

华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金

2019 年半年度报告

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：江苏银行股份有限公司

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。

基金托管人江苏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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.11 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金	
基金简称	华宝宝丰高等级债券	
基金主代码	006300	
交易代码	006300	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2018 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	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,175,227,516.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华宝宝丰高等级债券 A	华宝宝丰高等级债券 C
下属分级基金的交易代码:	006300	006301
报告期末下属分级基金的份额总额	4,175,124,289.63 份	103,227.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于利率债及高等级信用债，投资目标是在有效控制风险的基础上，力求获得长期稳定的投资收益。
投资策略	<p>本基金根据宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究，进行自上而下的资产配置，并结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析，进行债券类品种期限结构和类属配置。</p> <p>1、债券投资策略</p> <p>(1) 久期策略</p> <p>本基金在分析宏观经济指标和财政货币政策等的基础上，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，动态调整投资组合的久期，有效地控制利率波动对基金资产净值波动的影响。预期利率上升时适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。</p> <p>(2) 收益率曲线策略</p> <p>本基金运用收益率曲线策略，根据预期收益率曲线变化来调整投资组合的期限结构配置。预测收益率曲线可能向上移动或向下移动，降低或拉长整个投资组合的平均剩余期限。或者根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征，通过骑乘策略，投资于最有投资价值的债券，以此提高投资组合收益。</p> <p>(3) 信用债投资策略</p> <p>信用债券是本基金的重要投资对象。本基金将充分考虑宏观信用环境和主要行业的风险水平，综合考虑市场收益率水平，决定投资组合内的内外部信用等级的分布及分行业的投资比例。在个券选择上，确定本基金可承担的信用风险的个券，运用多维度绝对与相对价值分析方法和利率期限结构模型进行价值评估，挑选价值相对被低估的券种进行投资。</p> <p>2、资产支持证券投资策略</p>

	<p>本基金将通过宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>3、银行存款投资策略</p> <p>本基金将对利率市场整体环境和利率走势进行深入分析，在对交易对手信用风险进行评估的基础上，向交易对手银行进行询价，确定各存款银行的投资比例，并选取利率报价较高的银行进行存款投资。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	柯振林
	联系电话	021-38505888	025-58588217
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	kezhenlin@jsbchina.cn
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	95319
传真		021-38505777	025-58588155
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	南京市中华路 26 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	南京市中华路 26 号
邮政编码		200120	210001
法定代表人		孔祥清	夏平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	本基金半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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	基金管理人	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 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	华宝宝丰高等级债券 A	华宝宝丰高等级债券 C
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	86,098,776.92	7,173.94
本期利润	72,773,384.45	17,322.63
加权平均基金份额本期利润	0.0160	0.0452
本期加权平均净值利润率	1.57%	4.45%
本期基金份额净值增长率	1.56%	1.41%
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	62,987,860.95	2,052.60
期末可供分配基金份额利润	0.0151	0.0199
期末基金资产净值	4,255,753,550.53	105,713.19
期末基金份额净值	1.0193	1.0241
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	3.44%	2.41%

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

华宝宝丰高等级债券 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	0.50%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.02%	-0.01%
过去三个月	0.47%	0.05%	0.64%	0.06%	-0.17%	-0.01%
过去六个月	1.56%	0.05%	2.00%	0.06%	-0.44%	-0.01%

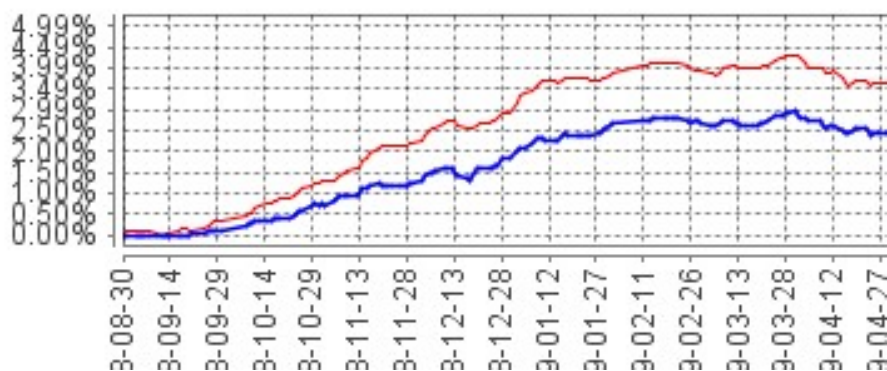
自基金合同生效日起至今	3.44%	0.05%	4.98%	0.05%	-1.54%	0.00%
-------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

华宝宝丰高等级债券 C

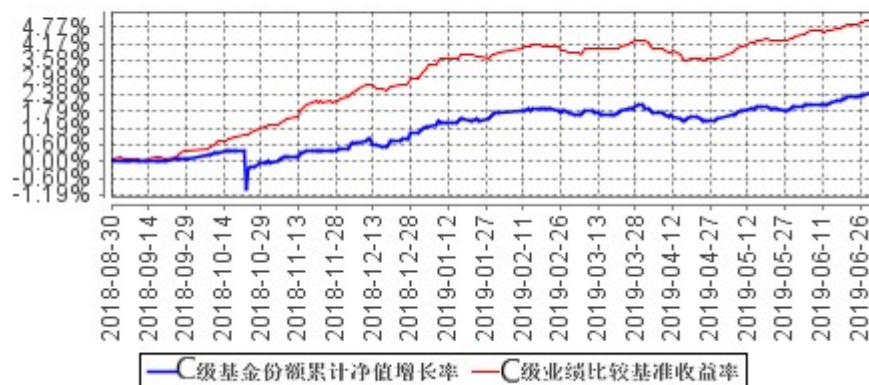
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.48%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.04%	-0.01%
过去三个月	0.40%	0.05%	0.64%	0.06%	-0.24%	-0.01%
过去六个月	1.41%	0.05%	2.00%	0.06%	-0.59%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	2.41%	0.12%	4.98%	0.05%	-2.57%	0.07%

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



C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，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 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 2019 年 2 月 28 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		
王慧	本基金基金经理、华宝宝裕债券 A 基	2018 年 8 月 30 日	-	14 年	硕士。曾在中国银行、南洋商业和苏州从事债券投资管理工作。2016 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，担任投资经理。2018

	金经理、 华宝宝 盛债券 基金经 理				年 8 月起任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 3 月起任华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 4 月起任华宝宝盛纯债债券型证券投资基金基金经理。
林昊	本基金 基金经 理、华宝 新价值 混合、华 宝新机 遇混合、 华宝新 活力混 合基金 经理	2018 年 8 月 30 日	-	13 年	本科。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 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 12 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 12 月至 2018 年 12 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，2018 年 8 月起任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理。
徐燧	本基金 经理助 理	2018 年 11 月 22 日	-	7 年	硕士。曾在太平资产管理有限公司担任信用分析师职务，2014 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任投资经理、信用分析师基金经理助理等职务。2018 年 11 月起任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理助理。

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、《华宝宝丰高等级债券型发起式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

上半年国内宏观经济稳中有降，一、二季度 GDP 当季增速分别为 6.4%和 6.2%。一季度宏观经济变量和市场风险偏好都较 2018 年发生了较大的变化，稳增长、宽信用的对冲政策不断加码，宏观经济显现出一定的企稳迹象；而中美贸易谈判短期乐观，投资者风险偏好提升。长端利率债在年初收益率下行之后震荡上行，但整体上行幅度不是很大。进入 4 月，央行在货币政策委员会例会上意外重提“把好货币供给总闸门，不搞大水漫灌”并且取消“加大逆周期调节的力度”，同

时，管理层将“促改革、调结构”的重要性逐渐提升，更加关注供给侧的结构性改革。4 月公布的 3 月 PMI、工业增加值等经济数据以及社融数据全面超预期，同时，央行连续两次辟谣降准传言，导致市场对央行流动性宽松的预期发生转变，隔夜利率维持在 2.5%左右，短端利率快速上行。叠加 2 季度通胀抬头的预期，投资者情绪受到较大影响，债券收益率大幅上行，其中 10 年期国债收益上行 20BP 左右至 3.85%附近。5 月初，中美贸易谈判暂缓，美方拟于 5 月 10 日对来自中国的 2000 亿美元进口商品的关税从 10%上调至 25%，并称可能对额外的 3000 亿美元商品加征关税，市场风险偏好回落。央行宣布 5 月 15 日开始对中小银行实行较低存款准备金率，释放长期资金约 2800 亿元，隔夜利率快速下行至 1.2%的低点，债券收益也跟随下行。而 4 月经济数据较 3 月有较大回落，同时 CPI 上行幅度低于预期，推动债券收益率进一步下行。5 月 24 日包商银行被接管事件公告后，债市悲观情绪一度升温，但在后续管理层不断加码安抚政策出台后，短期影响消退，过度宽松的货币环境与 5 月较弱的经济数据推动债券收益率进一步下行。

本基金上半年保持投资组合久期和一定的杠杆比例，并对部分仓位进行了交易，整体净值出现一定程度上涨。

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 1.56%；本报告期基金份额 C 净值增长率为 1.41%；同期业绩比较基准收益率为 2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内宏观经济仍有一定的下行压力。近期房地产调控政策趋严，预计房地产投资增速将持续回落；在积极的财政政策支持下，未来基建增速可能会有所回升，但受财政支出节奏提前和隐性债务约束的影响下预计回升幅度相对有限；而制造业投资预计仍将维持弱势。出口方面则在全球 PMI 持续走弱以及 2000 亿美元加征关税的影响下存在较大的不确定性。短期汽车消费大幅上升，主要受到国五向国六标准转变以及新能源车补贴退坡过渡期结束的影响。从中长期来看，前期居民加杠杆的负面影响，以及就业压力带来的可支配收入增速的放缓，都制约了消费改善的持续性。货币政策方面，全球多国央行开启降息周期，市场预期美联储年内将降息 2-3 次，叠加中美利差维持高位，国内央行货币政策继续维持相对宽松的可能性较大，预计资金利率也将维持低位。此外，国内债市对外海投资者的吸引力提升也将带来一定的配置资金。总体来看，三季度在国内经济基本面继续走弱，货币政策宽松概率较大，海外配资力量较强的背景下，债券收益率震荡下行的可能性较大。

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、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

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于2019年4月3日发布了分红公告，本次分红为本

基金 2019 年度的第 1 次分红。本基金向 2019 年 4 月 8 日在本基金注册登记机构登记在册的华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.1500 元，利润分配合计为人民币 64,761,925.96 元，其中现金形式发放总额为人民币 57,202,591.03 元，再投资形式发放总额为人民币 7,559,334.93 元。C 类基金份额不参与本次分红。

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

本基金为发起式基金，基金合同于 2018 年 8 月 30 日生效，基金管理人于 2018 年 8 月 24 日运用固有资金作为发起资金认购本基金，且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于 3 年。

根据本基金基金合同的规定：基金合同生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

截止 2019 年 6 月 30 日，本基金基金合同生效未满三年，基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§ 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，在托管华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金的过程中，本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，本基金托管人—江苏银行股份有限公司未发现华宝基金管理有限公司在华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	3,299,158.36	11,576,843.68
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,767,414,000.00	4,662,885,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,767,414,000.00	4,662,885,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	717,999,437.01
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	80,125,024.71	106,879,100.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	10,914.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,850,838,183.07	5,499,351,295.50
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		593,399,463.30	493,919,019.12
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		111.63	-
应付管理人报酬		1,048,049.85	922,084.66
应付托管费		349,349.95	307,361.54
应付销售服务费		21.95	221.83
应付交易费用	6.4.7.7	44,701.89	66,250.05

应交税费		-	-
应付利息		72,487.39	266,951.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	64,733.39	60,000.00
负债合计		594,978,919.35	495,541,888.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,175,227,516.76	4,913,060,012.70
未分配利润	6.4.7.10	80,631,746.96	90,749,394.28
所有者权益合计		4,255,859,263.72	5,003,809,406.98
负债和所有者权益总计		4,850,838,183.07	5,499,351,295.50

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华宝宝丰高等级债券 A 基金份额净值 1.0193 元，基金份额总额 4,175,124,289.63 份；华宝宝丰高等级债券 C 基金份额净值 1.0241 元，基金份额总额 103,227.13 份。华宝宝丰高等级债券份额总额合计为 4,175,227,516.76 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金

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	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		85,137,227.47
1.利息收入		93,185,352.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,453.25
债券利息收入		91,579,326.50
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,556,572.46
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,241,003.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	5,241,003.78
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,315,243.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	26,115.26

减：二、费用		12,346,520.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,946,134.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,315,378.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	504.74
4. 交易费用	6.4.7.19	56,275.00
5. 利息支出		2,944,895.20
其中：卖出回购金融资产支出		2,944,895.20
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	83,333.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		72,790,707.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		72,790,707.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金

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）	4,913,060,012.70	90,749,394.28	5,003,809,406.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	72,790,707.08	72,790,707.08
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）	-737,832,495.94	-18,146,428.44	-755,978,924.38
其中：1.基金申购款	1,530,991,456.63	26,865,330.82	1,557,856,787.45
2.基金赎回款	-2,268,823,952.57	-45,011,759.26	-2,313,835,711.83
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）	-	-64,761,925.96	-64,761,925.96
五、期末所有者权益	4,175,227,516.76	80,631,746.96	4,255,859,263.72

(基金净值)			
--------	--	--	--

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：

_____	_____	_____
黄小蕙	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

华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]1208 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 10,101,219.27 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00007 号的验资报告。基金合同于 2018 年 8 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式不同,将基金份额分为不同类别,即 A 类基金份额(以下简称“华宝宝丰高等级债券 A”)和 C 类基金份额(以下简称“华宝宝丰高等级债券 C”)两类份额。其中,华宝宝丰高等级债券 A 是指在投资者认购/申购时收取认购/申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别;华宝宝丰高等级债券 C 是指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金招募说明书》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,包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工

具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资股票、权证,也不投资可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)和可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于高等级债券的比例不低于非现金资产的 80%;现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金所指的高等级债券指国债、央行票据、金融债、地方政府债以及信用评级为 AAA 的信用债(包括企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等非国家信用担保的固定收益类金融工具)。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	3,299,158.36
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	3,299,158.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	4,764,188,262.42	4,767,414,000.00	3,225,737.58
	合计	4,764,188,262.42	4,767,414,000.00	3,225,737.58
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,764,188,262.42	4,767,414,000.00	3,225,737.58	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	392.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,500.00
应收债券利息	80,120,132.50
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	80,125,024.71

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	44,701.89
合计	44,701.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

2019 年 6 月 30 日	
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	64,733.39
合计	64,733.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宝宝丰高等级债券 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,908,752,984.40	4,908,752,984.40
本期申购	1,530,962,758.67	1,530,962,758.67
本期赎回(以“-”号填列)	-2,264,591,453.44	-2,264,591,453.44
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,175,124,289.63	4,175,124,289.63

金额单位：人民币元

华宝宝丰高等级债券 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,307,028.30	4,307,028.30
本期申购	28,697.96	28,697.96
本期赎回(以“-”号填列)	-4,232,499.13	-4,232,499.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	103,227.13	103,227.13

注：申购含红利再投以及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宝宝丰高等级债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,497,559.28	34,209,011.34	90,706,570.62
本期利润	86,098,776.92	-13,325,392.47	72,773,384.45
本期基金份额交易产生的变动数	-14,846,549.29	-3,242,218.92	-18,088,768.21
其中：基金申购款	18,418,662.08	8,446,221.93	26,864,884.01
基金赎回款	-33,265,211.37	-11,688,440.85	-44,953,652.22
本期已分配利润	-64,761,925.96	-	-64,761,925.96
本期末	62,987,860.95	17,641,399.95	80,629,260.90

单位：人民币元

华宝宝丰高等级债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,052.58	29,771.08	42,823.66
本期利润	7,173.94	10,148.69	17,322.63
本期基金份额交易产生的变动数	-18,173.92	-39,486.31	-57,660.23
其中：基金申购款	299.26	147.55	446.81
基金赎回款	-18,473.18	-39,633.86	-58,107.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,052.60	433.46	2,486.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,753.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	29,700.01
其他	0.02
合计	49,453.25

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,241,003.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,241,003.78

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,120,156,063.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,043,317,976.22
减：应收利息总额	71,597,083.95
买卖债券差价收入	5,241,003.78

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,315,243.78
——股票投资	-
——债券投资	-13,315,243.78
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-13,315,243.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	26,115.26
合计	26,115.26

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	56,275.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	56,275.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	44,897.60
清算所 CFCA 证书服务费	600.00
帐户维护费	18,000.00
其他	-
合计	83,333.39

6.4.7.21 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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(以下简称“华宝基金”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(以下简称“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(以下简称“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(以下简称“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(以下简称“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(以下简称“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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	6,946,134.01
其中：支付销售机构的客户维护费	155.95

注：支付基金管理人华宝基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	2,315,378.05

注：支付基金托管人江苏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	华宝宝丰高等级债券 A	华宝宝丰高等级债券 C	合计
华宝基金	-	283.61	283.61
合计	-	283.61	283.61

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，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。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率 0.25%。其计算公式为：
日基金销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	
	华宝宝丰高等级债券 A	华宝宝丰高等级债券 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 30 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,900,000.00	100,000.00
期间申购/买入总份额	146,695.64	-
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	10,046,695.64	100,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2400%	96.8700%

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。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

华宝宝丰高等级债券 A				
关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
宝钢集团财务 有限责任公司	-	-	49,999,000.00	1.0200%
江苏银行股份 有限公司	499,899,010.09	11.9700%	-	-

6.4.10.5 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	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	3,299,158.36	19,753.22

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

华宝宝丰高等级债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019 年 4 月 8 日	-	2019 年 4 月 8 日	0.1500	57,202,591.03	7,559,334.93	64,761,925.96	
合计	-	-	-	0.1500	57,202,591.03	7,559,334.93	64,761,925.96	

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末持有的证券中无因新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 593,399,463.3 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期 日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170209	17 国开 09	2019 年 7 月 1 日	101.40	5,000,000	507,000,000.00
190203	19 国开 03	2019 年 7 月	99.36	1,100,000	109,296,000.00

		1 日			
合计				6,100,000	616,296,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于风险较小、收益稳定的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。本基金不投资股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(分离交易可转债的纯债部分除外)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险的前提下，追求稳定的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、

控制，并对风险管理部和监察稽核部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	69,937,000.00	340,947,000.00
合计	69,937,000.00	340,947,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债和超短期融资券。上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	4,697,477,000.00	4,321,938,000.00
合计	4,697,477,000.00	4,321,938,000.00

注：未评级债券为政策性金融债。上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末,除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,299,158.36	-	-	-	3,299,158.36
交易性金融资产	271,902,000.00	4,328,736,000.00	166,776,000.00	-	4,767,414,000.00
应收利息	-	-	-	80,125,024.71	80,125,024.71
资产总计	275,201,158.36	4,328,736,000.00	166,776,000.00	80,125,024.71	4,850,838,183.07
负债					
卖出回购金融资产款	593,399,463.30	-	-	-	593,399,463.30
应付赎回款	-	-	-	111.63	111.63
应付管理人报酬	-	-	-	1,048,049.85	1,048,049.85
应付托管费	-	-	-	349,349.95	349,349.95
应付销售服务费	-	-	-	21.95	21.95
应付交易费用	-	-	-	44,701.89	44,701.89
应付利息	-	-	-	72,487.39	72,487.39
其他负债	-	-	-	64,733.39	64,733.39
负债总计	593,399,463.30	-	-	1,579,456.05	594,978,919.35
利率敏感度缺口	-318,198,304.94	4,328,736,000.00	166,776,000.00	78,545,568.66	4,255,859,263.72
上年度末 2018年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,576,843.68	-	-	-	11,576,843.68
交易性金融资产	340,947,000.00	4,321,938,000.00	-	-	4,662,885,000.00
买入返售金融资产	717,999,437.01	-	-	-	717,999,437.01
应收利息	-	-	-	106,879,100.68	106,879,100.68
应收申购款	-	-	-	10,914.13	10,914.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,070,523,280.69	4,321,938,000.00	-	106,890,014.81	5,499,351,295.50
负债					
卖出回购金	493,919,019.12	-	-	-	493,919,019.12

融资产款					
应付管理人报酬	-	-	-	922,084.66	922,084.66
应付托管费	-	-	-	307,361.54	307,361.54
应付销售服务费	-	-	-	221.83	221.83
应付交易费用	-	-	-	66,250.05	66,250.05
应付利息	-	-	-	266,951.32	266,951.32
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	493,919,019.12	-	-	1,622,869.40	495,541,888.52
利率敏感度缺口	576,604,261.57	4,321,938,000.00	-	105,267,145.41	5,003,809,406.98

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-25,253,724.21	-21,311,462.74
2. 市场利率下降 25 个基点	25,496,722.43	21,413,412.99	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资范围为固定收益类金融工具。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金尚成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 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二层次的余额为 4,767,414,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 4,662,885,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,767,414,000.00	98.28
	其中：债券	4,767,414,000.00	98.28
	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	3,299,158.36	0.07
8	其他各项资产	80,125,024.71	1.65
9	合计	4,850,838,183.07	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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,767,414,000.00	112.02
	其中：政策性金融债	4,767,414,000.00	112.02
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	4,767,414,000.00	112.02

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	170209	17 国开 09	5,000,000	507,000,000.00	11.91
2	180208	18 国开 08	4,900,000	498,624,000.00	11.72
3	180409	18 农发 09	4,400,000	448,976,000.00	10.55
4	190202	19 国开 02	4,100,000	408,647,000.00	9.60
5	180402	18 农发 02	3,400,000	348,806,000.00	8.20

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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

本基金不投资股票。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	80,125,024.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,125,024.71

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

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
华宝宝丰高等级债券 A	48	86,981,756.03	4,175,050,423.05	100.00%	73,866.58	0.00%
华宝宝丰高等级债券 C	42	2,457.79	100,000.00	96.87%	3,227.13	3.13%
合计	90	46,391,416.85	4,175,150,423.05	100.00%	77,093.71	0.00%

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	华宝宝丰高等级债券 A	9.11	0.0000%
	华宝宝丰高等级债券 C	0.00	0.0000%
	合计	9.11	0.0000%

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	华宝宝丰高等级债券 A	0

有本开放式基金	华宝宝丰高等级债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝宝丰高等级债券 A	0
	华宝宝丰高等级债券 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,146,695.64	0.24	10,000,000.00	0.24	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,146,695.64	0.24	10,000,000.00	0.24	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用自有资金于 2018 年 8 月 24 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝宝丰高等级 债券 A	华宝宝丰高等级 债券 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 30 日）基金份额总额	9,901,209.27	200,010.00
本报告期期初基金份额总额	4,908,752,984.40	4,307,028.30
本报告期期间基金总申购份额	1,530,962,758.67	28,697.96
减：本报告期期间基金总赎回份额	2,264,591,453.44	4,232,499.13
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	4,175,124,289.63	103,227.13

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

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

基金托管人于 2019 年 3 月 8 日发布《江苏银行股份有限公司关于资产托管部负责人信息的公告》，由柯振林先生担任江苏银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受到任何稽核和处罚。

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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：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，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；适当的区域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元无新增。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 9 日
3	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 21 日
4	关于华宝基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金新增代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 30 日
5	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金新增西南证	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 2 月 25 日

	券股份有限公司为代销机构的公告		
6	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 21 日
7	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
8	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金 2018 年度报告（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
9	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金 2018 年度报告	基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
10	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金 A 类基金份额分红公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 3 日
11	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金恢复大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 4 日
12	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 12 日
13	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019 年 4 月 12 日
14	华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
15	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
16	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 6 月 30 日

§ 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	984,444,772.59	0.00	0.00	984,444,772.59	23.58%
	2	20190101~20190506	999,899,010.09	0.00	500,000,000.00	499,899,010.09	11.97%
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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金合同；
华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝宝丰高等级债券型发起式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。

12.2 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。

12.3 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。

华宝基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日