华宝兴业中证100指数证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证100指数
基金主代码	240014
交易代码	240014
前端交易代码	240014
后端交易代码	240015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	575,169,640.46份
投资目标	本基金通过指数化投资,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%、年跟踪误差不超过4%,实现对中证100指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成分股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成分股发生调整和成分股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。
风险收益特征	本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	27,031,566.36
2.本期利润	39,607,482.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0715
4.期末基金资产净值	726,917,729.94
5.期末基金份额净值	1.2638

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

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

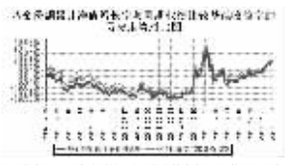
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.98%	0.61%	4.25%	0.59%	1.73%	0.02%

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

(2009年9月29日至2017年9月30日)



注:基金依法应自成立日期起6个月内达到基金合同约定的资产组合,截至2009年11月6日,本基金已完成建仓且达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈建华	本基金基金经理、华宝兴业事件驱动混合、华宝智慧产业混合、华宝第三产业混合、华宝新优享混合基金经理	2012年12月22日	-	16年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司。先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理助理,兼任华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理,2012年12月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2015年4月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理,2017年5月任华宝兴业智慧产业灵活配置混合型证券投资基金和华宝兴业第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年7月任华宝兴业新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。
2.证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证100指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,中证100指数证券投资基金在短期内出现过股票资产占基金资产净值高于95%及持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年三季度,各项经济数据显示国内经济总体呈现出筑底回升态势。1-8月工业企业利润增速回升,8月工业品出厂价格大幅跳升,商品价格走强。9月PMI回升至52.4%,创2012年5月以来新高,连续14个月维持在荣枯线上方。本报告期A股市场整体小幅度上涨,从风格上看中小板指数涨幅较大,大盘蓝筹指数也有较好表现,其中沪深300指数和中证100指数分别上涨4.63%和4.46%,而中证500指数和创业板指分别上涨7.58%和2.69%;在行业方面,受益于供给侧改革的有色、钢铁和煤炭行业表现较好,分别上涨为28.13%,18.96%和11.16%,而公用事业、传媒、纺织服装分别下跌为3.14%,3.09%和1.97%。

本报告期本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为5.98%,同期业绩比较基准收益率为4.25%,基金表现领先比较基准1.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	689,937,670.65	94.74
	其中:股票	689,937,670.65	94.74
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	37,882,509.38	5.20
8	其他资产	400,375.86	0.05
9	合计	728,220,555.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,039,947.94	2.76
C	制造业	206,893,605.45	28.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,499,667.89	2.54
E	建筑业	32,878,082.79	4.52
F	批发和零售业	4,609,745.90	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	13,933,390.64	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,237,588.61	2.37
J	金融业	331,452,421.77	45.60
K	房地产业	36,397,724.89	5.01
L	租赁和商务服务业	1,726,057.35	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,669,032.79	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,320,984.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	688,658,250.02	94.74

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	39,793.60	0.01
C	制造业	781,555.45	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	196,035.81	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	71,788.96	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,279,420.63	0.18

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,047,428	56,728,700.48	7.80
2	600036	招商银行	1,010,767	25,825,096.85	3.55
3	600519	贵州茅台	48,732	25,225,632.48	3.47
4	601166	兴业银行	1,203,927	20,815,897.53	2.86
5	000333	美的集团	436,111	19,271,745.09	2.65
6	600016	民生银行	2,282,097	18,302,417.94	2.52
7	000651	格力电器	465,778	17,652,986.20	2.43
8	000002	万科A	663,733	17,422,991.25	2.40
9	601328	交通银行	2,670,140	16,875,284.80	2.32
10	600887	伊利股份	589,768	16,218,620.00	2.23

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601326	秦港股份	21,442	170,463.90	0.02
2	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.02
3	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.01
4	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.01
5	603055	台华新材	2,658	62,489.58	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2
基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,116.57
2	应收证券清算款	238,115.54
3	应收股利	-
4	应收利息	8,985.35
5	应收申购款	105,158.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	400,375.86

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.6 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有债券投资。

5.11.7 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分
-

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	570,637,415.49
报告期期间基金总申购份额	125,337,036.51
减:报告期期间基金总赎回份额	120,804,811.54
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	575,169,640.46

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	22,112,742.66
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	22,112,742.66
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.84

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	177,072,025.39	0.00	0.00	177,072,025.39	30.79%
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如该投资者集中赎回,可能会增加基金的流动性风险。此外,由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产,可能对持有资产的价格形成冲击,增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产,加强防范流动性风险、市场风险,保护持有人利益。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.基金管理人于2017年8月9日发布公告,华宝兴业基金管理有限公司(以下简称"公司")原外方股东领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)将所持有的公司49%的股权转让给Warburg Pincus Asset Management, L.P.的事项目前已经分别获得中国证监会核准和中华人民共和国商务部批准,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%。公司股东会已就上述股权转让等事宜对公司章程进行了相应修订,9月12日,Warburg Pincus Asset Management, L.P.完成了收购Lyxor Asset Management S.A.持有的华宝兴业基金公司49%的股份的交割。

2.基金管理人于2017年10月20日发布公告,2017年10月17日,公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续,公司法定名称由"华宝兴业基金管理有限公司"变更为"华宝基金管理有限公司"。

3.基金管理人于2017年9月29日发布公告,常务副总经理Alexandre Werno先生自2017年9月29日起不再担任常务副总经理的职务。

4.基金管理人于2017年9月29日发布公告,聘请欧江洪先生担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业中证100指数证券投资基金基金合同;
华宝兴业中证100指数证券投资基金招募说明书;
华宝兴业中证100指数证券投资基金托管协议;
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;
基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点
以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

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

华宝兴业基金管理有限公司
2017年10月25日

华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证1000指数分级
场内简称	1000分级
基金主代码	162413
交易代码	162413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月4日
报告期末基金份额总额	108,922,722.13份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下,本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。在正常情况下,本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝兴业中证1000指数分级
下属分级基金场内简称	1000A	1000B	1000分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金的份额总额	7,412,746.00份	7,412,746.00份	94,097,230.13份
下属分级基金的风险收益特征	华宝中证1000A份额具有较低风险、较低相对稳定的特征。	华宝中证1000B份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,003,729.84
2.本期利润	3,926,726.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0348
4.期末基金资产净值	84,180,230.63
5.期末基金份额净值	0.7728

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.70%	0.91%	4.81%	0.92%	-0.11%	-0.01%

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9月30日)

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接、华宝兴业中证医疗指数分级、华宝兴业中证1000指数分级、华宝兴业标普中国A股红利机会指数(LOF)、华宝兴业中证银行ETF联接基金经理	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月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作,2012年10月起任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证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,2015年5月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理,2015年6月起任华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金基金经理。2016年8月起兼任华宝兴业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月兼任华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理,2017年7月任华宝兴业中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。
2.证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度,各项经济数据显示中国经济企稳迹象较为明显。1-8月工业企业利润增速回升,8月工业品出厂价格大幅跳升,商品价格走强。9月PMI回升至52.4%,创2012年5月以来新高,连续14个月维持在荣枯线上方。总体货币政策仍然维持中性,汇率相对稳定,季末央行定向降准有利于结构性改革的进一步推进。从A股市场表现来看,有色、钢铁和采掘等周期板块表现强势,全年来看,食品饮料、家电、有色和钢铁板块涨幅居前。在消费股、周期股和金融股的联合带动下,市场总体呈现稳健上涨的走势。三季度沪深两市强弱相当,中小板表现相对突出。以沪深300指数和中证100指数为代表的大盘蓝筹股指数分别上涨了4.63%和4.46%;而作为成长股代表的中小板指和创业板指分别上涨了8.86%和2.69%。在本报告期中,中证1000指数累计上涨了5.05%。

本报告期本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为4.70%,同期业绩比较基准收益率为4.81%,基金表现落后比较基准0.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	79,862,684.56	93.93
	其中:股票	79,862,684.56	93.93
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	5,149,165.49	6.06
8	其他资产	11,561.67	0.01
9	合计	85,023,411.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	899,292.50	1.07
C	制造业	1,546,018.04	1.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,953,065.99	60.53
E	建筑业	2,035,162.00	2.42
F	批发和零售业	2,745,224.02	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	2,275,371.93	2.70
H	住宿和餐饮业	44,881.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,256,019.96	8.62
J	金融业	393,360.40	0.46
K	房地产业	3,126,883.60	3.71
L	租赁和商务服务业	1,155,787.50	1.37
M	科学研究和技术服务业	620,265.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	980,452.20	1.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	343,615.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	1,461,256.56	1.74
S	综合	816,646.46	0.97
	合计	79,666,401.76	94.64

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	108,819.00	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	87,463.80	0.10
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	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	196,282.80	0.23

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300142	沃森生物	19,100	321,835.00	0.38
2	002509	天广中茂	31,004	306,009.48	0.36
3	600004	白云机场	22,055	288,699.95	0.34
4	600110	诺德股份	20,400	277,236.00	0.33
5	600567	山鹰纸业	48,500	265,780.00	0.32
6	600490	鹏欣资源	23,400	258,570.00	0.31
7	000807	云铝股份	18,500	256,595.00	0.30
8	600779	水井坊	6,100	255,102.00	0.30
9	002185	华天科技	30,300	254,217.00	0.30
10	002497	雅化集团	13,600	251,192.00	0.30

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002070	*ST众和	10,700	108,819.00	0.13
2	002504	*ST弘高	10,798	87,463.80	0.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
中证1000指数分级基金截至2017年9月30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。
中证1000指数分级基金截至2017年9月30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,未经环评审批履行建设年回收利用5800吨脱墨污泥技改项目,并投入生产。收到整改通知。
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,按照成分股在中证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八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2
基金投资的前十名股票未超出基金合同规