

# 华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 1 月 22 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 2018 年 1 月 18 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 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华宝中证 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
报告期末基金份额总额	108,055,458.63 份
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。		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金场内简称	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金的份额总额	7,220,835.00 份	7,220,835.00 份	93,613,788.63 份
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。

### § 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（2017年10月1日—2017年12月31日）
1. 本期已实现收益	-4,510,915.71
2. 本期利润	-8,458,719.16
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0792
4. 期末基金资产净值	71,923,861.62
5. 期末基金份额净值	0.6656

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

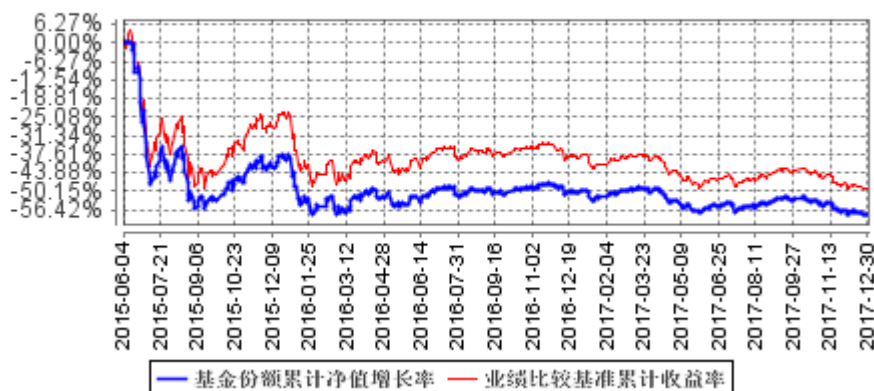
### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-10.37%	0.96%	-10.01%	0.96%	-0.36%	0.00%

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

(2015 年 6 月 4 日至 2017 年 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：按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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		
胡洁	本基金基金经理、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接、华宝中证	2015 年 6 月 4 日	-	11 年	金融学硕士，量化投资部总经理助理。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 成长交

	医疗指数分级、华宝中证军工 ETF、华宝标普中国 A 股红利机会指数 (LOF)、华宝中证银行 ETF (场内简称“银行 ETF”) 基金经理			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 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 8 月起兼任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月兼任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月任华宝中证银行交易型开放式指数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、《华宝基金管理有限公司华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年四季度，国内各项经济指标基本符合预期，11 月工业增加值同比增长 6.1%，固定资产投资累计同比增长 7.2%，社会消费品零售总额同比增长 10.2%，信贷增速略超预期，M2 同比企稳回升，12 月 PMI 指数 51.6%，经济总体表现出较强的韧劲。美联储 12 月宣布加息符合市场普遍预期，央行顺势温和上调 OMO、MLF 利率有助于维持中美利差，保持人民币汇率水平相对稳定。从 A 股表现来看，市场依然维持了前期白马股和价值股更加强势的格局。尽管 10 月白马股整体出现一波回调，但是年底的反弹依然由白马股引领，保险、食品饮料和家电板块涨幅居前。市场总体走出震荡上行的行情。个股方面大小盘分化明显，本报告期内，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别上涨了 8.27%和 5.07%；而作为中小盘股代表的创业板指和中证 500 指数分别下跌了 6.12%和 5.34%。在本报告期内，中证 1000 指数累计下跌了 10.52%。

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-10.37%，同期业绩比较基准收益率为-10.01%，基金表现落后业绩比较基准 0.36%。

### 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	67,809,162.38	93.84
	其中：股票	67,809,162.38	93.84
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	4,358,219.50	6.03
8	其他资产	95,127.21	0.13
9	合计	72,262,509.09	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	820,801.00	1.14
B	采矿业	1,367,572.16	1.90
C	制造业	42,629,803.28	59.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,694,963.20	2.36
E	建筑业	2,216,451.51	3.08
F	批发和零售业	2,674,072.10	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,807,167.78	2.51
H	住宿和餐饮业	83,925.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,399,820.96	8.90
J	金融业	343,235.80	0.48
K	房地产业	2,881,612.90	4.01
L	租赁和商务服务业	866,314.32	1.20
M	科学研究和技术服务业	498,936.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	800,018.74	1.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	369,336.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	1,141,892.07	1.59

S	综合	835,394.64	1.16
	合计	67,431,317.46	93.75

### 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	44,400.00	0.06
B	采掘业	-	-
C	制造业	212,641.46	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	67,703.46	0.09
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	1,580.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	51,520.00	0.07
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	377,844.92	0.53

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	300142	沃森生物	17,000	310,250.00	0.43
2	600779	水井坊	5,400	252,720.00	0.35
3	002185	华天科技	27,000	230,040.00	0.32
4	300355	蒙草生态	17,800	223,212.00	0.31
5	002035	华帝股份	7,320	220,624.80	0.31
6	600567	山鹰纸业	50,400	218,736.00	0.30
7	002509	天广中茂	23,704	213,573.04	0.30
8	000040	东旭蓝天	14,800	207,940.00	0.29
9	600702	沱牌舍得	4,300	200,638.00	0.28
10	600252	中恒集团	44,000	193,160.00	0.27

### 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	002504	*ST 弘高	10,798	67,703.46	0.09
2	600530	交大昂立	8,000	58,960.00	0.08
3	300187	永清环保	4,600	51,520.00	0.07
4	002103	广博股份	4,760	44,982.00	0.06
5	600257	大湖股份	6,000	44,400.00	0.06

### 5.4 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投资。

### 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。

## 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 1000 指数分级基金截至 2017 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的沱牌舍得（600702）于 2017 年 3 月 20 日收到射洪县环保局整改通知。因其热电分公司废气氮氧化物监测超标。处以罚款 100,000 元。

中证 1000 指数分级基金截至 2017 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的山鹰纸业(600567)于

2017 年 7 月 27 日收到国家环保部的整改通知。因公司年综合利用 12 万吨造纸废弃物技改项目超期未验，未经环评审批擅自建设年回收利用 5800 吨脱墨污泥技改项目，并投入生产。收到整改通知。

中证 1000 指数分级基金截至 2017 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的天广中茂（002509）于 2017 年 5 月 9 日收到福建证监局警告。因公司未对非经营性资金占用事项履行临时报告的信息披露义务，决定采取出具警示函的监督管理措施。

本基金为开放式指数分级基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 1000 指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本报告期内，本基金投资的前十名证券的其余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。

### 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	3,423.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	997.97
5	应收申购款	90,705.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,127.21

### 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**

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	600530	交大昂立	58,960.00	0.08	重大事项停牌
2	300187	永清环保	51,520.00	0.07	重大事项停牌
3	002103	广博股份	44,982.00	0.06	重大事项停牌
4	600257	大湖股份	44,400.00	0.06	重大事项停牌

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
报告期期初基金份额总额	7,412,746.00	7,412,746.00	94,097,230.13
报告期期间基金总申购份额	-	-	2,204,611.37
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	7,347,024.21
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-191,911.00	-191,911.00	4,658,971.34
报告期期末基金份额总额	7,220,835.00	7,220,835.00	93,613,788.63

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。

**§ 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**

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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 影响投资者决策的其他重要信息****8.1 影响投资者决策的其他重要信息**

1. 基金管理人于 2017 年 12 月 12 日发布《华宝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办理定期份额折算业务的公告》，根据本基金合同的约定，华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金以 2017 年 12 月 15 日为基金份额折算基准日办理定期份额折算业务。

定期份额折算业务于 2017 年 12 月 18 日办理完毕，自 2017 年 12 月 19 日起本基金恢复了申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务。

2. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，旗下已管理和已获批未募集的公开募集证券投资基金自 2017 年 12 月 30 日起变更基金名称（各基金的基金代码保持不变）。变更事项符合现行相关法律法规及基金合同的规定，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。本次变更不影响本公司旗下基金已签署的全部法律文件的效力及履行。

根据上述公告，本基金自 2017 年 12 月 30 日起基金名称变更为“华宝中证 1000 指数分级证券投资基金”。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同；  
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书；  
华宝中证 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。

### 9.2 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。

### 9.3 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。

华宝基金管理有限公司

2018 年 1 月 22 日