

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2017 年年度报告

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

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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	28
§ 8 投资组合报告	67
8.1 期末基金资产组合情况	67
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	67
8.3 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	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	106
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	108
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	108
8.7 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	108

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	108
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	108
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	108
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	109
8.12 投资组合报告附注	109
§9 基金份额持有人信息	112
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	112
9.2 期末上市基金前十名持有人	112
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	113
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	113
§10 开放式基金份额变动	115
§11 重大事件揭示	116
11.1 基金份额持有人大会决议	116
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	116
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	116
11.4 基金投资策略的改变	116
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	116
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	117
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	117
11.8 其他重大事件	120
§12 影响投资者决策的其他重要信息	126
§13 备查文件目录	127
13.1 备查文件目录	127
13.2 存放地点	127
13.3 查阅方式	127

§ 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	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。		
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。

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	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
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	孔祥清	田国立

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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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%

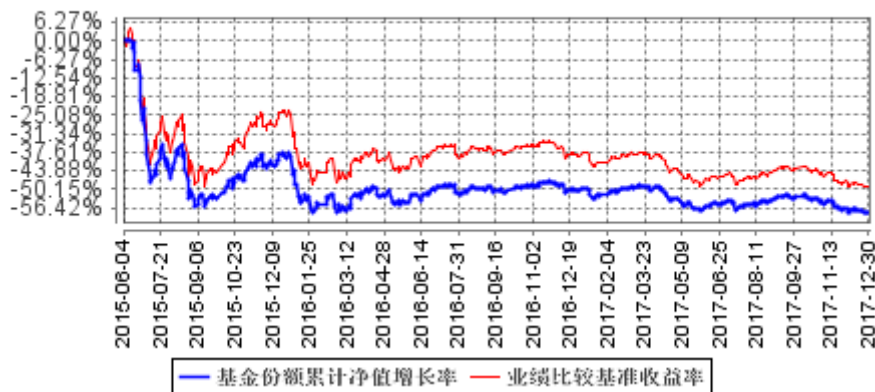
注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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）

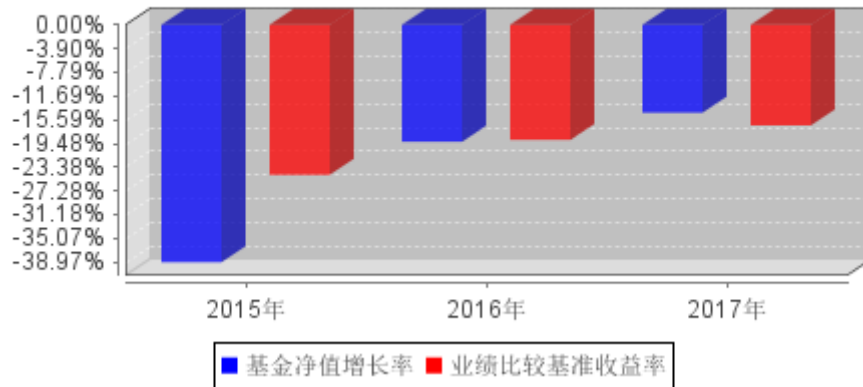
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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（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				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。
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	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

	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 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合规守信情况声明

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合规守信、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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20439 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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)全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了华宝中证 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“华宝中证 1000 指数基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华宝中证 1000 指数基金 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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华宝中证 1000 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	华宝中证 1000 指数基金的基金管理人华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,以下简称“基金管理人”)管理层负

	责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宝中证 1000 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华宝中证 1000 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督华宝中证 1000 指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华宝中证 1000 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝中证 1000 指数基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	曹阳
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2018 年 3 月 22 日	

§ 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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	30,915.98
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	170,411,754.42	212,869,103.61
未分配利润	7.4.7.10	-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 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
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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-6,519,909.33	-25,231,388.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,533.29	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	462,832.31	455,938.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-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）	7.4.7.18	24,157.08	157,692.16
减：二、费用		1,598,135.08	2,392,763.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	898,221.32	1,276,838.22
2. 托管费	7.4.10.2.2	197,608.64	280,904.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	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	7.4.7.20	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

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,357,559.83	6,424,942.83
定期存款	—	—
其中：存款期限 1-3 个月	—	—
其他存款	—	—
合计：	4,357,559.83	6,424,942.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		85,047,334.69	67,809,162.38	-17,238,172.31
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		85,047,334.69	67,809,162.38	-17,238,172.31
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		110,955,651.72	99,470,723.98	-11,484,927.74
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		110,955,651.72	99,470,723.98	-11,484,927.74

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	995.56	1,406.01
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	0.33	1.32
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.32	0.50
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.76	8.03

合计	997.97	1,415.86
----	--------	----------

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	88,468.04	207,679.76
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	88,468.04	207,679.76

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	11.50	120.62
预提费用	100,000.00	290,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	150,011.50	340,120.62

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,700,950.59	212,869,103.61
本期申购	7,112,593.83	11,673,237.77

本期赎回（以“-”号填列）	-31,719,703.00	-52,059,190.43
- 基金拆分/份额折算前	105,093,841.42	172,483,150.95
基金拆分/份额折算变动份额	4,275,149.34	
本期申购	272,696.20	430,071.90
本期赎回（以“-”号填列）	-1,586,228.33	-2,501,468.43
本期末	108,055,458.63	170,411,754.42

注：

1. 本基金的基金份额包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。本期申购含申购的华宝中证 1000 基础份额和配对转入的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额，本期赎回含赎回的华宝中证 1000 基础份额和配对转出的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。

2. 根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝基金管理有限公司于 2017 年 12 月 19 日发布的《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金以 2017 年 12 月 15 日为定期折算基准日，进行定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 89,565,373.42 份和 1,092,550.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.040679363，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 93,208,835.76 份和 1,724,237.00 份（含华宝中证 1000A 份额经折算后产生的新增华宝中证 1000 基础份额场内份额），份额净值为 0.676 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 7,217,959.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.081358726，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 7,217,959.00 份，份额净值为 1.000 元。

3. 截至 2017 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 15,622,968.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 1,181,298.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 7,220,835.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 92,432,490.63 份，均为华宝中证 1000 基础份额（2016 年 12 月 31 日：本基金于深交所上市的基金份额为 25,796,159.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 1,780,145.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 12,008,007.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 103,904,791.59 份，均为华宝中证 1000 基础份额）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登

记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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	-115,486,611.86	7,594,137.59	-107,892,474.27
本期利润	-7,585,252.22	-5,753,244.57	-13,338,496.79
本期基金份额交易产生的变动数	23,408,341.44	-665,263.18	22,743,078.26
其中：基金申购款	-6,668,685.41	62,053.10	-6,606,632.31
基金赎回款	30,077,026.85	-727,316.28	29,349,710.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-99,663,522.64	1,175,629.84	-98,487,892.80

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	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
活期存款利息收入	39,811.70	69,490.55
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	362.55	1,759.73
其他	91.09	606.13
合计	40,265.34	71,856.41

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出股票成交总额	43,745,421.65	154,098,885.96
减：卖出股票成本总额	50,265,330.98	179,330,274.37
买卖股票差价收入	-6,519,909.33	-25,231,388.41

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	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
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	31,737.46	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	26,200.00	-
减：应收利息总额	4.17	-
买卖债券差价收入	5,533.29	-

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	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
股票投资产生的股利收益	462,832.31	455,938.18
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	462,832.31	455,938.18

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-5,753,244.57	-2,590,940.82
——股票投资	-5,753,244.57	-2,590,940.82
——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	-5,753,244.57	-2,590,940.82

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	17,463.44	157,692.16
其他	6,693.64	—
合计	24,157.08	157,692.16

注：本基金场外的赎回费率按持有期间递减；场内的赎回费率为 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	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
交易所市场交易费用	111,085.12	422,858.70
银行间市场交易费用	—	—
合计	111,085.12	422,858.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	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
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	90,000.00	110,000.00
基金上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费用	1,220.00	1,762.49
其他	—	400.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	391,220.00	412,162.49

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》、华宝基金管理有限公司于 2018 年 2 月 6 日发布的《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关规定，本基金以 2018 年 2 月 2 日为基准日进行不定期份额折算。

7.4.9 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”)	基金管理人、基金销售机构
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%。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	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%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.4.2 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未投资本基金。

7.4.10.5 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	
	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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期期内无利润分配事项。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	-

7.4.12.2 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
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	重大事项停牌	3.37	2018 年 1	3.71	29,250	127,784.90	-	-

		10 日			月 12 日					
600165	新日恒力	2017 年 12 月 27 日	重大事件停牌	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	重大事件停牌	5.93	-	-	20,620	158,633.06	-	-
600227	赤天化	2017 年 10 月 27 日	重大事件停牌	7.09	2018 年 2 月 1 日	6.38	12,200	72,598.25	-	-
600239	云南城投	2017 年 6 月 26 日	重大事件停牌	5.22	2018 年 1 月 17 日	5.74	21,000	98,566.79	-	-
600273	嘉化能源	2017 年 10 月 26 日	重大事件停牌	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	重大事件停牌	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	重大事件停牌	13.03	2018 年 1 月 10 日	13.03	4,800	85,276.12	-	-
600734	实达集团	2017 年 12 月	重大事件停牌	9.40	-	-	5,000	48,035.00	-	-

		20 日								
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 15 日	重大事 项停牌	9.45	-	-	4,760	68,826.08	-	-
002592	八菱科技	2017 年 11 月 20 日	重大事 项停牌	22.29	-	-	1,900	69,437.74	-	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事 项停牌	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 项停牌	24.14	-	-	2,400	42,985.59	-	-
000029	深深房 A	2016 年 9 月 14 日	重大事 项停牌	11.17	-	-	6,200	81,266.58	-	-
000034	神州数	2017 年	重大事	21.60	-	-	5,800	154,012.06	-	-

	码	9 月 29 日	项停牌							
000035	中国天楹	2017 年 8 月 22 日	重大事 项停牌	6.72	-	-	12,400	103,669.00	-	-
000615	京汉股份	2017 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	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 项停牌	10.95	2018 年 2 月 7 日	9.86	6,200	71,796.38	-	-
000757	浩物股份	2017 年 10 月 24 日	重大事 项停牌	7.03	-	-	5,500	66,268.36	-	-
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 年 3 月 14 日	9.19	5,290	57,452.31	-	-
002130	沃尔核材	2017 年 12 月	重大事 项停牌	5.76	2018 年 1	6.15	14,200	140,926.19	-	-

		25 日			月 10 日					
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 化	2017 年 10 月 24 日	重大事 项停牌	7.79	2018 年 2 月 12 日	7.01	8,000	89,842.28	-	-
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	重大事 项停牌	9.10	-	-	6,300	72,013.43	-	-

		日								
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 20 日	重大事 项停牌	28.07	2018 年 1 月 4 日	30.88	4,100	190,672.42	-	-
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	重大事 项停牌	7.80	-	-	5,800	70,374.25	-	-

		30 日								
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	-	-
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	14.36	4,600	159,675.54	-	-

					日					
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	2017 年	重大事	47.30	2018	42.57	800	55,821.33	-	-

	技	10 月 20 日	项停牌		年 2 月 6 日					
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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数型的分级证券投资基金，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。本基金投资的金融工具主
要包括股票、债券等。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“风险和收益相匹
配”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、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。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并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。风险管理部在督察长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。

7.4.13.2 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约责任，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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。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，因此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，通过对投资品种的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 2017 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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。

于 2017 年 12 月 31 日，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 本报告期内基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	4,357,559.83	-	-	-	4,357,559.83
结算备付金	659.67	-	-	-	659.67
存出保证金	3,423.38	-	-	-	3,423.38
交易性金融资产	-	-	-	67,809,162.38	67,809,162.38
应收利息	-	-	-	997.97	997.97
应收申购款	1,448.81	-	-	89,257.05	90,705.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,363,091.69	-	-	67,899,417.40	72,262,509.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1.20	1.20
应付赎回款	-	-	-	24,210.13	24,210.13
应付管理人报酬	-	-	-	62,259.51	62,259.51

应付托管费	-	-	-	13,697.09	13,697.09
应付交易费用	-	-	-	88,468.04	88,468.04
其他负债	-	-	-	150,011.50	150,011.50
负债总计	-	-	-	338,647.47	338,647.47
利率敏感度缺口	4,363,091.69	-	-	-67,560,769.93	71,923,861.62
上年度末 2016 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	6,424,942.83	-	-	-	6,424,942.83
结算备付金	2,637.42	-	-	-	2,637.42
存出保证金	16,128.15	-	-	-	16,128.15
交易性金融资产	-	-	-	-99,470,723.98	99,470,723.98
应收证券清算款	-	-	-	30,915.98	30,915.98
应收利息	-	-	-	1,415.86	1,415.86
应收申购款	1,148.81	-	-	5,838.34	6,987.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,444,857.21	-	-	-99,508,894.16	105,953,751.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	279,606.56	279,606.56
应付赎回款	-	-	-	38,276.78	38,276.78
应付管理人报酬	-	-	-	91,342.86	91,342.86
应付托管费	-	-	-	20,095.45	20,095.45
应付销售服务费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	207,679.76	207,679.76
其他负债	-	-	-	290,120.62	290,120.62
负债总计	-	-	-	977,122.03	977,122.03
利率敏感度缺口	6,444,857.21	-	-	-98,531,772.13	104,976,629.34

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 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(2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 1000 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 1000 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	67,809,162.38	94.28	99,470,723.98	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	67,809,162.38	94.28	99,470,723.98	94.76

7.4.13.4.3.2 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（ 2017 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2016 年 12 月 31 日 ）
	1. 业绩比较基准上升 5%	3, 580, 772. 96	5, 151, 891. 32
	2. 业绩比较基准下降 5%	-3, 580, 772. 96	-5, 151, 891. 32

7.4.14 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 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所有股票投资明细

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	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
11	002383	合众思壮	9,400	188,282.00	0.26
12	002600	江粉磁材	22,400	187,488.00	0.26
13	000933	神火股份	18,000	182,700.00	0.25
14	600745	闻泰科技	5,400	182,142.00	0.25
15	600175	美都能源	34,000	177,820.00	0.25
16	300203	聚光科技	5,000	177,750.00	0.25
17	600490	鹏欣资源	20,900	177,232.00	0.25
18	300009	安科生物	6,809	176,557.37	0.25
19	600110	诺德股份	18,200	171,808.00	0.24
20	000820	神雾节能	5,900	170,864.00	0.24
21	601222	林洋能源	16,708	169,419.12	0.24
22	000717	韶钢松山	19,100	169,226.00	0.24
23	300090	盛运环保	18,000	166,320.00	0.23
24	300347	泰格医药	4,700	165,346.00	0.23
25	000591	太阳能	28,560	164,791.20	0.23
26	300316	晶盛机电	7,800	163,098.00	0.23

27	002497	雅化集团	12,200	162,626.00	0.23
28	000917	电广传媒	17,900	162,174.00	0.23
29	002622	融钰集团	11,500	161,690.00	0.22
30	600711	盛屯矿业	18,900	160,461.00	0.22
31	600320	振华重工	26,300	160,430.00	0.22
32	300450	先导智能	2,800	159,516.00	0.22
33	300168	万达信息	11,400	153,672.00	0.21
34	300285	国瓷材料	7,600	152,000.00	0.21
35	600856	中天能源	13,000	151,970.00	0.21
36	002343	慈文传媒	4,250	151,342.50	0.21
37	600622	光大嘉宝	8,410	151,127.70	0.21
38	300418	昆仑万维	7,300	150,161.00	0.21
39	002138	顺络电子	9,000	149,220.00	0.21
40	000735	罗牛山	18,200	146,874.00	0.20
41	600568	中珠医疗	18,900	146,853.00	0.20
42	601588	北辰实业	25,300	146,487.00	0.20
43	000059	华锦股份	15,200	144,856.00	0.20
44	600486	扬农化工	2,900	144,101.00	0.20
45	002102	冠福股份	33,300	143,190.00	0.20
46	002389	南洋科技	6,700	141,571.00	0.20
47	300618	寒锐钴业	600	141,462.00	0.20
48	002597	金禾实业	5,400	139,968.00	0.19
49	600477	杭萧钢构	13,083	139,595.61	0.19
50	000800	一汽轿车	12,900	138,804.00	0.19
51	600771	广誉远	3,400	138,652.00	0.19
52	600797	浙大网新	11,700	138,294.00	0.19
53	600172	黄河旋风	15,760	138,215.20	0.19
54	002108	沧州明珠	12,040	136,774.40	0.19

55	300145	中金环境	11,400	136,230.00	0.19
56	002262	恩华药业	9,536	135,983.36	0.19
57	000831	五矿稀土	10,900	134,942.00	0.19
58	002610	爱康科技	56,800	134,616.00	0.19
59	300014	亿纬锂能	6,781	132,975.41	0.18
60	600782	新钢股份	20,200	132,916.00	0.18
61	601636	旗滨集团	21,200	132,288.00	0.18
62	002341	新纶科技	4,800	132,000.00	0.18
63	300038	梅泰诺	2,700	131,220.00	0.18
64	603885	吉祥航空	8,580	131,188.20	0.18
65	002210	飞马国际	10,480	129,742.40	0.18
66	300170	汉得信息	10,900	129,710.00	0.18
67	600559	老白干酒	4,172	129,206.84	0.18
68	600675	中华企业	20,700	128,340.00	0.18
69	600728	佳都科技	15,380	126,885.00	0.18
70	002313	日海通讯	3,900	126,360.00	0.18
71	000034	神州数码	5,800	125,280.00	0.17
72	300271	华宇软件	8,380	124,694.40	0.17
73	300496	中科创达	3,827	123,688.64	0.17
74	601058	赛轮金宇	34,240	123,606.40	0.17
75	300180	华峰超纤	5,000	122,900.00	0.17
76	600226	瀚叶股份	20,620	122,276.60	0.17
77	000516	国际医学	24,900	121,761.00	0.17
78	002427	尤夫股份	3,800	121,600.00	0.17
79	300054	鼎龙股份	10,640	121,402.40	0.17
80	600634	富控互动	6,900	121,026.00	0.17
81	002145	中核钛白	20,100	120,399.00	0.17
82	600868	梅雁吉祥	30,000	120,300.00	0.17

83	300207	欣旺达	12,300	120,048.00	0.17
84	600446	金证股份	7,900	119,606.00	0.17
85	600777	新潮能源	32,300	119,510.00	0.17
86	002501	利源精制	11,500	119,255.00	0.17
87	600667	太极实业	13,300	119,168.00	0.17
88	600230	沧州大化	2,800	119,000.00	0.17
89	601666	平煤股份	18,700	117,810.00	0.16
90	600803	新奥股份	7,800	117,156.00	0.16
91	600693	东百集团	11,400	116,964.00	0.16
92	600331	宏达股份	22,500	116,775.00	0.16
93	600323	瀚蓝环境	7,300	116,435.00	0.16
94	600330	天通股份	10,500	116,025.00	0.16
95	300098	高新兴	8,720	115,976.00	0.16
96	000980	众泰汽车	9,700	115,818.00	0.16
97	002668	奥马电器	6,020	115,463.60	0.16
98	002625	光启技术	4,100	115,087.00	0.16
99	603111	康尼机电	8,500	114,750.00	0.16
100	002647	民盛金科	3,520	114,540.80	0.16
101	000818	方大化工	8,800	114,224.00	0.16
102	000036	华联控股	12,600	113,904.00	0.16
103	300137	先河环保	5,400	113,022.00	0.16
104	600326	西藏天路	11,000	112,860.00	0.16
105	601011	宝泰隆	12,700	112,776.00	0.16
106	000537	广宇发展	8,800	112,376.00	0.16
107	600512	腾达建设	25,300	112,332.00	0.16
108	002245	澳洋顺昌	10,900	111,725.00	0.16
109	300102	乾照光电	11,100	111,666.00	0.16
110	000518	四环生物	16,300	111,492.00	0.16

111	600206	有研新材	9,300	111,414.00	0.15
112	300459	金科文化	10,000	111,300.00	0.15
113	600185	格力地产	19,580	111,214.40	0.15
114	300068	南都电源	6,900	110,952.00	0.15
115	002436	兴森科技	18,800	110,732.00	0.15
116	002421	达实智能	18,300	110,715.00	0.15
117	002178	延华智能	7,900	109,731.00	0.15
118	600239	云南城投	21,000	109,620.00	0.15
119	300128	锦富技术	10,645	109,430.60	0.15
120	300323	华灿光电	6,700	109,210.00	0.15
121	601799	星宇股份	2,200	108,900.00	0.15
122	002212	南洋股份	5,400	108,108.00	0.15
123	300110	华仁药业	7,800	107,874.00	0.15
124	300073	当升科技	4,100	107,789.00	0.15
125	600067	冠城大通	16,500	107,580.00	0.15
126	000016	深康佳 A	17,700	107,262.00	0.15
127	000150	宜华健康	3,500	107,030.00	0.15
128	300237	美晨科技	6,400	106,688.00	0.15
129	600255	梦舟股份	28,000	106,680.00	0.15
130	600507	方大特钢	8,400	106,596.00	0.15
131	300208	恒顺众昇	8,450	106,470.00	0.15
132	002596	海南瑞泽	9,300	105,648.00	0.15
133	002721	金一文化	6,600	105,600.00	0.15
134	300463	迈克生物	4,400	105,468.00	0.15
135	002067	景兴纸业	17,900	105,431.00	0.15
136	600165	新日恒力	6,550	105,193.00	0.15
137	002302	西部建设	6,000	105,120.00	0.15
138	603939	益丰药房	2,300	104,604.00	0.15

139	002449	国星光电	6,000	103,920.00	0.14
140	002664	信质电机	3,800	103,360.00	0.14
141	300083	劲胜智能	13,600	103,224.00	0.14
142	002429	兆驰股份	28,700	102,746.00	0.14
143	002151	北斗星通	3,200	102,464.00	0.14
144	002139	拓邦股份	8,650	102,329.50	0.14
145	000989	九芝堂	5,505	102,282.90	0.14
146	002445	中南文化	7,900	102,147.00	0.14
147	002716	金贵银业	5,400	101,898.00	0.14
148	300367	东方网力	6,750	101,790.00	0.14
149	000546	金圆股份	5,700	101,745.00	0.14
150	002156	通富微电	7,670	101,397.40	0.14
151	002630	华西能源	9,300	101,370.00	0.14
152	000910	大亚圣象	4,400	100,760.00	0.14
153	000902	新洋丰	10,300	100,734.00	0.14
154	002036	联创电子	6,200	100,626.00	0.14
155	002043	兔宝宝	8,200	100,532.00	0.14
156	000584	哈工智能	6,800	100,164.00	0.14
157	002080	中材科技	3,800	100,130.00	0.14
158	600273	嘉化能源	10,500	100,065.00	0.14
159	002581	未名医药	5,200	99,684.00	0.14
160	002222	福晶科技	5,450	99,353.50	0.14
161	600807	天业股份	9,900	99,099.00	0.14
162	600123	兰花科创	10,800	99,036.00	0.14
163	300053	欧比特	6,945	99,035.70	0.14
164	002023	海特高新	9,600	98,976.00	0.14
165	000921	海信科龙	7,100	98,832.00	0.14
166	603678	火炬电子	3,550	98,583.50	0.14

167	600162	香江控股	29,250	98,572.50	0.14
168	000048	康达尔	4,900	98,294.00	0.14
169	600116	三峡水利	11,000	97,900.00	0.14
170	601388	怡球资源	22,480	97,338.40	0.14
171	300310	宜通世纪	8,388	97,216.92	0.14
172	300020	银江股份	8,300	97,110.00	0.14
173	600763	通策医疗	3,000	96,960.00	0.13
174	002511	中顺洁柔	5,950	96,866.00	0.13
175	002402	和而泰	10,550	96,849.00	0.13
176	600076	康欣新材	13,100	96,678.00	0.13
177	002192	融捷股份	2,900	96,077.00	0.13
178	002047	宝鹰股份	12,700	95,885.00	0.13
179	300413	快乐购	3,200	95,520.00	0.13
180	601918	新集能源	24,600	95,448.00	0.13
181	002617	露笑科技	5,833	95,427.88	0.13
182	600057	象屿股份	11,750	95,057.50	0.13
183	600084	中葡股份	12,600	94,752.00	0.13
184	600269	赣粤高速	18,500	94,720.00	0.13
185	600491	龙元建设	10,000	94,500.00	0.13
186	300294	博雅生物	3,150	94,342.50	0.13
187	000088	盐田港	12,300	94,341.00	0.13
188	300185	通裕重工	41,400	93,978.00	0.13
189	300188	美亚柏科	4,700	93,906.00	0.13
190	300012	华测检测	21,000	93,660.00	0.13
191	600502	安徽水利	13,580	93,566.20	0.13
192	300628	亿联网络	700	93,310.00	0.13
193	600708	光明地产	13,590	93,091.50	0.13
194	603588	高能环境	7,300	92,856.00	0.13

195	002812	创新股份	900	92,610.00	0.13
196	002025	航天电器	4,100	92,537.00	0.13
197	002643	万润股份	8,600	91,934.00	0.13
198	300079	数码科技	21,800	91,778.00	0.13
199	600620	天宸股份	8,650	91,430.50	0.13
200	600210	紫江企业	19,200	91,392.00	0.13
201	002531	天顺风能	11,280	91,368.00	0.13
202	002237	恒邦股份	8,600	91,332.00	0.13
203	000751	锌业股份	17,800	91,314.00	0.13
204	000683	远兴能源	31,340	91,199.40	0.13
205	300222	科大智能	4,620	91,152.60	0.13
206	000901	航天科技	3,900	91,104.00	0.13
207	300409	道氏技术	2,000	90,920.00	0.13
208	600756	浪潮软件	5,100	90,729.00	0.13
209	300431	暴风集团	4,160	90,688.00	0.13
210	600638	新黄浦	6,200	90,582.00	0.13
211	300149	量子高科	5,900	90,565.00	0.13
212	300373	扬杰科技	3,000	89,910.00	0.13
213	002055	得润电子	4,400	89,892.00	0.12
214	600562	国睿科技	3,740	89,797.40	0.12
215	600322	天房发展	14,000	89,740.00	0.12
216	000915	山大华特	2,970	89,515.80	0.12
217	002091	江苏国泰	9,960	89,341.20	0.12
218	600130	波导股份	12,200	89,304.00	0.12
219	002680	长生生物	6,200	89,156.00	0.12
220	600742	一汽富维	5,400	89,154.00	0.12
221	600420	现代制药	7,000	89,040.00	0.12
222	300077	国民技术	8,900	89,000.00	0.12

223	600495	晋西车轴	13,380	88,709.40	0.12
224	300308	中际旭创	1,500	87,750.00	0.12
225	300118	东方日升	7,200	87,336.00	0.12
226	002126	银轮股份	8,900	87,220.00	0.12
227	600990	四创电子	1,500	87,135.00	0.12
228	002413	雷科防务	8,700	87,000.00	0.12
229	600988	赤峰黄金	13,500	86,940.00	0.12
230	000797	中国武夷	7,900	86,742.00	0.12
231	300377	赢时胜	7,000	86,520.00	0.12
232	600337	美克家居	14,300	86,515.00	0.12
233	600227	赤天化	12,200	86,498.00	0.12
234	000601	韶能股份	12,000	86,400.00	0.12
235	002372	伟星新材	4,796	86,232.08	0.12
236	600641	万业企业	6,400	85,760.00	0.12
237	002042	华孚时尚	6,400	85,696.00	0.12
238	600668	尖峰集团	5,400	85,536.00	0.12
239	002089	新海宜	15,200	85,424.00	0.12
240	002614	奥佳华	4,400	85,140.00	0.12
241	300317	珈伟股份	5,425	84,955.50	0.12
242	002157	正邦科技	14,800	84,804.00	0.12
243	002095	生意宝	2,400	83,664.00	0.12
244	002447	壹桥股份	15,850	83,529.50	0.12
245	002584	西陇科学	4,600	83,352.00	0.12
246	002462	嘉事堂	3,200	83,328.00	0.12
247	000035	中国天楹	12,400	83,328.00	0.12
248	000996	中国中期	5,450	83,221.50	0.12
249	300101	振芯科技	6,200	83,204.00	0.12
250	002697	红旗连锁	13,040	83,195.20	0.12

251	002649	博彦科技	6,700	83,147.00	0.12
252	600740	山西焦化	8,500	83,130.00	0.12
253	002451	摩恩电气	2,800	83,076.00	0.12
254	600621	华鑫股份	6,700	82,946.00	0.12
255	000673	当代东方	6,300	82,908.00	0.12
256	002618	丹邦科技	6,050	82,885.00	0.12
257	600400	红豆股份	11,500	82,685.00	0.11
258	000869	张裕 A	2,200	82,500.00	0.11
259	000976	华铁股份	10,100	82,416.00	0.11
260	600612	老凤祥	2,000	82,320.00	0.11
261	300078	思创医惠	7,624	82,262.96	0.11
262	300278	华昌达	4,800	82,176.00	0.11
263	002167	东方锆业	7,900	82,160.00	0.11
264	300157	恒泰艾普	9,000	82,080.00	0.11
265	600197	伊力特	3,500	81,970.00	0.11
266	002130	沃尔核材	14,200	81,792.00	0.11
267	000533	万家乐	7,700	81,620.00	0.11
268	600577	精达股份	21,700	81,592.00	0.11
269	300476	胜宏科技	3,400	81,430.00	0.11
270	603008	喜临门	4,400	81,356.00	0.11
271	300309	吉艾科技	3,800	81,206.00	0.11
272	300238	冠昊生物	3,400	81,090.00	0.11
273	300482	万孚生物	1,100	80,784.00	0.11
274	600399	抚顺特钢	14,400	80,640.00	0.11
275	002418	康盛股份	9,000	80,370.00	0.11
276	600456	宝钛股份	3,400	80,274.00	0.11
277	600604	市北高新	11,100	79,920.00	0.11
278	300064	豫金刚石	5,700	79,800.00	0.11

279	000918	嘉凯城	11,400	79,800.00	0.11
280	002121	科陆电子	8,900	79,655.00	0.11
281	000836	鑫茂科技	19,100	79,647.00	0.11
282	000882	华联股份	26,000	79,300.00	0.11
283	600132	重庆啤酒	3,800	79,268.00	0.11
284	600290	华仪电气	6,000	79,260.00	0.11
285	600303	曙光股份	8,600	79,206.00	0.11
286	600033	福建高速	21,700	79,205.00	0.11
287	300616	尚品宅配	500	79,010.00	0.11
288	600343	航天动力	6,100	78,873.00	0.11
289	002104	恒宝股份	8,976	78,719.52	0.11
290	002198	嘉应制药	6,400	78,656.00	0.11
291	300212	易华录	2,900	78,590.00	0.11
292	002419	天虹股份	5,100	77,826.00	0.11
293	002376	新北洋	7,000	77,770.00	0.11
294	002117	东港股份	4,000	77,760.00	0.11
295	000733	振华科技	5,200	77,480.00	0.11
296	600318	新力金融	6,100	77,470.00	0.11
297	002086	东方海洋	6,500	77,350.00	0.11
298	002467	二六三	10,100	77,265.00	0.11
299	000968	蓝焰控股	4,600	77,234.00	0.11
300	300036	超图软件	5,000	77,200.00	0.11
301	002537	海联金汇	7,880	77,145.20	0.11
302	002550	千红制药	14,200	77,106.00	0.11
303	002650	加加食品	10,900	76,954.00	0.11
304	000687	华讯方舟	7,300	76,723.00	0.11
305	600546	山煤国际	15,700	76,616.00	0.11
306	300288	朗玛信息	3,200	76,288.00	0.11

307	002564	天沃科技	9,300	76,260.00	0.11
308	600261	阳光照明	13,800	76,176.00	0.11
309	600846	同济科技	7,900	76,077.00	0.11
310	000506	中润资源	10,300	75,911.00	0.11
311	600072	中船科技	5,800	75,574.00	0.11
312	600550	保变电气	12,100	75,504.00	0.10
313	300096	易联众	6,800	75,480.00	0.10
314	002496	辉丰股份	14,320	75,466.40	0.10
315	002097	山河智能	10,000	75,300.00	0.10
316	002387	黑牛食品	4,500	75,285.00	0.10
317	002756	永兴特钢	2,800	75,180.00	0.10
318	300284	苏交科	4,600	75,164.00	0.10
319	300037	新宙邦	3,600	75,096.00	0.10
320	000731	四川美丰	9,400	75,012.00	0.10
321	000525	红太阳	3,700	74,629.00	0.10
322	000407	胜利股份	9,700	74,593.00	0.10
323	600133	东湖高新	8,000	74,320.00	0.10
324	000957	中通客车	6,600	74,316.00	0.10
325	002326	永太科技	6,500	74,230.00	0.10
326	600360	华微电子	9,300	74,214.00	0.10
327	000615	京汉股份	7,600	74,176.00	0.10
328	300458	全志科技	2,606	74,166.76	0.10
329	002099	海翔药业	12,800	73,984.00	0.10
330	600595	中孚实业	13,800	73,830.00	0.10
331	002443	金洲管道	8,200	73,800.00	0.10
332	300065	海兰信	4,050	73,791.00	0.10
333	002113	天润数娱	6,000	73,620.00	0.10
334	002586	围海股份	8,200	73,390.00	0.10

335	002247	帝龙文化	5,400	73,386.00	0.10
336	300216	千山药机	4,600	73,370.00	0.10
337	000828	东莞控股	6,600	73,326.00	0.10
338	000951	中国重汽	4,200	73,206.00	0.10
339	002321	华英农业	5,900	73,101.00	0.10
340	300364	中文在线	7,919	73,092.37	0.10
341	000973	佛塑科技	12,200	73,078.00	0.10
342	002626	金达威	3,900	73,008.00	0.10
343	600391	航发科技	3,700	72,927.00	0.10
344	002711	欧浦智网	6,768	72,823.68	0.10
345	002636	金安国纪	4,600	72,818.00	0.10
346	600217	中再资环	11,200	72,800.00	0.10
347	601700	风范股份	9,000	72,360.00	0.10
348	000739	普洛药业	11,200	72,352.00	0.10
349	002611	东方精工	5,500	72,215.00	0.10
350	600783	鲁信创投	4,700	72,145.00	0.10
351	600075	新疆天业	9,280	72,105.60	0.10
352	300044	赛为智能	4,800	72,048.00	0.10
353	002433	太安堂	8,500	71,910.00	0.10
354	601003	柳钢股份	9,000	71,820.00	0.10
355	600090	同济堂	9,100	71,799.00	0.10
356	002484	江海股份	7,716	71,758.80	0.10
357	002604	龙力生物	8,200	71,668.00	0.10
358	002283	天润曲轴	12,500	71,500.00	0.10
359	600552	凯盛科技	9,700	71,489.00	0.10
360	000576	广东甘化	4,200	71,484.00	0.10
361	000650	仁和药业	13,700	71,377.00	0.10
362	600963	岳阳林纸	11,100	71,373.00	0.10

363	002510	天汽模	11,300	71,303.00	0.10
364	002141	贤丰控股	9,000	71,190.00	0.10
365	600569	安阳钢铁	15,100	70,970.00	0.10
366	002547	春兴精工	8,900	70,933.00	0.10
367	002538	司尔特	8,000	70,880.00	0.10
368	002197	证通电子	5,700	70,737.00	0.10
369	300495	美尚生态	4,783	70,692.74	0.10
370	601952	苏垦农发	5,000	70,650.00	0.10
371	002562	兄弟科技	4,300	70,348.00	0.10
372	600363	联创光电	5,600	70,336.00	0.10
373	300474	景嘉微	1,300	70,096.00	0.10
374	000851	高鸿股份	8,200	70,028.00	0.10
375	600658	电子城	6,300	69,930.00	0.10
376	603368	柳州医药	1,460	69,890.20	0.10
377	600285	羚锐制药	7,500	69,750.00	0.10
378	000571	新大洲 A	12,900	69,660.00	0.10
379	600764	中电广通	2,500	69,525.00	0.10
380	002448	中原内配	7,700	69,300.00	0.10
381	000029	深深房 A	6,200	69,254.00	0.10
382	300183	东软载波	3,600	69,192.00	0.10
383	000018	神州长城	11,300	69,156.00	0.10
384	002009	天奇股份	4,100	69,126.00	0.10
385	600020	中原高速	14,200	69,012.00	0.10
386	002206	海利得	11,600	68,788.00	0.10
387	002303	美盈森	9,800	68,600.00	0.10
388	000603	盛达矿业	5,700	68,514.00	0.10
389	600063	皖维高新	18,300	68,442.00	0.10
390	601890	亚星锚链	10,600	68,370.00	0.10

391	000042	中洲控股	4,200	68,166.00	0.09
392	002717	岭南园林	2,600	67,990.00	0.09
393	300152	科融环境	10,100	67,973.00	0.09
394	000688	建新矿业	6,200	67,890.00	0.09
395	600987	航民股份	6,000	67,680.00	0.09
396	000802	北京文化	4,600	67,574.00	0.09
397	600590	泰豪科技	6,300	67,410.00	0.09
398	002335	科华恒盛	2,200	67,342.00	0.09
399	000429	粤高速 A	8,300	67,313.00	0.09
400	002263	大东南	24,100	67,239.00	0.09
401	002175	东方网络	8,300	67,230.00	0.09
402	600129	太极集团	4,100	67,035.00	0.09
403	300226	上海钢联	1,786	66,975.00	0.09
404	600480	凌云股份	4,300	66,693.00	0.09
405	600681	百川能源	4,900	66,395.00	0.09
406	000875	吉电股份	17,000	66,130.00	0.09
407	002364	中恒电气	6,200	66,092.00	0.09
408	002675	东诚药业	5,600	66,024.00	0.09
409	002318	久立特材	9,300	65,937.00	0.09
410	601599	鹿港文化	9,900	65,934.00	0.09
411	300148	天舟文化	8,000	65,760.00	0.09
412	600986	科达股份	6,000	65,760.00	0.09
413	300467	迅游科技	1,400	65,730.00	0.09
414	002031	巨轮智能	24,400	65,636.00	0.09
415	300457	赢合科技	2,450	65,611.00	0.09
416	603128	华贸物流	8,000	65,520.00	0.09
417	300438	鹏辉能源	2,200	65,406.00	0.09
418	000881	中广核技	5,000	65,350.00	0.09

419	300097	智云股份	2,300	65,320.00	0.09
420	300198	纳川股份	9,780	65,232.60	0.09
421	002367	康力电梯	7,600	65,208.00	0.09
422	300178	腾邦国际	4,900	65,170.00	0.09
423	603308	应流股份	4,100	65,149.00	0.09
424	000055	方大集团	10,750	65,145.00	0.09
425	002094	青岛金王	3,700	65,083.00	0.09
426	300109	新开源	1,400	65,044.00	0.09
427	000553	沙隆达 A	4,100	64,985.00	0.09
428	002148	北纬科技	7,160	64,941.20	0.09
429	600114	东睦股份	4,100	64,903.00	0.09
430	300075	数字政通	4,000	64,720.00	0.09
431	000928	中钢国际	9,920	64,579.20	0.09
432	002079	苏州固锟	6,900	64,377.00	0.09
433	600677	航天通信	5,800	64,322.00	0.09
434	600459	贵研铂业	2,900	64,322.00	0.09
435	000520	长航凤凰	16,000	64,320.00	0.09
436	002430	杭氧股份	4,600	64,262.00	0.09
437	300352	北信源	16,075	63,978.50	0.09
438	002515	金字火腿	7,720	63,844.40	0.09
439	300529	健帆生物	2,000	63,760.00	0.09
440	600812	华北制药	12,900	63,726.00	0.09
441	300224	正海磁材	6,650	63,574.00	0.09
442	300219	鸿利智汇	5,650	63,449.50	0.09
443	002215	诺普信	8,700	63,423.00	0.09
444	002488	金固股份	5,300	63,388.00	0.09
445	002224	三力士	7,300	63,364.00	0.09
446	002522	浙江众成	7,200	63,360.00	0.09

447	002305	南国置业	13,700	63,294.00	0.09
448	000967	盈峰环境	6,892	63,268.56	0.09
449	002203	海亮股份	8,100	63,180.00	0.09
450	002464	众应互联	2,240	63,168.00	0.09
451	300008	天海防务	9,150	63,135.00	0.09
452	002542	中化岩土	8,550	63,013.50	0.09
453	300228	富瑞特装	5,980	62,969.40	0.09
454	603338	浙江鼎力	800	62,912.00	0.09
455	002284	亚太股份	7,000	62,860.00	0.09
456	600707	彩虹股份	8,500	62,815.00	0.09
457	002684	猛狮科技	3,600	62,784.00	0.09
458	600686	金龙汽车	4,800	62,544.00	0.09
459	300269	联建光电	4,900	62,426.00	0.09
460	002453	天马精化	8,000	62,320.00	0.09
461	002609	捷顺科技	4,200	62,244.00	0.09
462	000672	上峰水泥	6,400	62,208.00	0.09
463	600758	红阳能源	8,400	61,992.00	0.09
464	300045	华力创通	5,500	61,875.00	0.09
465	002446	盛路通信	6,020	61,825.40	0.09
466	300292	吴通控股	10,900	61,803.00	0.09
467	002518	科士达	3,775	61,796.75	0.09
468	002100	天康生物	7,600	61,712.00	0.09
469	600997	开滦股份	10,000	61,600.00	0.09
470	601101	昊华能源	7,600	61,560.00	0.09
471	300221	银禧科技	4,000	61,560.00	0.09
472	002218	拓日新能	11,700	61,425.00	0.09
473	300236	上海新阳	1,800	61,362.00	0.09
474	600231	凌钢股份	12,000	61,200.00	0.09

475	300085	银之杰	4,500	61,200.00	0.09
476	000789	万年青	5,800	60,958.00	0.08
477	300304	云意电气	8,300	60,839.00	0.08
478	002585	双星新材	9,190	60,745.90	0.08
479	600626	申达股份	7,900	60,672.00	0.08
480	300300	汉鼎宇佑	3,600	60,660.00	0.08
481	000958	东方能源	12,200	60,634.00	0.08
482	600012	皖通高速	5,500	60,500.00	0.08
483	000971	高升控股	3,600	60,444.00	0.08
484	601126	四方股份	7,700	60,291.00	0.08
485	002239	奥特佳	14,900	60,196.00	0.08
486	600096	云天化	8,400	60,144.00	0.08
487	600105	永鼎股份	9,200	59,984.00	0.08
488	002307	北新路桥	5,300	59,943.00	0.08
489	300339	润和软件	5,700	59,736.00	0.08
490	002229	鸿博股份	6,350	59,690.00	0.08
491	000544	中原环保	4,100	59,491.00	0.08
492	300343	联创互联	4,630	59,310.30	0.08
493	002502	骅威文化	6,800	59,228.00	0.08
494	000065	北方国际	3,250	59,150.00	0.08
495	002747	埃斯顿	5,300	58,936.00	0.08
496	600789	鲁抗医药	7,400	58,830.00	0.08
497	002362	汉王科技	2,400	58,776.00	0.08
498	000711	京蓝科技	4,600	58,742.00	0.08
499	600054	黄山旅游	4,100	58,507.00	0.08
500	600684	珠江实业	9,460	58,462.80	0.08
501	002253	川大智胜	2,850	58,339.50	0.08
502	300131	英唐智控	8,500	58,310.00	0.08

503	300336	新文化	5,100	58,242.00	0.08
504	300369	绿盟科技	6,400	58,240.00	0.08
505	600602	云赛智联	8,500	58,140.00	0.08
506	600107	美尔雅	4,600	58,098.00	0.08
507	002474	榕基软件	6,900	58,098.00	0.08
508	002733	雄韬股份	3,350	58,055.50	0.08
509	600405	动力源	8,900	58,028.00	0.08
510	000022	深赤湾 A	2,400	57,936.00	0.08
511	600209	罗顿发展	5,600	57,792.00	0.08
512	300086	康芝药业	5,350	57,780.00	0.08
513	000752	西藏发展	4,200	57,708.00	0.08
514	002521	齐峰新材	6,300	57,519.00	0.08
515	600652	游久游戏	7,900	57,512.00	0.08
516	002279	久其软件	5,580	57,474.00	0.08
517	600798	宁波海运	11,400	57,456.00	0.08
518	300074	华平股份	6,900	57,408.00	0.08
519	000952	广济药业	4,000	57,400.00	0.08
520	000767	漳泽电力	19,500	57,330.00	0.08
521	002575	群兴玩具	6,300	57,330.00	0.08
522	600035	楚天高速	11,000	57,310.00	0.08
523	000925	众合科技	3,700	57,276.00	0.08
524	002331	皖通科技	5,580	57,250.80	0.08
525	002182	云海金属	6,100	57,218.00	0.08
526	300232	洲明科技	4,000	57,200.00	0.08
527	300388	国祯环保	2,400	57,096.00	0.08
528	600093	易见股份	5,300	56,816.00	0.08
529	600321	正源股份	14,300	56,771.00	0.08
530	300223	北京君正	1,600	56,704.00	0.08

531	603003	龙宇燃油	4,900	56,595.00	0.08
532	600824	益民集团	11,700	56,511.00	0.08
533	300527	华舟应急	2,335	56,460.30	0.08
534	002648	卫星石化	3,400	56,440.00	0.08
535	300031	宝通科技	3,800	56,430.00	0.08
536	300256	星星科技	6,200	56,358.00	0.08
537	002619	艾格拉斯	8,780	56,192.00	0.08
538	002554	惠博普	11,900	56,168.00	0.08
539	603718	海利生物	5,085	56,138.40	0.08
540	000821	京山轻机	4,500	56,070.00	0.08
541	600965	福成股份	5,200	56,004.00	0.08
542	000582	北部湾港	5,900	55,991.00	0.08
543	600662	强生控股	10,000	55,800.00	0.08
544	000795	英洛华	9,000	55,800.00	0.08
545	600508	上海能源	4,600	55,798.00	0.08
546	600531	豫光金铅	8,600	55,728.00	0.08
547	002154	报喜鸟	16,000	55,680.00	0.08
548	000801	四川九洲	9,700	55,484.00	0.08
549	002737	葵花药业	1,800	55,476.00	0.08
550	300140	中环装备	3,200	55,392.00	0.08
551	002425	凯撒文化	7,680	55,372.80	0.08
552	600382	广东明珠	4,400	55,352.00	0.08
553	300679	电连技术	600	55,272.00	0.08
554	000545	金浦钛业	10,900	55,263.00	0.08
555	002638	勤上股份	12,050	55,189.00	0.08
556	002314	南山控股	8,900	55,180.00	0.08
557	002606	大连电瓷	4,500	55,170.00	0.08
558	000639	西王食品	2,900	55,100.00	0.08

559	300502	新易盛	1,900	55,081.00	0.08
560	600830	香溢融通	5,800	55,042.00	0.08
561	603612	索通发展	1,100	54,923.00	0.08
562	300011	鼎汉技术	5,300	54,908.00	0.08
563	600855	航天长峰	3,700	54,871.00	0.08
564	600007	中国国贸	3,200	54,848.00	0.08
565	002655	共达电声	5,700	54,720.00	0.08
566	002751	易尚展示	1,400	54,586.00	0.08
567	600136	当代明诚	3,900	54,561.00	0.08
568	603118	共进股份	6,200	54,374.00	0.08
569	300005	探路者	9,900	54,351.00	0.08
570	002695	煌上煌	3,200	54,336.00	0.08
571	300424	航新科技	2,316	54,263.88	0.08
572	600616	金枫酒业	5,698	54,244.96	0.08
573	002110	三钢闽光	2,800	54,152.00	0.08
574	300456	耐威科技	1,200	54,096.00	0.08
575	601116	三江购物	2,600	54,028.00	0.08
576	300353	东土科技	4,100	53,915.00	0.07
577	600106	重庆路桥	12,640	53,846.40	0.07
578	603989	艾华集团	1,400	53,788.00	0.07
579	000796	凯撒旅游	3,800	53,504.00	0.07
580	000560	昆百大 A	5,600	53,424.00	0.07
581	300506	名家汇	2,400	53,400.00	0.07
582	000550	江铃汽车	3,300	53,196.00	0.07
583	300322	硕贝德	4,500	53,190.00	0.07
584	600676	交运股份	8,100	53,136.00	0.07
585	000782	美达股份	6,700	52,796.00	0.07
586	002255	海陆重工	7,900	52,772.00	0.07

587	002204	大连重工	12,200	52,582.00	0.07
588	600103	青山纸业	14,000	52,500.00	0.07
589	600571	信雅达	4,900	52,381.00	0.07
590	300177	中海达	5,000	52,300.00	0.07
591	002320	海峡股份	2,400	52,056.00	0.07
592	000889	茂业通信	3,900	52,026.00	0.07
593	600526	菲达环保	5,200	51,896.00	0.07
594	002556	辉隆股份	6,800	51,884.00	0.07
595	603337	杰克股份	1,000	51,540.00	0.07
596	002677	浙江美大	3,040	51,528.00	0.07
597	002567	唐人神	6,650	51,471.00	0.07
598	000043	中航地产	5,300	51,463.00	0.07
599	002656	摩登大道	2,100	51,450.00	0.07
600	002355	兴民智通	4,900	51,352.00	0.07
601	002259	升达林业	8,300	51,294.00	0.07
602	002662	京威股份	7,100	51,262.00	0.07
603	002481	双塔食品	10,000	51,200.00	0.07
604	000676	智度股份	4,600	51,152.00	0.07
605	002458	益生股份	2,200	51,150.00	0.07
606	600449	宁夏建材	4,500	51,030.00	0.07
607	002071	长城影视	5,000	50,900.00	0.07
608	002246	北化股份	4,100	50,881.00	0.07
609	002166	莱茵生物	4,800	50,832.00	0.07
610	000838	财信发展	8,700	50,808.00	0.07
611	002060	粤水电	13,300	50,806.00	0.07
612	300392	腾信股份	3,400	50,762.00	0.07
613	600624	复旦复华	7,630	50,739.50	0.07
614	000558	莱茵体育	10,200	50,490.00	0.07

615	300263	隆华节能	7,000	50,260.00	0.07
616	300303	聚飞光电	13,840	50,239.20	0.07
617	002256	兆新股份	11,900	50,218.00	0.07
618	600838	上海九百	5,100	50,184.00	0.07
619	600730	中国高科	7,400	50,172.00	0.07
620	300130	新国都	2,100	50,106.00	0.07
621	600800	天津磁卡	7,700	50,050.00	0.07
622	002288	超华科技	8,800	49,984.00	0.07
623	002590	万安科技	3,800	49,932.00	0.07
624	603686	龙马环卫	1,900	49,875.00	0.07
625	300021	大禹节水	7,600	49,780.00	0.07
626	002792	通宇通讯	1,400	49,770.00	0.07
627	000657	中钨高新	4,000	49,680.00	0.07
628	000554	泰山石油	6,100	49,593.00	0.07
629	002516	旷达科技	9,500	49,590.00	0.07
630	300242	明家联合	6,000	49,500.00	0.07
631	600082	海泰发展	8,200	49,364.00	0.07
632	300426	唐德影视	2,500	49,325.00	0.07
633	000010	美丽生态	9,100	49,322.00	0.07
634	300016	北陆药业	3,600	49,284.00	0.07
635	300231	银信科技	4,300	49,235.00	0.07
636	300006	莱美药业	7,738	49,213.68	0.07
637	002171	楚江新材	6,800	49,096.00	0.07
638	300034	钢研高纳	3,979	49,061.07	0.07
639	600973	宝胜股份	9,679	48,975.74	0.07
640	603393	新天然气	1,300	48,906.00	0.07
641	600501	航天晨光	4,000	48,840.00	0.07
642	300050	世纪鼎利	6,200	48,794.00	0.07

643	300359	全通教育	5,050	48,783.00	0.07
644	603618	杭电股份	5,400	48,600.00	0.07
645	600258	首旅酒店	1,800	48,582.00	0.07
646	000666	经纬纺机	2,500	48,550.00	0.07
647	002658	雪迪龙	3,800	48,526.00	0.07
648	300245	天玑科技	3,500	48,510.00	0.07
649	600533	栖霞建设	10,000	48,500.00	0.07
650	000811	冰轮环境	6,150	48,462.00	0.07
651	600630	龙头股份	4,700	48,410.00	0.07
652	000404	华意压缩	7,675	48,275.75	0.07
653	000892	欢瑞世纪	6,200	48,236.00	0.07
654	600995	文山电力	5,300	48,230.00	0.07
655	600845	宝信软件	2,600	48,204.00	0.07
656	002033	丽江旅游	5,290	48,139.00	0.07
657	002543	万和电气	2,100	48,048.00	0.07
658	300262	巴安水务	5,300	48,018.00	0.07
659	300406	九强生物	3,200	48,000.00	0.07
660	002582	好想你	4,100	47,970.00	0.07
661	600288	大恒科技	5,500	47,960.00	0.07
662	600818	中路股份	2,100	47,943.00	0.07
663	002177	御银股份	9,600	47,904.00	0.07
664	600237	铜峰电子	8,900	47,882.00	0.07
665	000416	民生控股	6,700	47,704.00	0.07
666	300184	力源信息	4,200	47,628.00	0.07
667	601069	西部黄金	3,000	47,610.00	0.07
668	603979	金诚信	4,634	47,452.16	0.07
669	000498	山东路桥	7,100	47,428.00	0.07
670	603026	石大胜华	1,900	47,253.00	0.07

671	000936	华西股份	7,000	47,250.00	0.07
672	000837	秦川机床	7,700	47,124.00	0.07
673	600734	实达集团	5,000	47,000.00	0.07
674	603900	莱绅通灵	1,620	46,963.80	0.07
675	002322	理工环科	2,500	46,950.00	0.07
676	603843	正平股份	3,200	46,944.00	0.07
677	600190	锦州港	11,300	46,895.00	0.07
678	603126	中材节能	4,800	46,848.00	0.07
679	300255	常山药业	7,400	46,842.00	0.07
680	002135	东南网架	6,500	46,800.00	0.07
681	000573	粤宏远 A	9,900	46,728.00	0.06
682	002301	齐心集团	2,700	46,710.00	0.06
683	000070	特发信息	5,000	46,700.00	0.06
684	002766	索菱股份	3,300	46,695.00	0.06
685	000058	深赛格	6,300	46,620.00	0.06
686	002196	方正电机	4,980	46,612.80	0.06
687	300048	合康新能	12,200	46,604.00	0.06
688	600119	长江投资	3,400	46,512.00	0.06
689	300252	金信诺	2,800	46,508.00	0.06
690	002712	思美传媒	2,000	46,200.00	0.06
691	000927	一汽夏利	10,100	46,157.00	0.06
692	601137	博威合金	4,000	46,080.00	0.06
693	300332	天壕环境	7,000	46,060.00	0.06
694	000863	三湘印象	8,700	46,023.00	0.06
695	002226	江南化工	7,300	45,917.00	0.06
696	000965	天保基建	8,000	45,760.00	0.06
697	603881	数据港	1,000	45,710.00	0.06
698	000893	东凌国际	4,800	45,600.00	0.06

699	002339	积成电子	5,000	45,250.00	0.06
700	603708	家家悦	2,260	45,245.20	0.06
701	300071	华谊嘉信	5,800	45,240.00	0.06
702	300191	潜能恒信	2,000	45,220.00	0.06
703	300363	博腾股份	3,400	45,118.00	0.06
704	000701	厦门信达	4,500	45,090.00	0.06
705	300066	三川智慧	9,900	45,045.00	0.06
706	600650	锦江投资	3,100	45,043.00	0.06
707	000700	模塑科技	7,900	44,793.00	0.06
708	002378	章源钨业	4,400	44,792.00	0.06
709	603898	好莱客	1,500	44,790.00	0.06
710	300160	秀强股份	5,700	44,745.00	0.06
711	002850	科达利	700	44,737.00	0.06
712	002432	九安医疗	4,800	44,736.00	0.06
713	603108	润达医疗	3,640	44,590.00	0.06
714	600135	乐凯胶片	4,100	44,526.00	0.06
715	002115	三维通信	4,800	44,496.00	0.06
716	002631	德尔未来	4,100	44,403.00	0.06
717	000719	大地传媒	4,900	44,394.00	0.06
718	002406	远东传动	6,200	44,392.00	0.06
719	603010	万盛股份	1,600	44,336.00	0.06
720	300558	贝达药业	700	44,303.00	0.06
721	000905	厦门港务	4,200	44,268.00	0.06
722	603579	荣泰健康	700	44,093.00	0.06
723	300215	电科院	4,800	44,064.00	0.06
724	002393	力生制药	1,400	43,848.00	0.06
725	000760	斯太尔	7,500	43,800.00	0.06
726	300349	金卡智能	1,100	43,560.00	0.06

727	002457	青龙管业	3,700	43,401.00	0.06
728	002329	皇氏集团	6,640	43,292.80	0.06
729	002476	宝莫股份	7,700	43,274.00	0.06
730	600467	好当家	13,900	43,229.00	0.06
731	300485	赛升药业	1,500	43,200.00	0.06
732	300194	福安药业	7,500	43,125.00	0.06
733	002616	长青集团	4,700	43,099.00	0.06
734	601366	利群股份	4,100	43,091.00	0.06
735	002260	德奥通航	3,600	43,056.00	0.06
736	600592	龙溪股份	4,400	42,944.00	0.06
737	300229	拓尔思	3,000	42,930.00	0.06
738	002859	洁美科技	1,200	42,780.00	0.06
739	002559	亚威股份	4,700	42,676.00	0.06
740	600836	界龙实业	8,400	42,672.00	0.06
741	600744	华银电力	11,300	42,601.00	0.06
742	600354	敦煌种业	5,800	42,514.00	0.06
743	600381	青海春天	4,000	42,440.00	0.06
744	601107	四川成渝	10,300	42,436.00	0.06
745	300007	汉威科技	3,200	42,432.00	0.06
746	300432	富临精工	2,400	42,408.00	0.06
747	300520	科大国创	1,600	42,336.00	0.06
748	002499	科林环保	2,100	42,084.00	0.06
749	300209	天泽信息	2,300	42,044.00	0.06
750	601789	宁波建工	9,300	42,036.00	0.06
751	300410	正业科技	1,200	42,000.00	0.06
752	300047	天源迪科	3,800	41,990.00	0.06
753	300613	富瀚微	200	41,976.00	0.06
754	000011	深物业 A	2,500	41,975.00	0.06

755	300439	美康生物	2,200	41,954.00	0.06
756	603299	井神股份	4,400	41,932.00	0.06
757	002821	凯莱英	700	41,895.00	0.06
758	600775	南京熊猫	5,300	41,764.00	0.06
759	300307	慈星股份	5,100	41,667.00	0.06
760	600283	钱江水利	3,400	41,650.00	0.06
761	002867	周大生	1,500	41,625.00	0.06
762	300248	新开普	3,100	41,540.00	0.06
763	002016	世荣兆业	3,800	41,268.00	0.06
764	300386	飞天诚信	2,600	41,236.00	0.06
765	601015	陕西黑猫	3,950	41,198.50	0.06
766	300441	鲍斯股份	1,700	41,157.00	0.06
767	002539	云图控股	6,400	41,152.00	0.06
768	000561	烽火电子	4,800	40,992.00	0.06
769	002726	龙大肉食	3,580	40,883.60	0.06
770	002124	天邦股份	4,900	40,768.00	0.06
771	600814	杭州解百	4,500	40,500.00	0.06
772	002349	精华制药	5,300	40,439.00	0.06
773	002298	中电鑫龙	4,500	40,410.00	0.06
774	600548	深高速	4,500	40,410.00	0.06
775	000665	湖北广电	4,000	40,320.00	0.06
776	002053	云南能投	3,500	40,250.00	0.06
777	600173	卧龙地产	6,900	40,020.00	0.06
778	603626	科森科技	1,400	39,774.00	0.06
779	300366	创意信息	3,300	39,666.00	0.06
780	300429	强力新材	1,670	39,662.50	0.06
781	300172	中电环保	4,800	39,600.00	0.06
782	300465	高伟达	4,280	39,590.00	0.06

783	300299	富春股份	4,500	39,330.00	0.05
784	300311	任子行	2,801	39,214.00	0.05
785	300379	东方通	3,100	39,184.00	0.05
786	300295	三六五网	2,100	39,165.00	0.05
787	300171	东富龙	4,000	39,080.00	0.05
788	600692	亚通股份	3,900	39,000.00	0.05
789	000607	华媒控股	6,400	38,784.00	0.05
790	600246	万通地产	9,700	38,703.00	0.05
791	002772	众兴菌业	3,500	38,675.00	0.05
792	000757	浩物股份	5,500	38,665.00	0.05
793	600784	鲁银投资	7,200	38,664.00	0.05
794	300302	同有科技	3,340	38,543.60	0.05
795	300205	天喻信息	4,100	38,540.00	0.05
796	000920	南方汇通	4,000	38,520.00	0.05
797	600279	重庆港九	6,550	38,448.50	0.05
798	601566	九牧王	2,700	38,340.00	0.05
799	002534	杭锅股份	3,500	37,870.00	0.05
800	300135	宝利国际	10,200	37,842.00	0.05
801	300523	辰安科技	800	37,840.00	0.05
802	300328	宜安科技	3,880	37,713.60	0.05
803	000819	岳阳兴长	3,000	37,620.00	0.05
804	600470	六国化工	6,600	37,488.00	0.05
805	002231	奥维通信	3,400	37,400.00	0.05
806	603920	世运电路	1,900	37,354.00	0.05
807	601339	百隆东方	7,100	37,346.00	0.05
808	600523	贵航股份	2,300	37,283.00	0.05
809	600207	安彩高科	5,500	37,235.00	0.05
810	000885	同力水泥	2,400	37,152.00	0.05

811	002759	天际股份	2,100	37,149.00	0.05
812	600336	澳柯玛	7,400	37,148.00	0.05
813	002678	珠江钢琴	3,300	37,059.00	0.05
814	000626	远大控股	2,800	37,044.00	0.05
815	300471	厚普股份	2,950	36,816.00	0.05
816	300333	兆日科技	4,300	36,765.00	0.05
817	603636	南威软件	3,200	36,736.00	0.05
818	601595	上海电影	1,800	36,702.00	0.05
819	000548	湖南投资	5,500	36,630.00	0.05
820	000551	创元科技	4,400	36,300.00	0.05
821	600876	洛阳玻璃	1,800	36,288.00	0.05
822	002524	光正集团	5,700	36,195.00	0.05
823	300362	天翔环境	2,800	36,176.00	0.05
824	603233	大参林	700	36,162.00	0.05
825	300348	长亮科技	2,400	36,144.00	0.05
826	002274	华昌化工	5,000	36,100.00	0.05
827	603227	雪峰科技	6,300	36,099.00	0.05
828	300468	四方精创	900	35,847.00	0.05
829	002296	辉煌科技	4,800	35,808.00	0.05
830	002535	林州重机	7,580	35,777.60	0.05
831	603258	电魂网络	1,100	35,739.00	0.05
832	300440	运达科技	3,600	35,640.00	0.05
833	300052	中青宝	2,500	35,625.00	0.05
834	002452	长高集团	5,800	35,554.00	0.05
835	603555	贵人鸟	2,000	35,400.00	0.05
836	002114	罗平锌电	2,000	35,400.00	0.05
837	601007	金陵饭店	3,300	35,343.00	0.05
838	300494	盛天网络	1,900	35,150.00	0.05

839	601500	通用股份	3,500	35,000.00	0.05
840	603996	中新科技	1,900	34,998.00	0.05
841	300312	邦讯技术	2,500	34,900.00	0.05
842	000038	深大通	1,680	34,893.60	0.05
843	300084	海默科技	4,900	34,741.00	0.05
844	603609	禾丰牧业	3,900	34,632.00	0.05
845	000532	华金资本	3,300	34,617.00	0.05
846	000151	中成股份	2,800	34,468.00	0.05
847	300660	江苏雷利	500	34,390.00	0.05
848	300381	溢多利	2,600	34,320.00	0.05
849	603839	安正时尚	1,400	34,300.00	0.05
850	002059	云南旅游	4,600	34,178.00	0.05
851	603959	百利科技	1,100	34,078.00	0.05
852	002769	普路通	2,399	34,017.82	0.05
853	002363	隆基机械	3,960	33,976.80	0.05
854	002232	启明信息	3,200	33,856.00	0.05
855	600735	新华锦	3,000	33,690.00	0.05
856	002651	利君股份	4,800	33,648.00	0.05
857	600310	桂东电力	6,500	33,605.00	0.05
858	300175	朗源股份	4,500	33,570.00	0.05
859	300419	浩丰科技	3,500	33,530.00	0.05
860	300051	三五互联	3,500	33,425.00	0.05
861	002235	安妮股份	3,250	33,345.00	0.05
862	603997	继峰股份	2,950	33,246.50	0.05
863	600101	明星电力	3,600	33,228.00	0.05
864	300601	康泰生物	700	33,075.00	0.05
865	002234	民和股份	2,900	33,060.00	0.05
866	002781	奇信股份	1,400	33,054.00	0.05

867	603980	吉华集团	1,600	33,008.00	0.05
868	002519	银河电子	5,410	33,001.00	0.05
869	300350	华鹏飞	3,340	32,965.80	0.05
870	300403	地尔汉字	2,150	32,873.50	0.05
871	002494	华斯股份	3,700	32,856.00	0.05
872	002746	仙坛股份	1,400	32,844.00	0.05
873	300497	富祥股份	900	32,823.00	0.05
874	600313	农发种业	10,250	32,697.50	0.05
875	600386	北巴传媒	6,400	32,640.00	0.05
876	002579	中京电子	3,200	32,640.00	0.05
877	600865	百大集团	4,200	32,634.00	0.05
878	601900	南方传媒	2,800	32,592.00	0.05
879	002605	姚记扑克	2,500	32,550.00	0.05
880	300625	三雄极光	1,300	32,448.00	0.05
881	000514	渝开发	5,300	32,436.00	0.05
882	600629	华建集团	2,100	32,256.00	0.04
883	000159	国际实业	6,100	32,147.00	0.04
884	603777	来伊份	1,200	32,100.00	0.04
885	600192	长城电工	4,900	31,899.00	0.04
886	601038	一拖股份	3,800	31,768.00	0.04
887	002351	漫步者	3,700	31,709.00	0.04
888	300443	金雷风电	1,880	31,640.40	0.04
889	300063	天龙集团	5,750	31,625.00	0.04
890	603517	绝味食品	800	31,536.00	0.04
891	300518	盛讯达	600	31,380.00	0.04
892	002574	明牌珠宝	4,200	31,332.00	0.04
893	300528	幸福蓝海	2,340	31,075.20	0.04
894	603508	思维列控	800	30,920.00	0.04

895	603116	红蜻蜓	2,000	30,840.00	0.04
896	603919	金徽酒	1,700	30,685.00	0.04
897	600113	浙江东日	3,000	30,660.00	0.04
898	600843	上工申贝	2,900	30,595.00	0.04
899	002872	天圣制药	1,000	30,550.00	0.04
900	002783	凯龙股份	1,650	30,310.50	0.04
901	300378	鼎捷软件	2,050	30,278.50	0.04
902	002703	浙江世宝	3,650	30,222.00	0.04
903	002577	雷柏科技	1,800	30,204.00	0.04
904	300368	汇金股份	3,500	30,030.00	0.04
905	300173	智慧松德	3,800	30,020.00	0.04
906	001896	豫能控股	5,500	29,810.00	0.04
907	000409	山东地矿	5,686	29,794.64	0.04
908	300100	双林股份	1,900	29,754.00	0.04
909	600278	东方创业	2,500	29,750.00	0.04
910	002788	鹭燕医药	1,000	29,660.00	0.04
911	002791	坚朗五金	1,500	29,655.00	0.04
912	300227	光韵达	1,400	29,638.00	0.04
913	603313	梦百合	1,100	29,513.00	0.04
914	603358	华达科技	800	29,512.00	0.04
915	002461	珠江啤酒	2,500	29,500.00	0.04
916	002545	东方铁塔	3,400	29,478.00	0.04
917	300449	汉邦高科	1,500	29,460.00	0.04
918	603113	金能科技	1,300	29,458.00	0.04
919	300213	佳讯飞鸿	3,800	29,412.00	0.04
920	000637	茂化实华	4,900	29,253.00	0.04
921	300114	中航电测	2,850	29,212.50	0.04
922	002483	润邦股份	5,340	29,103.00	0.04

923	300030	阳普医疗	3,400	29,002.00	0.04
924	300076	GQY 视讯	4,700	28,999.00	0.04
925	002017	东信和平	3,300	28,809.00	0.04
926	002752	昇兴股份	2,655	28,753.65	0.04
927	002401	中远海科	2,400	28,752.00	0.04
928	603730	岱美股份	800	28,648.00	0.04
929	300531	优博讯	1,800	28,548.00	0.04
930	603385	惠达卫浴	1,300	28,431.00	0.04
931	603707	健友股份	1,000	28,230.00	0.04
932	300276	三丰智能	2,400	28,056.00	0.04
933	002782	可立克	2,000	28,040.00	0.04
934	300165	天瑞仪器	4,400	27,940.00	0.04
935	300447	全信股份	1,480	27,868.40	0.04
936	603660	苏州科达	800	27,688.00	0.04
937	603999	读者传媒	3,600	27,684.00	0.04
938	300056	三维丝	3,700	27,491.00	0.04
939	603303	得邦照明	1,900	27,474.00	0.04
940	601968	宝钢包装	5,300	27,401.00	0.04
941	000899	赣能股份	4,600	27,278.00	0.04
942	300516	久之洋	600	27,246.00	0.04
943	603817	海峡环保	2,100	27,216.00	0.04
944	000722	湖南发展	2,900	27,202.00	0.04
945	601858	中国科传	2,500	27,025.00	0.04
946	603305	旭升股份	700	26,635.00	0.04
947	300511	雪榕生物	1,100	26,587.00	0.04
948	002852	道道全	800	26,512.00	0.04
949	002346	柘中股份	1,400	26,166.00	0.04
950	002137	麦达数字	3,700	25,863.00	0.04

951	603727	博迈科	1,100	25,707.00	0.04
952	600828	茂业商业	4,100	25,420.00	0.04
953	600193	创兴资源	4,700	25,380.00	0.04
954	300533	冰川网络	500	25,315.00	0.04
955	002388	新亚制程	3,200	25,280.00	0.04
956	603779	威龙股份	1,500	25,230.00	0.04
957	002660	茂硕电源	2,600	24,908.00	0.03
958	600359	新农开发	3,600	24,444.00	0.03
959	603603	博天环境	700	24,437.00	0.03
960	300568	星源材质	900	24,012.00	0.03
961	603298	杭叉集团	1,500	23,985.00	0.03
962	002323	雅百特	3,500	23,870.00	0.03
963	603669	灵康药业	1,200	23,760.00	0.03
964	603339	四方冷链	1,000	23,720.00	0.03
965	002287	奇正藏药	700	23,716.00	0.03
966	300512	中亚股份	1,300	23,335.00	0.03
967	300380	安硕信息	1,100	23,210.00	0.03
968	300356	光一科技	3,300	23,067.00	0.03
969	603098	森特股份	1,300	23,062.00	0.03
970	603166	福达股份	2,840	22,720.00	0.03
971	002822	中装建设	2,800	21,980.00	0.03
972	002667	鞍重股份	1,300	21,840.00	0.03
973	603861	白云电器	1,300	21,827.00	0.03
974	300508	维宏股份	300	21,744.00	0.03
975	300484	蓝海华腾	1,000	21,600.00	0.03
976	002762	金发拉比	1,300	21,255.00	0.03
977	002790	瑞尔特	800	21,248.00	0.03
978	603800	道森股份	1,300	21,190.00	0.03

979	603081	大丰实业	800	20,960.00	0.03
980	603323	吴江银行	2,500	20,575.00	0.03
981	002801	微光股份	600	20,526.00	0.03
982	002802	洪汇新材	700	20,069.00	0.03
983	603958	哈森股份	1,400	19,712.00	0.03
984	300633	开立医疗	700	19,341.00	0.03
985	300028	金亚科技	3,800	19,190.00	0.03
986	603063	禾望电气	1,000	18,030.00	0.03
987	002724	海洋王	1,900	17,993.00	0.03
988	603421	鼎信通讯	700	17,864.00	0.02
989	603600	永艺股份	1,200	17,052.00	0.02
990	002786	银宝山新	1,800	16,866.00	0.02
991	603803	瑞斯康达	900	16,731.00	0.02
992	300522	世名科技	760	16,013.20	0.02
993	603398	邦宝益智	1,000	15,790.00	0.02
994	603218	日月股份	700	15,715.00	0.02
995	603043	广州酒家	800	15,672.00	0.02
996	300507	苏奥传感	520	14,341.60	0.02
997	603758	秦安股份	1,000	13,940.00	0.02
998	601882	海天精工	800	9,888.00	0.01
999	603058	永吉股份	700	8,498.00	0.01

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	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
6	002592	八菱科技	1,900	42,351.00	0.06
7	300444	双杰电气	2,200	37,400.00	0.05
8	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.04
9	002188	巴士在线	100	1,580.00	0.00

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	24,357,013.95
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。

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	太湖股份	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	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于开通华宝兴业网上直销赎回 T+0 转申购业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 1 月 19 日
2	关于开通华宝兴业网上交易赎回转申购业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 2 月 23 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北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 4 月 19 日
4	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 4 月 25 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金首次申购最低金额、追加申购最低金额、定期定额申购最低金额、单笔最低赎回份额、赎回后最低保有份额及基金转换份额限制的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 5 月 15 日
6	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 5 月 24 日
7	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 6 月 2 日
8	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金新增财通证券股份有	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 6 月 9 日

	限公司为代销机构并开展费率优惠活动的公告		
9	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 7 月 18 日
10	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 7 月 18 日
11	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 7 月 19 日
12	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泰证券基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 7 月 24 日
13	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 7 月 26 日
14	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 7 月 27 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华泰证券认购、申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 8 月 1 日
16	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华夏财富投资管理有限公司为代销机构及费率优	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 9 月 15 日

	惠的公告		
17	华宝兴业基金公司关于旗下部分开放式基金参加财通证券基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 9 月 29 日
18	华宝兴业公司关于旗下部分开放式基金增加国联证券为代销机构并开通定期定额投资业务及参与费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 9 月 29 日
19	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 10 月 23 日
20	华宝基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金首次申购最低金额、追加申购最低金额、定期定额申购最低金额、单笔最低赎回份额、赎回后最低保有份额及基金转换份额限制的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 11 月 10 日
21	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 11 月 20 日
22	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 11 月 24 日
23	华宝兴业中证 1000 指数分级	上海证券报、中国证	2017 年 12 月 6 日

	证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	券报、证券时报和基金管理人网站	
24	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海挖财金融信息服务有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 8 日
25	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期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 12 日
26	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	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 12 日
27	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期间 1000A 停复牌的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 18 日
28	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定期份额折算结果及恢复交易的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 19 日
29	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000A 份额定期份额折算后前收盘价调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 19 日
30	华宝基金公司关于旗下部分	上海证券报、中国证	2017 年 12 月 22 日

	开放式基金参加中金公司基金申购费率优惠活动的公告	券报、证券时报和基金管理人网站	
31	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 26 日
32	华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报和基金管理人网站	2017 年 12 月 27 日

§ 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”。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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 3 月 27 日