华宝宝康消费品证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6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
送出日期：2019年8月29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。本半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2019年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华宝宝康消费品混合
基金主代码	240001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15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	419,548,591.81份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长；为基金份额持有人谋求长期稳定回报。
投资策略	本基金看好消费品的发展前景，长期持有消费品组合，并注重资产在其各相关行业的配置，适当进行时机选择。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

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

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	61,740,686.84
本期利润	151,029,760.19
加权平均基金份额本期利润	0.3509
本期基金份额净值增长率	16.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	2.0084
期末基金资产净值	1,011,275,894.93
期末基金份额净值	2.4104

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

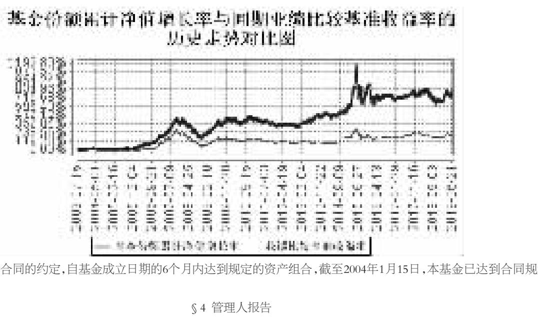
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	4.87%	1.08%	4.42%	0.93%	0.45%	0.15%
过去三个月	−1.05%	1.24%	−0.72%	1.22%	−0.33%	0.02%
过去六个月	16.72%	1.25%	21.89%	1.24%	−5.17%	0.01%
过去一年	1.97%	1.31%	8.87%	1.22%	−6.90%	0.09%
过去三年	6.49%	0.98%	20.08%	0.89%	−13.59%	0.09%
自基金合同生效日起至今	782.49%	1.34%	212.89%	1.36%	569.60%	−0.02%

注：1、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。

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



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2004年1月15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（2019年6月30日），正在管理运作的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证100 基金、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证1000分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司ETF、华宝中证军工ETF、华宝新活力基金、华宝沪深300指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝银行ETF、华宝银行ETF联接基金、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证500指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商ETF联接基金、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝科技先锋基金、华宝宝裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健FOF基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等，正在管理运作的证券投资基金资产净值合计171,851,775,826.03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		
胡戈游	本基金基金经理、华宝核心优势混合基金经理	2011年2月11日	–	14年	硕士，拥有CFA资格。2005年2月加入华宝基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、国内投资部基金经理助理等职务，现任助理投资总监。2009年5月至2010年6月任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2010年1月至2012年1月任华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2011年2月起任华宝宝康消费品证券投资基金基金经理，2013年7月至2015年12月任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理，2015年1月至2018年11月任华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理，2016年1月起任华宝核心优势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、《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约》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，宝康消费品基金在短期内出现过国债投资占基金资产净值低于20%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

上半年市场跌宕起伏，一季度市场表现强劲，指数涨幅较大。虽然经济仍处于筑底的阶段，上市公司的业绩增长也需要验证，但市场整体的估值较低，流动性也较充裕，市场成交迅速放大，上涨动能非常强劲。二季度指数出现较大幅度调整，投资者的悲观预期主要来自外部贸易战的压力，以及对内部经济下滑的堪忧。但市场结构性差异较大，逆周期的防御型资产相对表现较好，有较高超额收益。

本基金主要基于长期配置的思路，自下而上精选个股，持有景气度高，且现金流好的公司，行业上主要增持了免税、传媒、食品饮料、科技等，基金组合比较稳健。免税、食品饮料等消费白马表现较好，有较高超额收益，传媒表现较差对净值有拖累。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为16.72%，业绩比较基准收益率为21.89%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断二季度市场整体预期过于悲观，调整过度，虽然经济仍处于筑底的阶段，但股票整体的估值较低，流动性也较充裕，刺激经济的相关政策后续有望逐步落地，短期贸易战会有所缓和，市场存在一定的反弹空间。结构上继续看好消费和科技。重点关注的领域有：受益于消费升级的品牌消费品及免税、食品伊饮料、娱乐、新零售等新兴成长的子行业；行业景气度较高的创新药及医疗信息化行业；符合时代科技发展方向的新技术、新科技领域，比如人工智能技术的应用，新能源汽车的普及等也会有较好的投资机会。

感谢持有人一直以来对我们的支持，在后续投资中，我们将继续总结经验，勤勉尽责，努力实现消费品基金的良好表现。

4.6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。

4.7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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：华宝宝康消费品证券投资基金

报告截止日： 2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：		
银行存款	55,067,602.96	94,481,819.34
结算备付金	763,302.26	1,124,997.20
存出保证金	343,158.62	311,307.42
交易性金融资产	955,183,332.46	826,614,875.46
其中：股票投资	739,305,164.46	631,937,875.46
基金投资	–	–
债券投资	215,878,168.00	194,677,000.00
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	4,487,372.48	5,195,260.97
应收股利	–	–
应收申购款	104,697.59	132,336.56
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,015,949,466.37	927,860,596.95
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	74.35	10,512,919.79
应付赎回款	1,662,946.48	289,467.01
应付管理人报酬	1,194,133.11	1,176,529.55
应付托管费	199,022.19	196,088.26
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	1,520,808.66	1,190,023.03
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	96,586.65	432,455.68
负债合计	4,673,571.44	13,797,483.32
所有者权益：		
实收基金	168,643,685.97	177,906,802.61
未分配利润	842,632,208.96	736,156,311.02
所有者权益合计	1,011,275,894.93	914,063,113.63
负债和所有者权益总计	1,015,949,466.37	927,860,596.95

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值2.4104元，基金份额总额419,548,591.81份。

6.2利润表

会计主体：华宝宝康消费品证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	162,842,294.00	28,110,839.42
1.利息收入	4,275,136.85	4,573,017.73
其中：存款利息收入	275,135.90	236,338.26
债券利息收入	4,000,000.95	4,336,679.47
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）	69,115,836.45	19,865,541.27
其中：股票投资收益	65,447,155.43	15,961,768.75
基金投资收益	–	–
债券投资收益	235,106.20	−459,064.00
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	3,433,574.82	4,362,836.52
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	89,289,073.35	3,481,658.05
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	162,247.35	190,622.37
减：二、费用	11,812,533.81	13,931,915.13
1. 管理人报酬	7,312,452.92	8,009,817.12
2. 托管费	1,218,742.13	1,334,969.55
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	3,172,344.18	4,470,214.19
5. 利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6. 税金及附加	–	–
7. 其他费用	108,994.58	116,914.27
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	151,029,760.19	14,178,924.29
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	151,029,760.19	14,178,924.29

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝宝康消费品证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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）	177,906,802.61	736,156,311.02	914,063,113.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	151,029,760.19	151,029,760.19
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）	−9,263,116.64	−44,553,862.25	−53,816,978.89
其中：1.基金申购款	5,754,039.07	26,961,026.57	32,715,065.64
2.基金赎回款	−15,017,155.71	−71,514,888.82	−86,532,044.53
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）	168,643,685.97	842,632,208.96	1,011,275,894.93
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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）	186,476,519.35	896,426,756.12	1,082,903,275.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	14,178,924.29	14,178,924.29
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）	−8,604,226.21	−42,482,218.09	−51,086,444.30
其中：1.基金申购款	8,266,213.13	41,933,861.11	50,200,074.24
2.基金赎回款	−16,870,439.34	−84,416,079.20	−101,286,518.54
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）	177,872,293.14	868,123,462.32	1,045,995,755.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

华宝宝康系列开放式证券投资基金(原名为华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金，以下简称"本系列基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2003]第62号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》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《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起，并于2003年7月15日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为宝康消费品证券投资基金(以下简称"本基金")、宝康灵活配置证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,893,701,931.41元，其中包括本基金人民币1,540,046,055.09元、宝康灵活配置证券投资基金人民币1,066,581,834.53元和宝康债券投资基金人民币1,287,074,041.79元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第96号验资报告予以验证。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《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金更新的招募说明书》和《华宝兴业基金管理有限公司关于对华宝兴业宝康消费品证券投资基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于2007年3月26日进行了基金份额拆分，拆分比例为2.487739364，并于2007年3月26日进行了变更登记。

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》，华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金之宝康消费品证券投资基金于2017年12月30日起更名为华宝宝康系列开放式证券投资基金之宝康消费品证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，其中投资于消费品类股票的比例不低于股票资产的80%。在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的50%-75%；债券为20%-45%；现金比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

本基金的财务报表于2019年8月29日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2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》、《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

无

6.4.5.2会计估计变更的说明

无

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司("华宝基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("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("华宝信托")	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management,L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司("宝武集团")	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司("华宝证券")	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司("华宝投资")	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

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股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告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。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,312,452.92	8,009,817.12
其中：支付销售机构的客户维护费	297,366.85	320,812.97

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1.5%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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,218,742.13	1,334,969.55

注：支付托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

无。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
基金合同生效日（ 2003年7月15日 ）持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	807,952.69	807,952.69
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	807,952.69	807,952.69
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1900%	0.1800%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	55,067,602.96	256,222.94	41,147,610.12	214,589.82

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。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9期末（ 2019年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30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739,305,164.46元，属于第二层次的余额为215,878,168.00元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次631,937,875.46元，第二层次194,677,000.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2019年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018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)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1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	739,305,164.46	72.77
	其中：股票	739,305,164.46	72.77
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	215,878,168.00	21.25
	其中：债券	215,878,168.00	21.25
	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	55,830,905.22	5.50
8	其他各项资产	4,935,228.69	0.49
9	合计	1,015,949,466.37	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	311,344,481.44	30.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	23,445,216.80	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	42,628,530.46	4.22
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,818,000.00	17.58
J	金融业	22,770,000.00	2.25
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	128,307,500.00	12.69
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	535,105.76	0.05
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	32,456,330.00	3.21
S	综合	–	–
	合计	739,305,164.46	73.11

7.2.2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。

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601888	中国国旅	750,000	66,487,500.00	6.57
2	002624	完美世界	2,400,000	61,944,000.00	6.13
3	002127	南极电商	5,500,000	61,820,000.00	6.11
4	002555	三七互娱	3,000,000	40,650,000.00	4.02
5	300014	亿纬锂能	1,300,989	39,628,124.94	3.92
6	603711	香飘飘	1,100,000	37,367,000.00	3.70
7	300253	卫宁健康	2,600,000	36,868,000.00	3.65
8	600009	上海机场	360,000	30,160,800.00	2.98
9	002821	凯莱英	300,000	29,424,000.00	2.91
10	002174	游族网络	1,700,000	28,696,000.00	2.84

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

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1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	002555	三七互娱	57,488,129.72	6.29
2	002624	完美世界	51,883,124.51	5.68
3	002127	南极电商	39,303,845.22	4.30
4	002174	游族网络	37,098,634.49	4.06
5	601398	工商银行	34,886,102.00	3.82
6	300014	亿纬锂能	33,915,669.26	3.71
7	603711	香飘飘	33,279,005.84	3.64
8	600760	中航沈飞	32,611,523.01	3.57
9	600887	伊利股份	29,879,918.61	3.27
10	601318	中国平安	29,565,213.38	3.23
11	002304	洋河股份	26,549,405.10	2.90
12	000858	五粮液	25,596,986.01	2.80
13	600009	上海机场	23,541,867.82	2.58
14	603883	老百姓	23,346,078.90	2.55
15	000651	格力电器	21,133,137.00	2.31
16	000425	徐工机械	21,010,382.40	2.30
17	600754	锦江股份	20,105,152.40	2.20
18	600136	当代明诚	19,951,154.16	2.18
19	300413	芒果超媒	18,786,176.30	2.06
20	002583	海能达	18,741,904.12	2.05
21	603197	保隆科技	18,612,146.93	2.04

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2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	600009	上海机场	55,536,668.46	6.08
2	002127	南极电商	42,367,413.09	4.64
3	601888	中国国旅	38,555,995.47	4.22
4	600519	贵州茅台	38,345,094.00	4.20
5	002624	完美世界	37,677,448.81	4.12
6	600887	伊利股份	36,400,171.30	3.98
7	601318	中国平安	34,718,699.90	3.80
8	601398	工商银行	33,953,209.03	3.71
9	600136	当代明诚	31,786,388.77	3.48
10	300725	药石科技	27,932,676.09	3.06
11	600315	上海家化	25,483,394.04	2.79
12	600038	中直股份	25,048,404.55	2.74
13	002707	众信旅游	25,019,258.00	2.74
14	300413	芒果超媒	24,451,220.95	2.68
15	300078	思创医惠	24,369,186.37	2.67
16	002739	万达电影	22,802,504.48	2.49
17	600967	内蒙一机	21,844,167.60	2.39
18	601933	永辉超市	21,635,421.00	2.37
19	600754	锦江股份	21,515,511.32	2.35
20	002661	克明面业	21,397,464.39	2.34
21	000425	徐工机械	20,897,367.00	2.29
22	002555	三七互娱	19,355,201.40	2.12
23	002024	苏宁易购	19,294,634.06	2.11
24	600570	恒生电子	18,723,031.08	2.05

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3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	1,021,107,899.39
卖出股票收入（成交）总额	1,069,685,642.27

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	62,756,800.00	6.21
2	央行票据	–	–
3	金融债券	153,121,368.00	15.14
	其中：政策性金融债	153,121,368.00	15.14
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	215,878,168.00	21.35

7.6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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21国债(7)	610,000	62,756,800.00	6.21
2	180202	18国开02	300,000	30,336,000.00	3.00
2	180212	18国开12	300,000	30,336,000.00	3.00
3	140219	14国开19	300,000	30,057,000.00	2.97
4	160206	16国开06	300,000	29,946,000.00	2.96
5	190302	19进出02	200,000	19,982,000.00	1.98

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8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。

7.9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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1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。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2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。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12投资组合报告附注

7.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.12.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3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	343,158.62
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,487,372.48
5	应收申购款	104,697.59
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,935,228.69

7.12.4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。

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因 ，合计数可能不等于分项之和。

§8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
30,812	13,616.40	1,907,265.84	0.45%	417,641,325.97	99.55%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	25,441.44	0.0061%

8.3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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2003年7月15日 ）基金份额总额	1,541,018,133.75
本报告期期初基金份额总额	442,593,482.32
本报告期期间基金总申购份额	14,314,577.49
减：本报告期期间基金总赎回份额	37,359,468.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–
本报告期期末基金份额总额	419,548,591.81

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2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
本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3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。

10.4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。

10.5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（2003年7月15日）起至本报告期末。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1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	
国泰君安	2	319,927,648.23	15.31%	297,946.53	15.55%	–
民生证券	1	214,167,448.54	10.25%	195,169.32	10.18%	–
中信建投	2	169,960,196.62	8.13%	158,284.24	8.26%	–
东吴证券	2	168,216,658.84	8.05%	155,749.19	8.13%	–
华创证券	1	148,758,735.40	7.12%	135,564.38	7.07%	–
长江证券	1	138,459,021.77	6.63%	128,946.77	6.73%	–
招商证券	1	107,950,013.10	5.17%	98,374.70	5.13%	–
东方证券	1	105,529,374.41	5.05%	96,168.98	5.02%	–
上海证券	1	102,694,954.52	4.91%	93,586.16	4.88%	–
长城证券	2	101,903,647.82	4.88%	94,902.81	4.95%	–
华泰证券	1	77,013,005.19	3.69%	71,722.28	3.74%	–
西藏东方财富	1	73,549,632.62	3.52%	67,026.19	3.50%	–
国盛证券	2	69,778,658.22	3.34%	64,984.39	3.39%	–
浙商证券	1	67,264,749.40	3.22%	61,298.22	3.20%	–
西部证券	1	54,127,774.94	2.59%	39,583.26	2.07%	–
东北证券	2	47,632,915.45	2.28%	43,408.04	2.27%	–
中信证券	1	40,033,662.55	1.92%	37,283.94	1.95%	–
方正证券	1	38,119,066.00	1.82%	35,499.98	1.85%	–
中金国际	1	21,594,674.30	1.03%	20,111.38	1.05%	–
海通证券	2	14,891,929.00	0.71%	13,571.01	0.71%	–
天风证券	2	7,885,974.74	0.38%	7,186.48	0.38%	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
爱建证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	1	–	–	–	–	–
万联证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	1	–	–	–	–	–
中山证券	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要，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、本基金本报告期新增券商交易单元信息如下：

天风证券

10.7.2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
国泰君安	14,569,483.80	25.89%	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	15,340,777.20	27.26%	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	26,367,903.90	46.85%	–	–	–	–
西藏东方财富	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
中金国际	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
爱建证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
万联证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
中山证券	–	–	–	–	–	–

§11影响投资者决策的其他重要信息

11.1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

无。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2019年6月22日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

华宝基金管理有限公司
2019年8月29日