华宝创新优选混合型证券投资基金 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	华宝创新优选混合型证券投资基金
基金简称	华宝创新优选混合
基金主代码	000601
交易代码	000601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月14日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	214,614,726.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的企业,在控制风险的前提下为基金持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1) 本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对拥有持续创新能力的企业相关股票的深入分析,积极挖掘企业的创新溢价,分享其投资机会; (3) 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券、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;本基金将密切关注国内外宏观经济走势与央国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,且上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合; (4) 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,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率× 80%+ 上证国债指数收益率× 20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021- 38505888	010- 66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400- 700- 5588、021- 38924558	95566
传真		021- 38505777	010- 66594942

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	12,284,997.13	-40,380,576.24	-38,258,772.14
本期利润	13,705,633.86	-51,252,769.35	-23,353,408.31
加权平均基金份额本期利润	0.0961	-0.3161	-0.1331
本期加权平均净值利润率	10.10%	-36.65%	-11.68%
本期基金份额净值增长率	17.76%	-23.42%	43.33%
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	-95,947,164.07	-70,561,582.58	-62,097,197.54
期末可供分配基金份额利润	-0.4471	-0.5411	-0.3239
期末基金资产净值	214,915,155.68	110,896,121.58	212,874,314.54
期末基金份额净值	1.001	0.850	1.110
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	21.37%	3.06%	34.59%

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.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较低数。

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

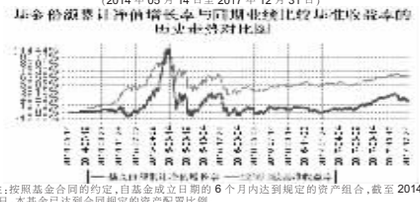
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.39%	1.05%	1.74%	0.61%	-6.13%	0.44%
过去六个月	7.98%	1.03%	6.21%	0.56%	1.77%	0.47%
过去一年	17.76%	0.94%	12.20%	0.52%	5.56%	0.42%
过去三年	29.26%	2.09%	15.94%	1.38%	13.32%	0.71%
自基金合同生效日起至今	21.37%	1.95%	67.00%	1.31%	-45.63%	0.64%

注:1.本基金业绩比较基准为:中证 800 指数收益率× 80%+ 上证国债指数收益率× 20%。

2.份额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)。

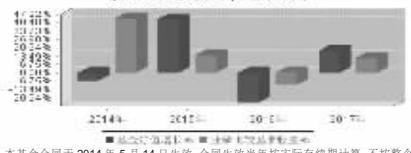
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2014 年 05 月 14 日至 2017 年 12 月 31 日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合,截至 2014 年 11 月 14 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



注:基金合同于 2014 年 5 月 14 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

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
2015	3.4000	105,528,375.36	5,658,605.82	111,186,981.18	
合计	3.4000	105,528,375.36	5,658,605.82	111,186,981.18	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2017 年 12 月 31 日),所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、医药生物基金、资源优选基金、华宝添益基金、服务优选基金、创新优选基金、生态中国基金、量化对冲基金、高端制造基金、品质生活基金、稳健回报基金、事件驱动基金、国策导向基金、新价值基金、新机遇基金、医疗分级基金、中证 1000 分级基金、万物互联基金、转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来主导产业基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金、新优享基金和银行 ETF,所管理的证券投资基金资产净值合计 124,360,151,012.53 元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理/助理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
区伟良	本基金基金经理、华宝转型升级混合、华宝生态中国混合基金经理	2016年9月7日	2017年10月17日	7年	硕士,2010 年 4 月加入华宝基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理的职务,2015 年 4 月起任华宝生态中国混合型证券投资基金基金经理,2015 年 12 月兼任华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月起至 2017 年 10 月兼任华宝创新优选混合型证券投资基金基金经理。
代云锋	本基金基金经理	2017年10月17日	-	5年	2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司从事行业研究工作,2015 年 7 月起担任基金经理助理的职务。2017 年 10 月任华宝创新优选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、《华宝创新优选混合型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、投权、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目身及组合间反向交易,对越交易、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内对同一债券的反向交易,债券买卖到期收益率与中债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

回顾 2017 年,A 股毫无疑问是典型的结构性牛市。这一年里,尽管大中市值股票表现优于小盘股,但对于投研人员来说,无论其风格是偏价值还是偏成长,其面对的是一个周期、消费、成长都能够找到系统性投资机会的市场;周期有钢铁、煤炭;消费有白酒、家电;成长有新能源、电子等。然而,一年下来,大多数人的收益率却表现平平,甚至在观感上很多是疲惫和无力。原因无它,市场的"二八效应"太明显,过去 3 年通行的一些投资模式在 2017 年纷纷行不通。

不同于以往,2017 年的投资实操中题材和炒作趋于无效,小盘股溢价趋于无效,市值管理趋于无效,机构机构主实业的业绩才能获得市场价青睐,甚至业绩增长本身的持续性和增长质量决定其是否能够获得估值溢价。一定程度上这是 A 股市场有效性提升的体现,而有效性的提升往往表现为两方面:一方面,股市是经济的晴雨表,无论是总量还是结构,都是对宏观经济的映射,映射越精准,市场越有效;另一方面,价格与价值的匹配,包括幅度和周期两个维度,二者偏离的幅度越小,时间越短,市场就越有效。

2017 年中国宏观经济表现是增速平稳、整体向好,决定 GDP 的"三驾马车"中,房地产投资超预期、三四线城市消费明显升级,进出口受益于海外复苏而出现增速回升,这些在股市上的映射则表现为:周期板块中消费型子行业涨幅较前、受益于供给侧改革的股块弹性最大;食品饮料、家电、家居等行业盈利超预期,同时出现估值中枢上移,戴维斯双击效应明显。同时,在产业结构上的表现是,经历 21 世纪头十年经济高速发展后,当下经济整体增速下台阶,不少产业的竞争格局逐步固化,行业集中度提升,优势企业的竞争力越来越凸显,白马公司享受估值溢价,在股市中表现出明显的龙头效应。最后,越来越多上市公司的股价走势和业绩紧密挂钩,大家更喜欢看到业绩增长的持续性和确定性,从而更多的关注行业潜力和发展阶段,关注公司的护城河、治理和管理层能力等,对应到投资行为上就是挑选优质的行业和卓越的企业。总结而言,随着体系设计对投资行为规范化要求的提升,成熟市场边际资金的进入,基本面研究和价值思考在 A 股越来越重要,而如何去发挥专长,通过研究创造价值,寻找和捕捉价值和价格的剪刀差,是机构投资者需要思考和提升的地方。

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 17.76%,同期业绩比较基准收益率为 12.20%,基金表现领先比较基准 5.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年,我们认为宏观经济下行的压力依然不小,美国继续加息以及全球区域政治的不稳定仍会给国内经济增长带来潜在负面影响。同时,当前政府坚持把防范经济金融风险放在了比较重要的位置,货币政策整体偏紧,流动性风险需要密切关注,而资金供需面边际无法改善的话,A 股整体估值中枢阶段性触底回升的难度较大。因此,2018 年对于 A 股投资者而言将会是面临考验的一年。

但是,我们认为尽管经济整体增长放缓的态势不变,但在政策调控下,GDP 增速有望保持在相对平稳水平。同时,随着改革的推进,特别是供给侧加速淘汰落后产能,经济结构的调整也在加速。一方面,传统行业的效率和集中度将得到提高;另一方面,新兴产业仍然处于快速发展的机遇期,在整体国民经济中的占比将不断提升。中长期看,以新能源汽车、人工智能、物联网、5G 等为代表的技术创新、以移动互联网代表的商业模式创新,以及中国深化改革带来的制度创新方兴未艾,我们坚信在改革和创新推动下的中国经济转型必然会带来更多的投资机会。

整体而言,我们依然看好 2018 年股票市场的资产配置价值,但预计在新的环境下市场结构分化将会进一步加剧,甄选优质行业和公司的难度在提升。未来我们将恪守投资边界,紧取自下而上和自上而下相结合的投资策略,对于产业的研究和思考会更加深入,对于个股的甄选也会更加严格。我们将继续努力寻找受益于技术创新、商业模式创新和制度创新的子行业和公司,买入并长期持有,分享这些公司在未来成长过程中带来的丰厚回报。同时,我们将以勤勉尽责的态度,不断优化我们的投资组合,努力给持有人带来丰厚的中长期回报。

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《个人声明书》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账务处理;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

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对华宝创新优选混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华宝创新优选混合型证券投资基金

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		25,088,611.37	24,002,081.03
结算备付金		915,011.70	482,381.46
存出保证金		62,851.58	113,154.22
交易性金融资产		192,654,402.40	88,096,672.98
其中:股票投资		192,654,402.40	88,096,672.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		7,985.35	4,333.48
应收股利		-	-
应收申购款		123,162.20	11,613.05
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		218,852,024.60	112,710,236.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,703,452.90	-
应付赎回款		253,930.67	22,707.87
应付管理人报酬		277,029.10	142,738.51
应付托管费		46,171.52	23,789.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,535,754.20	1,244,878.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		120,530.53	380,000.00
负债合计		3,936,868.92	1,814,114.64
所有者权益:			
实收基金		214,614,726.25	130,400,031.36
未分配利润		300,429.43	-19,503,909.78
所有者权益合计		214,915,155.68	110,896,121.58
负债和所有者权益总计		218,852,024.60	112,710,236.22

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.001 元,基金份额总额 214,614,726.25 份。

7.2 利润表

会计主体:华宝创新优选混合型证券投资基金

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		17,966,403.23	-46,064,837.87
1.利息收入		185,016.99	224,956.31
其中:存款利息收入		184,960.24	220,795.73
债券利息收入		56.75	31.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,128.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		16,225,571.44	-35,524,582.21
其中:股票投资收益		15,727,427.10	-35,746,889.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益		853.18	34,194.66
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		497,291.16	188,112.21
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		1,420,636.73	-10,872,193.11
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		135,178.07	106,981.14
减:二、费用		4,260,769.37	5,187,931.48
1、管理人报酬		2,017,819.43	2,103,236.03
2、托管费		336,303.28	350,539.38
3、销售服务费		-	-
4、交易费用		1,720,782.40	2,437,303.77
5、利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6、其他费用		185,864.26	296,852.30
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		13,705,633.86	-51,252,769.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		13,705,633.86	-51,252,769.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝创新优选混合型证券投资基金

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)	130,400,031.36	-19,503,909.78	110,896,121.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,705,633.86	13,705,633.86
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)	84,214,694.89	6,098,705.35	90,313,400.24
其中:1.基金申购款	129,379,447.88	5,678,733.48	135,058,181.36
2.基金赎回款	-45,164,752.99	419,971.87	-44,744,781.12
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)	214,614,726.25	300,429.43	214,915,155.68
	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)	191,730,406.71	21,143,907.83	212,874,314.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-51,252,769.35	-51,252,769.35
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)	-61,330,375.35	10,604,951.74	-50,725,423.61
其中:1.基金申购款	19,423,294.55	-2,620,584.87	16,802,709.68
2.基金赎回款	-80,753,669.90	13,225,536.61	-67,528,133.29
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)	130,400,031.36	-19,503,909.78	110,896,121.58

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:

霍小蕙 向辉 张幸毅

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

华宝创新优选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业创新优选股票型证券投资基金,华宝兴业创新优选混合型证券投资基金,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[2014]第 301 号《关于核准华宝兴业创新优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业创新优选股票型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人民币 512,745,881.61 元,业经安永华明会计师事务所安永华明(2014)验字第 60737318_B05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 512,887,511.92 份基金份额,其中认购资金利息折合 141,630.31 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》、华宝兴业创新优选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业创新优选混合型证券投资基金。

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》、华宝兴业创新优选混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝创新优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝创新优选混合型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、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于创新主题类上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金资产支持证券投资市值不得超过基金资产净值的 20%;本基金权证投资市值不得超过基金资产净值的 3%;其余资产投资于现金、货币市场工具、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:80%× 中证 800 指数收益率 +20%× 上证国债指数收益率。

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》、《华宝创新优选混合型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、买入返售金融资产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(