

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）

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

送出日期：2018 年 3 月 27 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 2018 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金		
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		
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		
报告期末基金份额总额	108,055,458.63 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	7,220,835.00 份	7,220,835.00 份	93,613,788.63 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	<p>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。</p> <p>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。</p>		
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	<p>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。</p>		
下属分级基金的风险收益特征	<p>华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。</p>	<p>华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。</p>	<p>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。</p>

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

2.4 信息披露方式

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。

§ 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	2017 年	2016 年	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	-7,585,252.22	-26,938,665.53	-124,557,018.36
本期利润	-13,338,496.79	-29,529,606.35	-133,451,005.28
加权平均基金份额本期利润	-0.1135	-0.1912	-0.7229
本期加权平均净值利润率	-14.90%	-23.23%	-76.83%
本期基金份额净值增长率	-14.42%	-19.19%	-38.97%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-99,663,522.64	-115,486,611.86	-129,672,978.28
期末可供分配基金份额利润	-0.9223	-0.8904	-0.7454
期末基金资产净值	71,923,861.62	104,976,629.34	180,189,971.89
期末基金份额净值	0.6656	0.8094	1.0358
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-57.79%	-50.68%	-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	-10.37%	0.96%	-10.01%	0.96%	-0.36%	0.00%
过去六个月	-6.15%	0.94%	-5.68%	0.95%	-0.47%	-0.01%
过去一年	-14.42%	0.97%	-16.50%	0.97%	2.08%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-57.79%	2.04%	-48.94%	2.06%	-8.85%	-0.02%

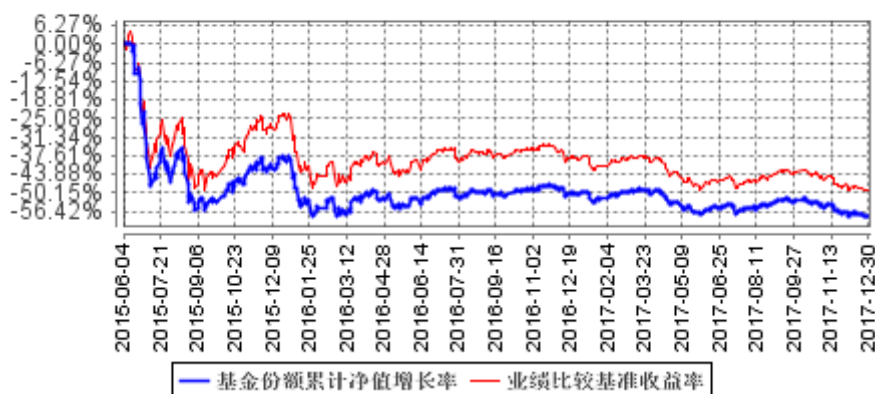
注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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 2017 年 12 月 31 日）

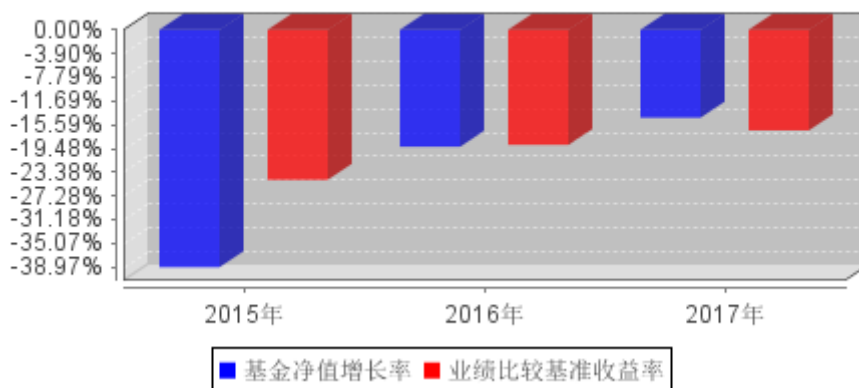
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 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 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（2017 年 12 月 31 日），所管理的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、医药生物基金、资源优选基金、华宝添益基金、服务优选基金、创新优选基金、生态中国基金、量化对冲基金、高端制造基金、品质生活基金、稳健回报基金、事件驱动基金、国策导向基金、新价值基金、新机遇基金、医疗分级基金、中证 1000 分级基金、万物互联基金、转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来主导产业基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金、新优享基金和银行 ETF，所管理的证券投资基金资产净值合计 124,360,151,012.53 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、华宝上证 180 成长 ETF 联接、华宝中证医疗指数分级、华	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 成长交易型开

	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				<p>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。</p>
张奇	本基金基金经理助理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、上证 180 成长 ETF、华宝上证	2017 年 4 月 6 日	-	7 年	<p>本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价</p>

	180 成长 ETF 联接、 华宝中证 医疗指数 分级、华 宝中证军 工 ETF 基 金经理助 理			值交易型开放式指数 证券投资基金联接基 金基金经理助理，2015 年 5 月起兼任上证 180 成长交易型开放式指 数证券投资基金、华宝 上证 180 成长交易型开 放式指数证券投资基 金联接基金基金经理 助理，2017 年 4 月起任 华宝中证医疗指数分 级证券投资基金、华宝 中证 1000 指数分级证 券投资基金、华宝中证 军工交易型开放式指 数证券投资基金基金 经理助理。
--	---	--	--	--

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 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

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。

4.3.3 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

2017 年，中国经济发展稳定，GDP 增速、通胀水平、工业增加值、投资和消费增速都呈现出相对平稳的走势，各项经济数据基本符合预期。12 月召开的中央经济工作会议给出了“经济实力再上新台阶，成为世界增长的主要动源和稳定器；经济结构出现重大变革，更具活力和韧性”的定调，显示出政府对当下中国经济发展的信心。市场方面，2017 年的 A 股市场演绎了投资者结构改变和监管层引导下的市场投资风格转变。以上证 50 指数和沪深 300 指数为代表的蓝筹股走出了波澜壮阔的牛市行情，保险、食品饮料、家电等聚集了众多高质量白马股的板块领涨全市场。与之对应的，相对估值较高的创业板指数和中证 1000 指数成分股则出现了一定程度的调整。指数方面，市场风格继续分化，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数表现较好，分别上涨了 30.21%和 21.78%；而作为中小盘股代表的创业板指和中证 1000 指数表现较弱，分别下跌了 10.67%和 17.35%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，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-14.42%，同期业绩比较基准收益率为

-16.50%，基金表现领先业绩比较基准 2.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政府明确了经济由高增速发展向高质量发展转变的思路方针，并强调了当下经济的活力和韧性，传达了未来进一步推进经济结构转型的坚定信念。同时当下平稳健康的经济状况为中国经济转型与改革提供了条件。预期 2018 年，财政和货币政策将维持稳健中性，监管依然会保持高压，经济增速可能小幅回落，但总体情况依然健康稳健。中国加入 MSCI 后，随着投资者结构的进一步变化，市场参与者将更加趋于理性及成熟。在此市场环境下，我们认为资本市场未来将继续维持结构性行情，当下注重上市公司盈利能力和盈利质量的投资风格有望延续，A 股中长期结构性慢牛格局不变，投资者可以更多关注资产长期配置价值以及估值修复带来的机会。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，全面覆盖了电子、化工、医药生物、计算机、机械设备、电气设备、有色金属、传媒等 28 个行业。2017 年 A 股市场延续风格分化行情，但分化的程度随着估值的有效纠偏而有所收敛，小市值公司经历了持续调整后风险得到一定的释放，部分股票有望在 2018 年或将迎来阶段性的修复行情，投资者可以通过投资中证 1000 指数在大小盘风格轮动的过程中把握小盘股的投资机会。

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。2017 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、依据《证券期货投资者适当性管理办法》对公司相关内部流程进行了差异性评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，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适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

（1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，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，量化投资部根据估值委员会确定的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，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会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

本基金本报告期亏损，无应分未分的利润。

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

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，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		4,357,559.83	6,424,942.83
结算备付金		659.67	2,637.42
存出保证金		3,423.38	16,128.15
交易性金融资产		67,809,162.38	99,470,723.98
其中：股票投资		67,809,162.38	99,470,723.98
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	30,915.98
应收利息		997.97	1,415.86
应收股利		-	-
应收申购款		90,705.86	6,987.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		72,262,509.09	105,953,751.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1.20	279,606.56
应付赎回款		24,210.13	38,276.78
应付管理人报酬		62,259.51	91,342.86
应付托管费		13,697.09	20,095.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		88,468.04	207,679.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		150,011.50	340,120.62
负债合计		338,647.47	977,122.03
所有者权益：			
实收基金		170,411,754.42	212,869,103.61
未分配利润		-98,487,892.80	-107,892,474.27
所有者权益合计		71,923,861.62	104,976,629.34
负债和所有者权益总计		72,262,509.09	105,953,751.37

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.6656 元，基金份额总额 93,613,788.63 份；华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0024 元，基金份额总额 7,220,835.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额净值 0.3288 元，基金份额总额 7,220,835.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-11,740,361.71	-27,136,842.48
1.利息收入		40,269.51	71,856.41
其中：存款利息收入		40,265.34	71,856.41
债券利息收入		4.17	-
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）		-6,051,543.73	-24,775,450.23
其中：股票投资收益		-6,519,909.33	-25,231,388.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,533.29	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		462,832.31	455,938.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,753,244.57	-2,590,940.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		24,157.08	157,692.16
减：二、费用		1,598,135.08	2,392,763.87
1. 管理人报酬		898,221.32	1,276,838.22
2. 托管费		197,608.64	280,904.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		111,085.12	422,858.70

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		391,220.00	412,162.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,338,496.79	-29,529,606.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,338,496.79	-29,529,606.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	212,869,103.61	-107,892,474.27	104,976,629.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,338,496.79	-13,338,496.79
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）	-42,457,349.19	22,743,078.26	-19,714,270.93
其中：1. 基金申购款	12,103,309.67	-6,606,632.31	5,496,677.36
2. 基金赎回款	-54,560,658.86	29,349,710.57	-25,210,948.29
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）	170,411,754.42	-98,487,892.80	71,923,861.62
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	295,270,982.70	-115,081,010.81	180,189,971.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-29,529,606.35	-29,529,606.35
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）	-82,401,879.09	36,718,142.89	-45,683,736.20
其中：1. 基金申购款	183,824,300.98	-98,616,839.62	85,207,461.36
2. 基金赎回款	-266,226,180.07	135,334,982.51	-130,891,197.56
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）	212,869,103.61	-107,892,474.27	104,976,629.34

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：

黄小薏

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(原华宝兴业中证 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《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。

根据《华宝中证 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”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额,将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后,华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。

场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%，华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后，根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），本基金将进行基金的定期份额折算：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，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配；持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份额的分配。经过上述份额折算后，华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元

时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算（基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日）：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

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，本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 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、货币市场工具、资产支持证券、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。本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基金管理有限公司于 2018 年 3 月 22 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度的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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度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。

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和债券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和债券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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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和债券，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[2017]13号《中国证监会关于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。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(以下简称“华宝	基金管理人、基金销售机构

基金”)	
中国建设银行股份有限公司(以下简称“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(以下简称“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.)	截止至 2017 年 10 月 16 日, 系基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	自 2017 年 10 月 17 日起, 系基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(以下简称“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(以下简称“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司(“宝钢财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(以下简称“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司

注:

- 1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
- 2、2017 年 10 月 17 日, 华宝基金管理有限公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续, 变更后公司的股权结构为: 华宝信托有限责任公司持股 51%, Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持股 49%。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	192,771.74	0.29%	28,980,461.53	10.99%

7.4.8.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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	179.55	0.29%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	26,991.30	11.00%	26,991.30	13.00%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	898,221.32	1,276,838.22
其中：支付销售机构的客户维护费	331,620.14	437,808.94

注：支付基金管理人 华宝基金 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	197,608.64	280,904.46

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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未投资本基金。

7.4.8.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	4,357,559.83	39,811.70	6,424,942.83	69,490.55

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比较期均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600057	象屿股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 8 日	配股流通受限	6.10	8.09	2,350	14,335.00	19,011.50	-

7.4.9.2 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
600257	大湖股份	2017年9月25日	重大事项停牌	7.40	-	-	6,000	76,280.91	-	-
600530	交大昂立	2017年11月13日	重大事项停牌	7.37	2018年1月5日	6.63	8,000	64,144.44	-	-
600084	中葡股份	2017年7月10日	重大事项停牌	7.52	-	-	12,600	89,268.91	-	-
600162	香江控股	2017年11月10日	重大事项停牌	3.37	2018年1月12日	3.71	29,250	127,784.90	-	-
600165	新日恒力	2017年12月27日	重大事项停牌	16.06	2018年1月9日	15.00	6,550	73,950.79	-	-
600226	瀚叶股份	2017年11月28日	重大事项停牌	5.93	-	-	20,620	158,633.06	-	-
600227	赤天化	2017年10月27日	重大事项停牌	7.09	2018年2月1日	6.38	12,200	72,598.25	-	-
600239	云南城投	2017年	重大事项	5.22	2018	5.74	21,000	98,566.79	-	-

	投	6 月 26 日	项停牌		年 1 月 17 日					
600273	嘉化能源	2017 年 10 月 26 日	重大事 项停牌	9.53	2018 年 3 月 7 日	10.00	10,500	109,277.03	-	-
600634	富控互动	2017 年 11 月 16 日	重大事 项停牌	17.54	2018 年 3 月 12 日	17.48	6,900	153,575.06	-	-
600686	金龙汽车	2017 年 12 月 29 日	重大事 项停牌	13.03	2018 年 1 月 10 日	13.03	4,800	85,276.12	-	-
600734	实达集团	2017 年 12 月 20 日	重大事 项停牌	9.40	-	-	5,000	48,035.00	-	-
600807	天业股份	2017 年 12 月 25 日	重大事 项停牌	10.01	-	-	9,900	109,645.33	-	-
600818	中路股份	2017 年 10 月 19 日	重大事 项停牌	22.83	2018 年 2 月 7 日	20.55	2,100	94,980.38	-	-
601003	柳钢股份	2017 年 10 月 17 日	重大事 项停牌	7.98	2018 年 1 月 18 日	7.50	9,000	39,764.14	-	-
002103	广博股份	2017 年 11 月	重大事 项停牌	9.45	-	-	4,760	68,826.08	-	-

		15 日								
002592	八菱科技	2017 年 11 月 20 日	重大事件停牌	22.29	-	-	1,900	69,437.74	-	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事件停牌	35.26		2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	-
000022	深赤湾 A	2017 年 11 月 20 日	重大事件停牌	24.14	-	-	-	2,400	42,985.59	-
000029	深深房 A	2016 年 9 月 14 日	重大事件停牌	11.17	-	-	-	6,200	81,266.58	-
000034	神州数码	2017 年 9 月 29 日	重大事件停牌	21.60	-	-	-	5,800	154,012.06	-
000035	中国天楹	2017 年 8 月 22 日	重大事件停牌	6.72	-	-	-	12,400	103,669.00	-
000615	京汉股份	2017 年 12 月 26 日	重大事件停牌	9.76		2018 年 1 月 10 日	10.74	7,600	121,658.10	-
000688	建新矿业	2017 年 9 月 6 日	重大事件停牌	10.95		2018 年 2 月 7 日	9.86	6,200	71,796.38	-
000757	浩物股	2017 年	重大事件	7.03	-	-	-	5,500	66,268.36	-

	份	10 月 24 日	项停牌							
000820	神雾节 能	2017 年 7 月 17 日	重大事 项停牌	28.96	2018 年 1 月 17 日	26.06	5,900	221,618.85	-	-
000971	高升控 股	2017 年 10 月 16 日	重大事 项停牌	16.79	2018 年 1 月 9 日	16.89	3,600	83,837.73	-	-
002033	丽江旅 游	2017 年 12 月 14 日	重大事 项停牌	9.10	2018 9.19 年 3 月 14 日		5,290	57,452.31	-	-
002130	沃尔核 材	2017 年 12 月 25 日	重大事 项停牌	5.76	2018 年 1 月 10 日	6.15	14,200	140,926.19	-	-
002260	德奥通 航	2017 年 12 月 5 日	重大事 项停牌	11.96	-	-	3,600	126,702.83	-	-
002263	大东南	2017 年 12 月 18 日	重大事 项停牌	2.79	2018 年 1 月 2 日	2.90	24,100	113,724.94	-	-
002425	凯撒文 化	2017 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	7.21	2018 年 1 月 22 日	7.35	7,680	89,527.07	-	-
002453	天马精	2017 年	重大事	7.79	2018	7.01	8,000	89,842.28	-	-

	化	10 月 24 日	项停牌		年 2 月 12 日						
002458	益生股 份	2017 年 12 月 27 日	重大事 项停牌	23.25	2018 年 1 月 30 日	20.93	2,200	41,597.10	-	-	
002524	光正集 团	2017 年 12 月 18 日	重大事 项停牌	6.35	-	-	5,700	57,150.95	-	-	
002545	东方铁 塔	2017 年 12 月 4 日	重大事 项停牌	8.67	-	-	3,400	41,582.00	-	-	
002575	群兴玩 具	2017 年 9 月 20 日	重大事 项停牌	9.10	-	-	6,300	72,013.43	-	-	
002579	中京电 子	2017 年 11 月 16 日	重大事 项停牌	10.20	2018 年 2 月 5 日	9.18	3,200	45,530.35	-	-	
002604	龙力生 物	2017 年 11 月 28 日	重大事 项停牌	8.74	-	-	8,200	112,645.45	-	-	
002622	融钰集 团	2017 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	14.06	2018 年 1 月 24 日	14.57	11,500	163,526.78	-	-	
002625	光启技 术	2017 年 12 月	重大事 项停牌	28.07	2018 年 1	30.88	4,100	190,672.42	-	-	

		20 日			月 4 日					
002697	红旗连锁	2017 年 12 月 15 日	重大事 项停牌	6.38	2018 年 1 月 3 日	7.02	13,040	86,692.84	-	-
002711	欧浦智网	2017 年 12 月 13 日	重大事 项停牌	10.76	2018 年 1 月 11 日	10.80	6,768	70,774.13	-	-
300038	梅泰诺	2017 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	48.60	-	-	2,700	137,968.96	-	-
300071	华谊嘉信	2017 年 11 月 30 日	重大事 项停牌	7.80	-	-	5,800	70,374.25	-	-
300086	康芝药业	2017 年 12 月 6 日	重大事 项停牌	10.80	-	-	5,350	91,514.71	-	-
300090	盛运环保	2017 年 12 月 1 日	重大事 项停牌	9.24	-	-	18,000	189,247.64	-	-
300109	新开源	2017 年 3 月 27 日	重大事 项停牌	46.46	2018 年 1 月 12 日	48.88	1,400	79,325.16	-	-
300140	中环装备	2017 年 7 月 13 日	重大事 项停牌	17.31	2018 年 1 月 24 日	15.58	3,200	72,516.07	-	-

					日					
300149	量子高科	2017 年 11 月 6 日	重大事 项停牌	15.35	2018 年 1 月 29 日	16.89	5,900	111,103.49	-	-
300152	科融环 境	2017 年 9 月 25 日	重大事 项停牌	6.73	2018 年 1 月 30 日	6.06	10,100	95,807.99	-	-
300173	智慧松 德	2017 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	7.90	-	-	3,800	60,002.34	-	-
300216	千山药 机	2017 年 12 月 25 日	重大事 项停牌	15.95	2018 年 1 月 18 日	14.36	4,600	159,675.54	-	-
300278	华昌达	2017 年 10 月 25 日	重大事 项停牌	17.12	-	-	4,800	83,714.96	-	-
300292	吴通控 股	2017 年 12 月 4 日	重大事 项停牌	5.67	2018 年 3 月 5 日	5.72	10,900	105,100.28	-	-
300339	润和软 件	2017 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	10.48	2018 年 1 月 5 日	10.73	5,700	114,869.52	-	-
300356	光一科 技	2017 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	6.99	-	-	3,300	63,251.68	-	-

300362	天翔环境	2017 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	12.92	2018 年 1 月 5 日	13.50	2,800	48,190.65	-	-
300364	中文在线	2017 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	9.23	2018 年 1 月 5 日	10.00	7,919	156,808.75	-	-
300392	腾信股份	2017 年 10 月 11 日	重大事 项停牌	14.93	-	-	3,400	130,774.89	-	-
300424	航新科技	2017 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	23.43	-	-	2,316	79,968.59	-	-
300523	辰安科技	2017 年 10 月 20 日	重大事 项停牌	47.30	2018 年 2 月 6 日	42.57	800	55,821.33	-	-
300187	永清环保	2017 年 10 月 9 日	重大事 项停牌	11.20	2018 年 1 月 15 日	10.80	4,600	59,371.32	-	-
300444	双杰电气	2017 年 11 月 20 日	重大事 项停牌	17.00	-	-	2,200	56,384.12	-	-

注：本基金截至 2017 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 2017 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 63,255,338.89 元，属于第二层次的余额为 4,553,823.49 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 90,728,184.34 元，第二层次 8,742,539.64 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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值、基金申购款和增值税外，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	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	其他各项资产	95,127.21	0.13
9	合计	72,262,509.09	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	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

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	44,400.00	0.06
B	采矿业	-	-
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

8.2.3 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。

8.3 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

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前十名股票投资明细

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	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 的年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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	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	大潮股份	6,000	44,400.00	0.06

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 的年度报告正文。

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	002035	华帝股份	355,078.00	0.34
2	600004	白云机场	320,354.00	0.31
3	000820	神雾节能	244,154.00	0.23
4	300145	中金环境	234,686.00	0.22
5	600252	中恒集团	229,044.00	0.22
6	600702	沱牌舍得	188,294.00	0.18
7	600320	振华重工	180,686.00	0.17
8	000717	韶钢松山	179,342.00	0.17
9	600175	美都能源	178,794.00	0.17
10	000088	盐田港	177,618.00	0.17
11	002429	兆驰股份	175,728.00	0.17
12	600797	浙大网新	174,496.00	0.17
13	600779	水井坊	173,004.00	0.16
14	002647	民盛金科	166,776.00	0.16
15	300618	寒锐钴业	166,114.00	0.16
16	000917	电广传媒	163,736.03	0.16
17	000933	神火股份	157,504.00	0.15
18	000615	京汉股份	153,867.00	0.15
19	300418	昆仑万维	153,180.00	0.15
20	300168	万达信息	147,043.00	0.14

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	600004	白云机场	347,774.30	0.33
2	002411	必康股份	279,630.00	0.27
3	603799	华友钴业	279,613.40	0.27
4	600885	宏发股份	252,087.00	0.24
5	600438	通威股份	240,300.00	0.23
6	300197	铁汉生态	232,245.07	0.22
7	002583	海能达	224,028.40	0.21
8	002359	北讯集团	203,328.50	0.19
9	002601	龙鳞佰利	201,522.00	0.19
10	002429	兆驰股份	200,770.00	0.19
11	000807	云铝股份	197,690.00	0.19
12	300383	光环新网	193,825.00	0.18
13	002108	沧州明珠	188,109.00	0.18
14	002035	华帝股份	186,150.00	0.18
15	300618	寒锐钴业	163,233.00	0.16
16	002852	道道全	162,638.33	0.15
17	600401	*ST 海润	148,473.00	0.14
18	000766	通化金马	142,009.00	0.14
19	600848	上海临港	138,336.00	0.13
20	300323	华灿光电	134,211.00	0.13

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	24,332,947.20
卖出股票收入（成交）总额	43,745,421.65

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。

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

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。

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	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

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

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的情况。

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	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

§ 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	84	85,962.32	6,331,544.00	87.68%	889,291.00	12.32%
1000B	334	21,619.27	294.00	0.00%	7,220,541.00	100.00%
华宝中证 1000 指数 分级	3,807	24,589.91	1,140,431.56	1.22%	92,473,357.07	98.78%
合计	4,225	25,575.26	7,472,269.56	6.92%	100,583,189.07	93.08%

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	6,254,646.00	86.62%
2	徐平	100,000.00	1.38%
3	张志赟	73,574.00	1.02%
4	王丽春	73,000.00	1.01%
5	梁小红	60,000.00	0.83%
6	刘春桃	51,000.00	0.71%
7	曲惠琴	48,600.00	0.67%
8	徐国飞	48,084.00	0.67%
9	张萍	33,500.00	0.46%

10	上海千象资产管理有限公司一千象子基金 3 号	33,115.00	0.46%
----	------------------------	-----------	-------

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	朱金元	1,462,176.00	20.25%
2	祝东华	690,354.00	9.56%
3	吴天爵	400,000.00	5.54%
4	谢锦星	223,800.00	3.10%
5	张珊珊	213,200.00	2.95%
6	杨玉锋	186,700.00	2.59%
7	刘文卿	155,800.00	2.16%
8	王杰	135,837.00	1.88%
9	陈建平	128,700.00	1.78%
10	王跃文	124,400.00	1.72%

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	0.00	0.0000%
	1000B	0.00	0.0000%
	华宝中证 1000 指数分级	56,355.78	0.0600%
	合计	56,355.78	0.0522%

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	份额级别	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	1000A	0
	1000B	0
	华宝中证 1000 指数分级	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝中证 1000 指数 分级	0
	合计	0

§ 10 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
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
本报告期期初基金份额总额	12,008,007.00	12,008,007.00	105,684,936.59
本报告期基金总申购份额	-	-	7,385,290.03
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	33,305,931.33
本报告期基金拆分变动份额(份额 减少以“-”填列)	-4,787,172.00	-4,787,172.00	13,849,493.34
本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。

§ 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

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强因个人原因，自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

2017 年 9 月 29 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任欧江洪先生为公司副总经理。

2017 年 9 月 29 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，韦历山先生因个人原因，自 2017 年 9 月 29 日起不再担任公司常务副总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

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

本报告期内，基金管理人、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	
中泰证券	2	15,347,968.30	23.00%	13,986.57	22.77%	-
东兴证券	1	10,389,775.80	15.57%	9,468.15	15.42%	-
海通证券	1	7,607,532.48	11.40%	7,085.31	11.54%	-
华创证券	1	7,217,190.74	10.81%	6,721.78	10.94%	-
招商证券	2	5,959,360.15	8.93%	5,430.71	8.84%	-
申万宏源	3	2,924,546.10	4.38%	2,723.63	4.43%	-
天风证券	2	2,897,399.30	4.34%	2,665.79	4.34%	-
安信证券	1	2,620,910.41	3.93%	2,441.67	3.98%	-
国泰君安	2	2,142,477.47	3.21%	1,957.20	3.19%	-
中信证券	2	2,132,350.54	3.20%	1,986.15	3.23%	-
广发证券	2	1,559,458.90	2.34%	1,452.38	2.36%	-
华泰证券	1	1,129,156.20	1.69%	1,051.51	1.71%	-
国金证券	1	1,083,752.80	1.62%	1,009.59	1.64%	-
兴业证券	2	970,013.21	1.45%	884.01	1.44%	-
银河证券	1	656,378.00	0.98%	611.36	1.00%	-
方正证券	2	433,886.47	0.65%	395.42	0.64%	-
中信建投	1	401,312.61	0.60%	365.72	0.60%	-
东吴证券	1	378,145.47	0.57%	352.14	0.57%	-

中银国际	1	245,683.69	0.37%	228.84	0.37%	-
华宝证券	1	192,771.74	0.29%	179.55	0.29%	-
民生证券	1	178,612.00	0.27%	166.50	0.27%	-
瑞银证券	1	116,066.00	0.17%	108.21	0.18%	-
信达证券	1	82,421.64	0.12%	76.76	0.12%	-
东北证券	1	72,444.48	0.11%	67.47	0.11%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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

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、本报告期租用的证券公司交易单元无变动。

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	5,569.36	17.55%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
瑞银证券	26,168.10	82.45%	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

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”。

华宝基金管理有限公司

2018 年 3 月 27 日