜；

6、上述授权在本次发行的短期融资券的注册有效期内持续有效。

三、审议决策程序

本次短期融资券发行已经公司第九届董事会第四十七次会议审议通过，尚需提交公司股东大会进行审议，并经向中国银行间市场交易商协会申请注册获准后实施。

特此公告。

永泰能源股份有限公司董事会
二〇一六年七月十六日

证券代码：600157　证券简称：永泰能源　公告编号：临2016－095
债券代码：122111、122215、122222、122267、136351、136439
债券简称：11永泰债、12永泰01、12永泰02、13永泰债、16永泰01、16永泰02

永泰能源股份有限公司
关于提供担保的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

●被担保人名称：山西沁源康伟森达源煤业有限公司（以下简称“森达源煤业”）。

●本次公司对森达源煤业提供担保金额24,500万元。累计为其提供担保24,500万元

●公司目前对外担保总额度为3,736,737.47 万元（其中：公司对子公司及其附属企业提供担保总额度为 2,101,500.00万元；所属子公司之间提供担保总额度为1,266,437.47万元；子公司为公司提供担保总额度为206,000.00 万元；公司对外部企业提供担保总额度为 162,800.00万元）。

●本次担保事项由被担保方提供相应反担保。

●公司无对外逾期担保。

一、担保情况概述

经公司2016年7月15日召开的第九届董事会第四十七次会议审议通过，同意提供以下担保：

公司控股子公司山西康伟集团有限公司的控股子公司森达源煤业拟向国家开发银行股份有限公司申请项目中长期借款24,500万元、期限8年，由公司与全资子公司华兴电力股份公司（以下简称“华兴电力”）为其提供连带责任保证担保。该笔担保由森达源煤业提供反担保。上述担保事项相关的担保内容及方式以签订的相关合同内容为准。

上述担保事项需提交公司2016年第八次临时股东大会进行审议。

二、被担保人基本情况

森达源煤业，注册地址：长治市沁源县王陶乡陶村，法定代表人：郭向清，注册资金：1,000万元，企业性质：其他有限责任公司，主要经营范围：煤炭开采、洗选煤（依法须经批准的项目，经相关部门审批后，方可开展经营活动）。该公司为本公司控股子公司山西康伟集团有限公司的控股子公司。

截至2016年3月末，森达源煤业资产总额216,705.19万元，负债总额101,038.77万元，净资产115,666.42万元，资产负债率46.62%；2016 年1-3月实现营业收入986.68万元，净利润-981.46万元。

三、担保的主要内容

森达源煤业拟向国家开发银行股份有限公司申请项目中长期借款24,500万元、期限8年，由公司与全资子公司华兴电力为其提供连带责任保证担保。该笔担保由森达源煤业提供反担保。上述担保事项相关的担保内容及方式以签订的相关合同内容为准。

四、董事会意见

公司董事会认为：1、森达源煤业本次融资业务为经营发展需要，其具有足够的债务偿还能力，且为公司对所属企业之间的担保，相关担保风险较小。2、本次担保事项由被担保方提供相关反担保，能够保障公司的利益。3、本次担保事项符合相关法律法规、规范性文件和《公司章程》中有关对外担保规定的要求。

五、累计对外担保数量及逾期担保