

华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型
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	华宝新优选混合
基金主代码	004284
交易代码	004284
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 23 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	89,799,907.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>首先，本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合的久期。其次，债券投资组合的构建与调整是一个自下而上的过程，需综合评价个券收益率、波动性、到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素。同时，本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险，通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合较高的回报。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。</p>

	<p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、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>7、其他金融工具投资策略</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，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	基金管理人及基金托管人住所

§ 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	4,611,021.82
本期利润	5,481,653.43
加权平均基金份额本期利润	0.0715
本期加权平均净值利润率	6.64%
本期基金份额净值增长率	6.99%
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	9,231,327.22
期末可供分配基金份额利润	0.1028
期末基金资产净值	99,642,831.35
期末基金份额净值	1.1096
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	10.96%

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、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、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。

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	1.88%	0.31%	2.92%	0.59%	-1.04%	-0.28%
过去三个月	1.72%	0.20%	-0.06%	0.77%	1.78%	-0.57%
过去六个月	6.99%	0.27%	14.27%	0.78%	-7.28%	-0.51%
过去一年	8.10%	0.29%	7.61%	0.76%	0.49%	-0.47%
自基金合同生效日起至 今	10.96%	0.26%	10.73%	0.61%	0.23%	-0.35%

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变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准历史走势对比图



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 2017 年 9 月 23 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		
光磊	本基金基金经理、华宝品质生活股票、	2018 年 8 月 24 日	-	12 年	浙江大学生物信息学硕士。曾在汇添富基金管理有限公司任投资研究部高级行业分析师。2012 年 10 月加入华宝基金管理有限

	华宝医药生物混合、华宝大健康混合、华宝消费升级混合基金经理				公司，担任基金经理助理。2015年4月起任华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理，2016年9月起任华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金经理，2018年8月起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。2019年3月起任华宝大健康混合型证券投资基金基金经理。2019年6月起任华宝消费升级混合型证券投资基金基金经理。
汤慧	本基金基金经理助理、华宝品质生活股票、基金经理助理	2018年8月27日	-	8年	硕士。曾在海通证券研究所任高级策略分析师。2015年6月加入华宝基金管理有限公司，担任高级分析师、基金经理助理职务。2018年8月起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助理，2018年11月起任华宝品质生活股票型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、《华宝新优选一年定期开放灵活配置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 年上半年的市场以 4 月为分水岭，前后两段差异极大。一季度在稳增长预期和金融数据改善的提振作用下，权益市场出现大幅度反弹。与之前几次稳增长预期下的市场触底反弹有所不同的是，受 MSCI 纳入规模大比例提升的预期，1 月北上资金提前买入了部分盈利质量较高、预期纳入 MSCI 范围的公司，从而带动了市场企稳见底。随后 2 月以券商、TMT 成长股等行业快速反弹，并叠加众多主题性质的投资，权益市场在一季度表现较为活跃，大小股票均有较好的表现。而在二季度市场出现调整，上证指数出现了超过 10% 的最大回撤，中小板指、创业板指的最大回撤超过了 20%，大部分股票出现了较大幅度调整，而另一方面，市场的交易和持仓却在少数高 ROE 的优质公司上得到了进一步集中，市场风格分化严重。

本基金以股债平衡策略为主要投资策略。基于资产配置策略，在 2019 年 1 月下旬开始提高权益仓位，并从 4 月起严格控制了权益仓位，直至 5 月末开始逐渐加仓，基本规避了市场的回撤。

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 6.99%，业绩比较基准收益率为 14.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2019 年下半年经济增速总体不改增长趋势，但在各种外部环境的不确定性下也可能面临一定波折。经过一季度的上涨和第二季度的回撤，证券市场目前可预期的收益率在各类资产的比较中，具有较好的性价比，因此我们对市场未来的走势并不悲观。另一方面，随着外资流入和市场的不断成熟，优质公司的吸引力会持续提升，股票价格走势分化和优胜劣汰将成为证券市场的长期趋势。我们将在运用资产配置策略的同时，坚持投资优质公司，在争取收益的同时尽量规避风险。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝新优选一年定期开放灵活配置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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	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		2,411,682.43	23,539,981.36
结算备付金		2,273,854.36	934,800.35
存出保证金		26,606.05	27,616.84
交易性金融资产		59,271,824.12	19,442,000.00
其中：股票投资		27,025,824.12	-
基金投资		-	-
债券投资		32,246,000.00	19,442,000.00
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		37,500,000.00	29,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		633,374.13	273,959.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		102,117,341.09	73,218,358.19
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,994,319.98	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,439.26	43,236.23
应付托管费		12,094.14	9,264.91
应付销售服务费		20,156.90	15,441.50
应付交易费用		336,917.11	307,495.48

应交税费		25.80	0.05
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		54,556.55	80,000.00
负债合计		2,474,509.74	455,438.17
所有者权益：			
实收基金		89,799,907.40	70,160,222.97
未分配利润		9,842,923.95	2,602,697.05
所有者权益合计		99,642,831.35	72,762,920.02
负债和所有者权益总计		102,117,341.09	73,218,358.19

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1096 元，基金份额总额 89,799,907.40 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

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	附注号	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		6,383,676.87	4,305,201.15
1.利息收入		954,926.92	7,631,182.71
其中：存款利息收入		68,757.93	2,731,991.38
债券利息收入		566,575.10	4,720,075.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		319,593.89	179,115.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,558,117.84	5,912,648.29
其中：股票投资收益		4,528,254.03	4,676,718.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-136,809.59	980,402.78
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		166,673.40	255,527.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		870,631.61	-9,238,725.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		0.50	95.36
减：二、费用		902,023.44	3,380,965.37

1. 管理人报酬		286,220.91	1,134,755.29
2. 托管费		61,333.11	243,161.82
3. 销售服务费		102,221.77	405,269.84
4. 交易费用		376,850.82	351,883.27
5. 利息支出		-	1,172,354.84
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,172,354.84
6. 税金及附加		2.81	10,191.88
7. 其他费用		75,394.02	63,348.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,481,653.43	924,235.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,481,653.43	924,235.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

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）	70,160,222.97	2,602,697.05	72,762,920.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,481,653.43	5,481,653.43
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）	19,639,684.43	1,758,573.47	21,398,257.90
其中：1.基金申购款	55,575,171.41	4,982,928.59	60,558,100.00
2.基金赎回款	-35,935,486.98	-3,224,355.12	-39,159,842.10
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	89,799,907.40	9,842,923.95	99,642,831.35

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
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	555,793,675.19	19,664,659.58	575,458,334.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	924,235.78	924,235.78
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)	-485,633,452.22	-18,732,292.72	-504,365,744.94
其中：1.基金申购款	35,370.69	1,350.31	36,721.00
2.基金赎回款	-485,668,822.91	-18,733,643.03	-504,402,465.94
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)	70,160,222.97	1,856,602.64	72,016,825.61

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：

 黄小慧 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

华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（原名华宝兴业新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝基金管理有限公司（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》、《华宝兴业新优选一年定期开放灵活配置混合型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[2016]2809 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限

为不定期，首次设立募集基金份额为 555,793,675.19 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(17)第 00041 号的验资报告。基金合同于 2017 年 3 月 23 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》，华宝兴业新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新优选一年定期开放灵活配置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》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、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(但须符合中国证监会相关规定)。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：封闭期内，本基金投资于股票的比例为基金资产净值的 0-100%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，本基金投资于股票的比例为基金资产净值的 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%。

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 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 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	286,220.91	1,134,755.29
其中：支付销售机构的客户维护费	126,601.97	677,414.13

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 0.7% 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 × 0.7% / 当年天数。

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	61,333.11	243,161.82

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	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
中国银行	74,760.29
华宝基金	26,698.12
合计	101,458.41
获得销售服务费各关联方名称	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
中国银行	401,905.72
华宝基金	1,526.56
合计	403,432.28

注：支付基金销售机构的销售服务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 = 前一日基金份额基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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	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
基金合同生效日（2017年3月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	500,000.00	500,000.00
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	500,000.00	500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5600%	0.7100%

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,411,682.43	56,598.82	1,890,889.35	35,830.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 27,025,824.12 元，第二层次的余额为人民币 32,246,000.00 元，无属于第三层次的余额(于上年度末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 19,442,000.00 元，无属于第一层级或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(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	27,025,824.12	26.47
	其中：股票	27,025,824.12	26.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,246,000.00	31.58
	其中：债券	32,246,000.00	31.58
	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	37,500,000.00	36.72
	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	4,685,536.79	4.59
8	其他各项资产	659,980.18	0.65
9	合计	102,117,341.09	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	4,230,658.00	4.25
C	制造业	14,089,310.70	14.14
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	2,690,080.00	2.70
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	1,052,681.42	1.06
J	金融业	1,021,320.00	1.02
K	房地产业	3,941,774.00	3.96
L	租赁和商务服务业	-	-
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	27,025,824.12	27.12

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	603711	香飘飘	116,000	3,940,520.00	3.95
2	002737	葵花药业	176,500	2,716,335.00	2.73
3	603883	老百姓	46,000	2,690,080.00	2.70
4	600547	山东黄金	51,500	2,120,255.00	2.13
5	000002	万科 A	75,800	2,107,998.00	2.12
6	000402	金融街	233,900	1,833,776.00	1.84
7	603960	克来机电	65,680	1,792,407.20	1.80
8	000661	长春高新	4,000	1,352,000.00	1.36
9	600028	中国石化	193,300	1,057,351.00	1.06
10	601288	农业银行	283,700	1,021,320.00	1.02

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	600547	山东黄金	7,726,222.00	10.62
2	002737	葵花药业	5,725,661.00	7.87
3	603711	香飘飘	4,717,066.00	6.48
4	000002	万科 A	4,224,216.00	5.81
5	601669	中国电建	3,582,009.00	4.92
6	601288	农业银行	3,514,091.00	4.83
7	601398	工商银行	3,506,627.00	4.82
8	300532	今天国际	3,331,381.80	4.58
9	603960	克来机电	3,101,202.20	4.26
10	002851	麦格米特	2,961,798.44	4.07
11	603883	老百姓	2,788,383.00	3.83
12	000776	广发证券	2,677,843.00	3.68
13	300197	铁汉生态	2,531,877.05	3.48
14	600498	烽火通信	2,219,656.07	3.05
15	300724	捷佳伟创	2,077,945.00	2.86
16	000063	中兴通讯	2,003,293.00	2.75
17	600489	中金黄金	1,899,703.00	2.61
18	002821	凯莱英	1,873,430.00	2.57
19	000402	金融街	1,786,029.90	2.45
20	600340	华夏幸福	1,785,653.91	2.45
21	000429	粤高速 A	1,771,145.00	2.43
22	000975	银泰资源	1,646,063.00	2.26
23	601009	南京银行	1,645,780.00	2.26
24	600760	中航沈飞	1,612,783.00	2.22
25	601328	交通银行	1,562,622.00	2.15
26	300498	温氏股份	1,562,098.00	2.15
27	601377	兴业证券	1,539,883.00	2.12
28	000661	长春高新	1,506,957.00	2.07
29	000425	徐工机械	1,460,267.00	2.01

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	600547	山东黄金	5,939,072.00	8.16
2	601669	中国电建	3,587,966.00	4.93
3	601398	工商银行	3,565,352.00	4.90
4	002737	葵花药业	3,503,790.46	4.82
5	300532	今天国际	3,434,447.96	4.72
6	000776	广发证券	2,814,333.00	3.87
7	300197	铁汉生态	2,644,936.60	3.64
8	601288	农业银行	2,473,538.00	3.40
9	000002	万科 A	2,225,539.00	3.06
10	600498	烽火通信	2,164,582.00	2.97
11	601377	兴业证券	2,127,870.00	2.92
12	000063	中兴通讯	2,089,951.00	2.87
13	002821	凯莱英	2,014,793.00	2.77
14	300724	捷佳伟创	1,986,088.00	2.73
15	600340	华夏幸福	1,982,668.30	2.72
16	002851	麦格米特	1,873,925.25	2.58
17	000429	粤高速 A	1,693,406.02	2.33
18	600760	中航沈飞	1,643,389.00	2.26
19	603960	克来机电	1,622,958.45	2.23
20	002609	捷顺科技	1,602,536.48	2.20
21	601009	南京银行	1,580,212.96	2.17
22	300498	温氏股份	1,577,947.00	2.17
23	002155	湖南黄金	1,562,231.02	2.15
24	600489	中金黄金	1,561,358.00	2.15
25	601328	交通银行	1,560,355.00	2.14
26	000425	徐工机械	1,505,761.00	2.07
27	600990	四创电子	1,470,056.00	2.02
28	300129	泰胜风能	1,459,399.00	2.01

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	139,078,798.75
卖出股票收入（成交）总额	117,420,483.46

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,032,000.00	10.07
	其中：政策性金融债	10,032,000.00	10.07
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）	2,800,000.00	2.81
8	同业存单	19,414,000.00	19.48
9	其他	-	-
10	合计	32,246,000.00	32.36

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	190210	19 国开 10	100,000	10,032,000.00	10.07
2	111809316	18 浦发银行 CD316	100,000	9,751,000.00	9.79
3	111812174	18 北京银行 CD174	100,000	9,663,000.00	9.70
4	132018	G 三峡 EB1	28,000	2,800,000.00	2.81

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

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。

7.12.2 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	26,606.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	633,374.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	659,980.18

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
566	158,657.08	5,090,946.65	5.67%	84,708,960.75	94.33%

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	5,604.33	0.0062%

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	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月23日）基金份额总额	555,793,675.19
本报告期期初基金份额总额	70,160,222.97
本报告期期间基金总申购份额	55,575,171.41
减：本报告期期间基金总赎回份额	35,935,486.98
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	89,799,907.40

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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(2017 年 3 月 23 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、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	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
海通证券	2	27,152,202.60	10.59%	24,918.08	10.56%	-
国元证券	2	23,236,864.90	9.06%	21,416.63	9.07%	-
华创证券	2	22,838,088.56	8.90%	20,983.17	8.89%	-
中泰证券	1	20,843,364.00	8.13%	19,411.76	8.23%	-
方正证券	1	19,935,023.43	7.77%	18,166.12	7.70%	-
安信证券	2	19,879,047.76	7.75%	18,115.76	7.68%	-
申万宏源	2	18,056,528.50	7.04%	16,816.26	7.13%	-
广发证券	2	15,487,110.52	6.04%	14,113.35	5.98%	-
国金证券	2	14,680,055.65	5.72%	13,377.87	5.67%	-
天风证券	2	13,100,333.15	5.11%	11,938.21	5.06%	-
浙商证券	2	12,960,725.20	5.05%	11,968.65	5.07%	-
国泰君安	1	8,498,963.78	3.31%	7,914.88	3.35%	-
中信建投	1	7,514,170.00	2.93%	6,998.06	2.97%	-
长江证券	1	6,659,035.00	2.60%	6,201.20	2.63%	-
西藏东方财富	2	6,471,280.96	2.52%	5,988.07	2.54%	-
中金国际	2	5,441,570.91	2.12%	5,067.83	2.15%	-
光大证券	1	3,867,003.90	1.51%	3,523.99	1.49%	-
中银国际	2	3,095,403.00	1.21%	2,820.82	1.20%	-
华金证券	1	2,413,797.00	0.94%	2,248.04	0.95%	-
新时代证券	2	1,938,280.39	0.76%	1,766.37	0.75%	-
宏信证券	2	891,919.00	0.35%	812.78	0.34%	-
兴业证券	2	823,788.00	0.32%	767.17	0.33%	-
国信证券	1	714,726.00	0.28%	665.67	0.28%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信金通	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、本报告期租用的证券公司交易单元无新增。

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

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
海通证券	1,238,094.94	23.30%	234,700,000.00	18.80%	-	-
国元证券	-	-	122,300,000.00	9.79%	-	-
华创证券	2,787,783.19	52.45%	120,600,000.00	9.66%	-	-
中泰证券	34,573.80	0.65%	99,700,000.00	7.98%	-	-
方正证券	-	-	128,800,000.00	10.31%	-	-
安信证券	1,254,209.58	23.60%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	24,800,000.00	1.99%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	35,400,000.00	2.83%	-	-
中信建投	-	-	148,400,000.00	11.88%	-	-
长江证券	-	-	43,400,000.00	3.48%	-	-
西藏东方财富	-	-	202,800,000.00	16.24%	-	-
中金国际	-	-	33,400,000.00	2.67%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	31,000,000.00	2.48%	-	-

新时代证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	16,500,000.00	1.32%	-	-
国信证券	-	-	6,900,000.00	0.55%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-

§ 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
个人	1	20190425~20190630	0.00	27,522,935.77	0.00	27,522,935.77	30.65%
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

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