

华宝增强收益债券型证券投资基金 2019 年半年度报告（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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	华宝增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 2 月 17 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	90,589,615.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B
下属分级基金的交易代码:	240012	240013
报告期末下属分级基金的份额总额	81,897,773.49 份	8,691,841.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求较高的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别（包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等）的预期收益进行动态跟踪，决定其配置比例。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	郭明
	联系电话	021-38505888	010-66105798
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95588
传真		021-38505777	010-66105799

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	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。

§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

基金级别	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	2,211,103.70	291,241.22
本期利润	3,592,981.63	410,054.38
加权平均基金份额本期利润	0.0435	0.0376
本期加权平均净值利润率	3.77%	3.41%
本期基金份额净值增长率	3.85%	3.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	5,289,579.00	87,945.90
期末可供分配基金份额利润	0.0646	0.0101
期末基金资产净值	96,142,683.65	9,695,279.01
期末基金份额净值	1.1739	1.1154
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	57.89%	51.57%

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与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

华宝增强收益债券 A

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	1.15%	0.11%	0.47%	0.07%	0.68%	0.04%

过去三个月	0.62%	0.15%	-0.53%	0.11%	1.15%	0.04%
过去六个月	3.85%	0.14%	-0.37%	0.10%	4.22%	0.04%
过去一年	6.60%	0.11%	2.70%	0.10%	3.90%	0.01%
过去三年	5.81%	0.11%	-0.12%	0.11%	5.93%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	57.89%	0.20%	4.08%	0.11%	53.81%	0.09%

华宝增强收益债券 B

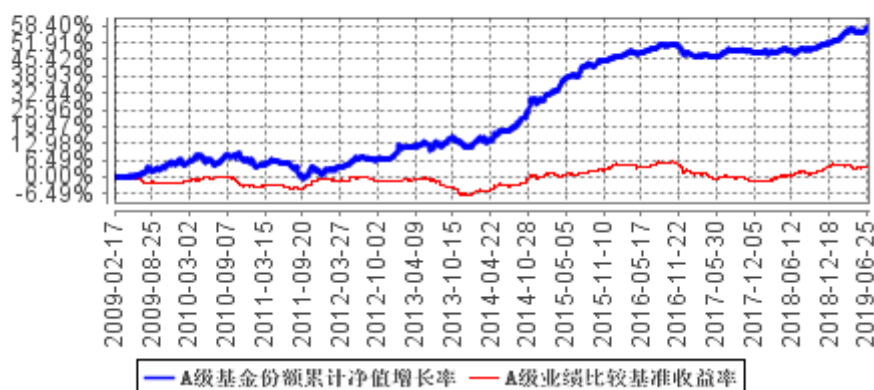
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.12%	0.10%	0.47%	0.07%	0.65%	0.03%
过去三个月	0.51%	0.15%	-0.53%	0.11%	1.04%	0.04%
过去六个月	3.64%	0.14%	-0.37%	0.10%	4.01%	0.04%
过去一年	6.18%	0.11%	2.70%	0.10%	3.48%	0.01%
过去三年	4.63%	0.11%	-0.12%	0.11%	4.75%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	51.57%	0.20%	4.08%	0.11%	47.49%	0.09%

注：1、本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

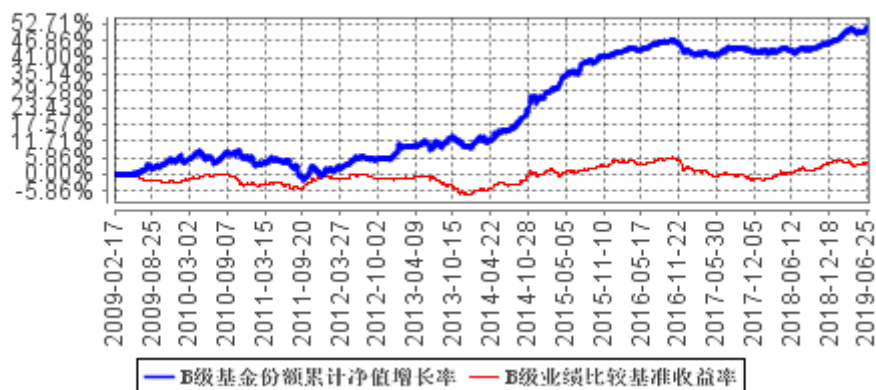
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

A级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



B级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 2009 年 8 月 16 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（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		
李栋梁	固定收益部副总经理、本基金	2014 年 10 月 11 日	-	16 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的

	<p>基金经理、华宝宝康债券、华宝可转债债券、华宝新起点混合、华宝新飞跃混合基金经理</p>			<p>研究和投资。2010 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，担任债券分析师、基金经理助理等职务，现任固定收益部副总经理。2011 年 6 月起担任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月起任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）和华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 3 月任华</p>
--	--	--	--	---

					宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
詹杰	本基金基金经理、华宝大盘精选混合、华宝稳健回报混合基金经理	2018 年 8 月 29 日	-	9 年	硕士。曾在易方达基金、华创证券从事研究工作。2015 年 9 月加入华宝基金管理有限公司担任投资经理。2018 年 8 月起任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理、华宝大盘精选混合型证券投资基金基金经理。2019 年 7 月起任华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
厉卓然	本基金基金经理助理、华宝宝康债券、华宝宝鑫债券基金经理助理	2017 年 4 月 26 日	-	6 年	硕士。曾任华宸未来基金管理有限公司产品经理。2014 年 9 月加入华宝基金管理有限公司先后担任交易员、高级交易员，2017 年 4 月起任华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝宝康债券投资基金基金经理助理，2017 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理，2018 年 7 月起任华宝现金宝货币市场基金基金经理助理。

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、《华宝增强收益债券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

2019 年 1-6 月份，固定资产累计投资完成额（不含农户）同比增长 5.8%，2 季度固定资产投资增速持续下滑。其中，制造业投资累计同比增长 3%，增速继续下滑；1-6 月房地产开发投资累计同比 10.9%，比去年全年回升 1.4 个百分点，房地产开发投资有一定韧性，但是 2 季度房地产开发投资增速开始下滑；基础设施投资（不含电力、热力、燃气及水生产和供应业）累计同比增长 4.1%，增速始终在低位徘徊。以美元计，1-6 月份出口金额累计同比上升 0.1%，内外需放缓和抢出口的负面影响后期可能显现；1-6 月份进口金额累计同比下降 4.3%，进口增速下滑明显，显示内需不佳。1-6 月份社会消费品零售总额累计同比增长 8.4%，名义增速小幅下滑，实际消费增速较去年下降。物价水平方面，6 月份 CPI 同比增长 2.7%，6 月份水平可能是全年高点，后期 CPI 趋于下降，年底还有反复；6 月份 PPI 同比增速 0%，PPI 面临下滑压力。

2019 年 1 季度债券市场相对较好，资金价格较低，带动中短端收益率下行，长端收益率受到宽信用的影响趋于上升。2 季度债券市场先下跌后上涨，4 月份央行货币政策从宽松转为中性

之后，债券市场收益率快速上行。5 月份贸易战恶化和经济数据下行推动债券收益率缓慢下降。包商事件导致流动性分层和信用分层，低等级信用类债券的信用利差拉大，季末资金非常宽松，贸易战靴子落地和总理关于降准、降息的表态带动债券收益率继续下行。

权益市场从年初开始大幅上涨至 4 月上旬，1 月份大的指数表现较好，2、3 月份小的指数表现更好。随着央行货币政策转为中性，权益市场开始下跌，贸易战恶化和经济数据下行导致权益市场继续下跌，6 月份在政策加大基建、贸易战阶段性缓和、资金宽松以及维稳力量等的共同作用下，权益出现持续反弹，权益市场结构出现分化，上证 50、沪深 300 表现相对较好，小的指数表现较差。转债的走势和结构与权益市场走势完全一致，

增强收益债券基金年初降低了组合久期，6 月份再度提高了组合久期。1 季度对转债进行了交易，锁定了部分投资收益。年初股票仓位较低导致净值增速偏慢，后来增加了权益仓位且以稳健性品种为主，股票投资部分绩效有所改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为 3.85%；本报告期基金份额 B 净值增长率为 3.64%；同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 GDP 增长 6.3%，3 季度经济依然面临下行压力。社会消费品零售总额增速 6 月份表现较好主要是因当月汽车消费增速大幅提升所致，这种情况不可持续，下半年汽车消费增速仍然面临下滑压力，但增速下滑幅度较上半年收窄。总体来说受制于收入增速下行的影响，消费增速难有起色。出口增速受到全球经济增速下行和贸易战影响可能继续下降，上半年净出口对经济的贡献度提升，若出口增速继续下滑可能对经济造成拖累。房地产融资收紧可能导致房地产投资增速的下滑，基建投资增速有望回升。3 季度通胀水平趋于下降，年底再度回升，PPI 有一定下滑压力。3 季度名义 GDP 增速可能较 2 季度下滑。货币政策方面保持稳健，财政政策可能趋于积极，专项债规模可能增加以提高基建增速。

3 季度债券市场可能存在小的机会，名义 GDP 增速下行，社会融资总量增速见顶后小幅下降都对债市构成支撑，收益率曲线可能出现平坦化走势。债券投资以利率债和中高等级信用债为主，回避信用资质较差的信用债，严防信用风险。贸易战会影响经济走势和央行货币政策方向。今年 5 月份以来权益市场呈现事件驱动特征，维稳力量的增强导致市场波动幅度下降，权益投资的难度较此前增加，择时的效应下降，择券的效用增加。可转债需要做好个券选择。总得来说市场的

不确定性变强，我们会高度关注经济和政策的变化，分析其对大类资产配置的影响，以改善业绩。

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

本基金本报告期末进行利润分配，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

本报告期内，本基金托管人在对华宝增强收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，华宝增强收益债券型证券投资基金的管理人——华宝基金管理有限公司在华宝增强收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华宝增强收益债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华宝基金管理有限公司编制和披露的华宝增强收益债券型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：华宝增强收益债券型证券投资基金

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	10,020,216.71	5,772,013.92
结算备付金	1,565,643.48	3,532,514.05
存出保证金	15,073.73	14,797.65
交易性金融资产	114,195,673.40	113,203,861.40
其中：股票投资	9,400,037.80	4,723,104.00
基金投资	-	-
债券投资	104,795,635.60	108,480,757.40
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	-	12,786.87
应收利息	2,335,495.88	1,901,386.05
应收股利	-	-
应收申购款	200.00	3,684.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	128,132,303.20	124,441,043.94
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	16,300,000.00	23,000,000.00
应付证券清算款	5,705,422.30	-
应付赎回款	136,276.14	8,280.26
应付管理人报酬	52,401.32	63,356.22
应付托管费	17,467.15	21,118.75
应付销售服务费	3,520.31	2,800.91
应付交易费用	4,868.06	1,701.57

应交税费	4,691.50	7,153.04
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	69,693.76	140,000.22
负债合计	22,294,340.54	23,244,410.97
所有者权益：		
实收基金	90,589,615.26	89,893,866.75
未分配利润	15,248,347.40	11,302,766.22
所有者权益合计	105,837,962.66	101,196,632.97
负债和所有者权益总计	128,132,303.20	124,441,043.94

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额总额 90,589,615.26 份。其中 A 类基金份额 81,897,773.49 份，A 类基金份额净值 1.1739 元；B 类基金份额 8,691,841.77 份，B 类基金份额净值 1.1154 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝增强收益债券型证券投资基金

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	4,772,602.88	961,268.55
1.利息收入	2,025,974.77	3,170,377.89
其中：存款利息收入	44,833.08	25,305.93
债券利息收入	1,981,141.69	3,117,030.33
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	28,041.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,240,239.54	-2,812,699.14
其中：股票投资收益	-176,960.68	-186,586.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,239,712.79	-2,626,113.14
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	177,487.43	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,500,691.09	600,517.82

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	5,697.48	3,071.98
减：二、费用	769,566.87	937,937.40
1. 管理人报酬	319,145.45	416,826.89
2. 托管费	106,381.90	138,942.36
3. 销售服务费	23,612.34	18,337.13
4. 交易费用	22,449.50	25,012.49
5. 利息支出	204,315.23	244,036.34
其中：卖出回购金融资产支出	204,315.23	244,036.34
6. 税金及附加	3,573.65	7,544.79
7. 其他费用	90,088.80	87,237.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,003,036.01	23,331.15
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,003,036.01	23,331.15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝增强收益债券型证券投资基金

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）	89,893,866.75	11,302,766.22	101,196,632.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,003,036.01	4,003,036.01
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）	695,748.51	-57,454.83	638,293.68
其中：1.基金申购款	34,065,644.28	3,471,539.37	37,537,183.65

2. 基金赎回款	-33,369,895.77	-3,528,994.20	-36,898,889.97
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）	90,589,615.26	15,248,347.40	105,837,962.66
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）	129,426,173.80	12,611,715.41	142,037,889.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,331.15	23,331.15
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）	-4,402,283.11	-426,900.60	-4,829,183.71
其中：1.基金申购款	4,052,906.61	351,863.40	4,404,770.01
2.基金赎回款	-8,455,189.72	-778,764.00	-9,233,953.72
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）	125,023,890.69	12,208,145.96	137,232,036.65

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

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝增强收益债券型证券投资基金(原名为华宝兴业增强收益债券型证券投资基金,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[2008]第 1294 号《关于核准华宝兴业增强收益债券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《华宝兴业增强收益债券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 2,257,644,988.35 元,业经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2009)验字第 60737318_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 2 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,258,208,383.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 563,394.90 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《华宝增强收益债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认/申购费用、在赎回时收取赎回费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费用、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类基金份额。本基金 A 类、B 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,A 类基金份额和 B 类基金份额将分别计算基金份额净值,投资者可自行选择基金份额类别进行认购/申购。

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》,华宝兴业增强收益债券型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝增强收益债券型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝增强收益债券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,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、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。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%;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%。本基金可通过投资首次发行股票、增发

新股、可转换债券转股票以及权证行权等方式获得股票，也可直接从二级市场买入股票。本基金可通过参与可分离转债申购而获得权证，也可直接从二级市场买入权证。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率×100%。

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》、《华宝增强收益债券型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 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

-

6.4.5.2 会计估计变更的说明

-

6.4.5.3 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。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

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交易。

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	319,145.45	416,826.89
其中：支付销售机构的客户维护费	21,757.33	21,162.84

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	106,381.90	138,942.36

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B	合计
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	7,181.80	7,181.80
华宝基金管理有限公司	-	2,224.05	2,224.05
合计	-	9,405.85	9,405.85
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B	合计
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	8,376.86	8,376.86
华宝基金管理有限公司	-	2,290.57	2,290.57
合计	-	10,667.43	10,667.43

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 B 类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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	
	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B

基金合同生效日（ 2009 年 2 月 17 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,798,891.84	-
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	1,798,891.84	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.2000%	-

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B
基金合同生效日（ 2009 年 2 月 17 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,798,891.84	-
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	1,798,891.84	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.5500%	-

报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资 B 类基金。

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
中国工商银行	10,020,216.71	30,281.14	2,013,218.10	15,174.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 16,300,000 元，于 2019 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 9,400,037.8 元，属于第二层次的余额为 104,795,635.6 元，无属于第三

层次的余额(2018年12月31日：第一层次4,723,104.00元，第二层次108,480,757.40元，无属于第三层次的余额)。

(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) 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。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	9,400,037.80	7.34
	其中：股票	9,400,037.80	7.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	104,795,635.60	81.79
	其中：债券	104,795,635.60	81.79
	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	11,585,860.19	9.04
8	其他各项资产	2,350,769.61	1.83
9	合计	128,132,303.20	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	621,667.00	0.59
C	制造业	5,658,255.80	5.35
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	-	-
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	157,180.00	0.15

J	金融业	2,748,690.00	2.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	214,245.00	0.20
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	9,400,037.80	8.88

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	000651	格力电器	28,800	1,584,000.00	1.50
2	601328	交通银行	147,000	899,640.00	0.85
3	601988	中国银行	221,700	829,158.00	0.78
4	000581	威孚高科	38,900	721,984.00	0.68
5	600519	贵州茅台	700	688,800.00	0.65
6	600547	山东黄金	15,100	621,667.00	0.59
7	000568	泸州老窖	6,900	557,727.00	0.53
8	000333	美的集团	10,400	539,344.00	0.51
9	600761	安徽合力	50,000	480,000.00	0.45
10	000858	五粮液	3,800	448,210.00	0.42

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	600761	安徽合力	1,010,072.00	1.00
2	000581	威孚高科	816,670.00	0.81
3	002572	索菲亚	800,173.00	0.79
4	603871	嘉友国际	712,708.40	0.70
5	600519	贵州茅台	571,830.00	0.57
6	000333	美的集团	549,620.00	0.54
7	000568	泸州老窖	434,090.00	0.43
8	601628	中国人寿	378,930.00	0.37
9	600009	上海机场	377,524.00	0.37
10	002142	宁波银行	329,805.00	0.33
11	601128	常熟银行	329,481.00	0.33
12	002179	中航光电	327,321.00	0.32
13	600409	三友化工	325,480.00	0.32
14	002027	分众传媒	276,633.00	0.27
15	002250	联化科技	274,344.00	0.27
16	000858	五粮液	271,489.00	0.27
17	002345	潮宏基	221,247.00	0.22
18	002384	东山精密	220,415.00	0.22
19	000725	京东方 A	211,800.00	0.21
20	603799	华友钴业	164,052.00	0.16

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002572	索菲亚	913,319.00	0.90
2	601818	光大银行	828,671.00	0.82
3	601998	中信银行	742,000.00	0.73
4	603871	嘉友国际	726,263.00	0.72
5	600761	安徽合力	591,787.00	0.58
6	600009	上海机场	422,182.00	0.42
7	600409	三友化工	315,773.00	0.31
8	000725	京东方 A	263,338.00	0.26

9	002250	联化科技	260,592.00	0.26
10	002345	潮宏基	186,344.00	0.18
11	603799	华友钴业	166,908.00	0.16
12	002876	三利谱	90,250.00	0.09
13	000710	贝瑞基因	88,896.00	0.09
14	603711	香飘飘	15,140.00	0.01

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	9,073,801.40
卖出股票收入（成交）总额	5,611,463.00

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	3,797,600.00	3.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,871,040.00	30.11
	其中：政策性金融债	31,871,040.00	30.11
4	企业债券	65,546,198.40	61.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,580,797.20	3.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	104,795,635.60	99.02

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	140350	14 进出 50	100,000	10,384,000.00	9.81

2	018008	国开 1802	100,000	10,177,000.00	9.62
3	122385	15 中信 02	86,300	9,064,952.00	8.56
4	136173	16 龙源 01	68,000	6,771,440.00	6.40
5	136270	16 南网 01	60,000	5,975,400.00	5.65

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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	15,073.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,335,495.88
5	应收申购款	200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,350,769.61

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	2,482,897.20	2.35
2	127007	湖广转债	1,097,900.00	1.04

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 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

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
华宝增强收益债券 A	575	142,430.91	69,029,630.04	84.29%	12,868,143.45	15.71%
华宝增强收益债券 B	452	19,229.74	0.00	0.00%	8,691,841.77	100.00%
合计	1,027	88,208.00	69,029,630.04	76.20%	21,559,985.22	23.80%

8.2 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	华宝增强收益债券 A	107,217.62	0.1309%
	华宝增强收益债券 B	0.00	0.0000%
	合计	107,217.62	0.1184%

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	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	华宝增强收益债券 A	10~50
	华宝增强收益债券 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开	华宝增强收益债券 A	0

放式基金	华宝增强收益债券 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝增强收益债券 A	华宝增强收益债券 B
基金合同生效日（2009 年 2 月 17 日）基金份额总额	615,728,987.54	1,642,479,395.71
本报告期期初基金份额总额	82,168,906.24	7,724,960.51
本报告期期间基金总申购份额	2,141,863.65	31,923,780.63
减：本报告期期间基金总赎回份额	2,412,996.40	30,956,899.37
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	81,897,773.49	8,691,841.77

注：总申购份额含红利再投、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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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

本基金自 2015 年 12 月 15 日起更换会计师事务所，由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。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：2015 年 12 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、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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
申万宏源	1	6,990,888.00	47.60%	6,510.50	47.61%	-
国泰君安	1	6,002,664.40	40.88%	5,589.67	40.87%	-
海通证券	1	1,691,712.00	11.52%	1,575.53	11.52%	-

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、本期交易单元无变动。

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
申万宏源	45,303,040.61	22.41%	-	-	-	-
国泰君安	96,584,422.58	47.77%	731,500,000.00	42.81%	-	-
海通证券	60,280,901.19	29.82%	977,300,000.00	57.19%	-	-

§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

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	20190101~20190630	67,230,738.20	0.00	0.00	67,230,738.20	74.21%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

华宝基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日