华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2017年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证全指证券公司ETF
场内简称	券商ETF
基金主代码	512000
交易代码	512000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016年8月30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	279,617,683.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年9月14日

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的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 1.组合复制策略 本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，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调整。 2.替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别或份额被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 3.债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 4.股指期货、权证等金融衍生工具投资策略 在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价差投资策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、条空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用指数复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点为基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年8月30日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	484,068.11	7,143,588.99
本期利润	-14,131,057.09	-774,614.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0844	-0.0027
本期加权平均净值利润率	-8.64%	-0.27%
本期基金份额净值增长率	-6.82%	-3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	-26,905,965.73	-4,664,448.31
期末可供分配基金份额利润	-0.0962	-0.0300
期末基金资产净值	252,711,717.27	151,053,234.69
期末基金份额净值	0.9038	0.9700
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-9.62%	-3.00%

注：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.期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.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）。

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	-14.01%	1.04%	-14.63%	1.05%	0.62%	-0.01%
过去六个月	-5.79%	1.26%	-8.06%	1.28%	2.27%	-0.02%
过去一年	-6.82%	1.05%	-12.35%	1.07%	5.53%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-9.62%	1.05%	-15.99%	1.08%	6.37%	-0.03%

注：1.本基金业绩比较基准为：中证全指证券公司指数。

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

（2016年8月30日至2017年12月31日）