

华宝服务优选混合型证券投资基金 2018 年半年度报告（摘要）

2018 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：2018 年 8 月 24 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 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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 2018 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	华宝服务优选混合
基金主代码	000124
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 27 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	632,701,808.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握服务相关行业的稳步成长，力争在长期内为基金
------	-------------------------

	份额持有人获取超额回报。
投资策略	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。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享服务业快速发展所带来的行业高回报。本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、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久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国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	tianqingl.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	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。
-------------	----------------------------------

§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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-28,030,320.67
本期利润	-53,061,660.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0814
本期基金份额净值增长率	-4.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.3308
期末基金资产净值	1,082,168,507.12
期末基金份额净值	1.710

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

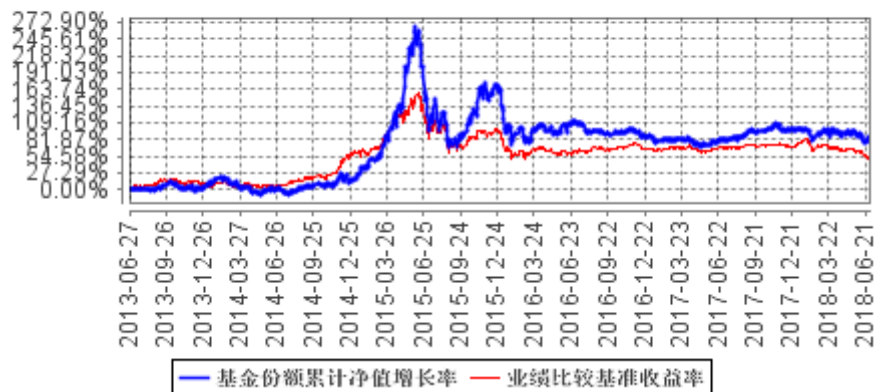
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.34%	2.10%	-6.66%	1.03%	4.32%	1.07%
过去三个月	-5.79%	1.57%	-10.28%	0.87%	4.49%	0.70%
过去六个月	-4.74%	1.50%	-10.87%	0.91%	6.13%	0.59%
过去一年	2.70%	1.23%	-9.93%	0.73%	12.63%	0.50%
过去三年	-27.82%	1.90%	-30.49%	1.24%	2.67%	0.66%
自基金合同生效日起至 今	87.12%	1.94%	52.06%	1.25%	35.06%	0.69%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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

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:按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六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 2013 年 12 月 27 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（2018 年 6 月 30 日），所管理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、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接基金、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、华宝宝鑫纯债基金、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、华宝新优享基金、华宝银行 ETF、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，所管理的证券投资基金资产净值合计 153,280,039,194.92 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		
楼鸿强	本基金基金经理、华宝万物互联混合基金经理	2014 年 10 月 22 日	-	9 年	硕士。曾在兴业证券研究所从事行业分析工作。2011 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理的职务。2014 年 10 月起担任华宝服务优选混合型证券

					投资基金基金经理， 2015 年 6 月兼任华宝万 物互联灵活配置混合型证 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、《华宝服务优选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2018 年上半年，市场整体波动较大，个股跌多涨少。年初以金融地产为代表的低估值蓝筹先扬后抑，周期类板块也整体走弱。相比较而言，消费和医药等行业板块表现较好，部分新兴行业成长股龙头也走出较为独立的行情。

本基金在 1 季度市场大幅波动的过程中，表现一般。2 季度以来，整体保持中性偏低的仓位，持仓集中于医药、科技、消费等少数中长期逻辑清晰且竞争力突出的龙头公司，收益率表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-4.74%，同期业绩比较基准收益率为-10.87%，基金表现领先比较基准 6.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内宏观经济依然有韧性，但不确定因素有所增加。全社会经济要素和杠杆率并未实现较为健康的调整，经济转型和效率提升仍是一个中长期过程。此外，随着全球化进程的基本完成，全球经济金融的联动程度不断提高。较为复杂的国内外经济形势，有可能制约国内经济转型的进程和相关政策的空间。

整体上，市场在经历几次调整后，整体风险已低于几年前相对疯狂的时期，具备结构性行情的基础。在目前的宏观经济和相关政策的背景下，权益类资产具备一定的大类资产相对优势，整体上并不悲观。经过 2 年多的调整，新兴行业个股估值逐步消化，业绩和估值匹配程度有所改善。传统行业经过 1 年多的改善，边际效应逐步递减，投资机会需要精选。虽然市场整体上仍难有趋势性的大机会，但结构性行情和投资机会正在增加。

中长期来看，相信在全社会的共同努力下，中国经济转型的前景值得看好，也必将诞生一批优秀的公司。行情结构分化仍是市场主线，真正优质的行业和公司将为投资者创造中长期的投资价值。

我们会继续以如履薄冰、如临深渊的谨慎态度和勤勉尽职的工作来回报投资者的支持与信任。

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其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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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：华宝服务优选混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	156,605,177.88	296,972,300.45
结算备付金	2,575,915.75	7,125,194.47
存出保证金	885,870.60	767,974.95
交易性金融资产	930,116,969.64	979,493,905.10
其中：股票投资	930,116,969.64	979,493,905.10
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	31,758.07	68,773.49
应收股利	-	-
应收申购款	6,235,747.00	403,504.04
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,096,451,438.94	1,284,831,652.50
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018 年 6 月 30 日	2017 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	4,428,325.57	12,565,204.80
应付赎回款	885,626.58	1,306,984.74
应付管理人报酬	1,314,508.30	1,628,299.33
应付托管费	219,084.69	271,383.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,274,893.09	8,818,154.93

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,493.59	281,489.06
负债合计	14,282,931.82	24,871,516.09
所有者权益：		
实收基金	632,701,808.59	702,108,564.42
未分配利润	449,466,698.53	557,851,571.99
所有者权益合计	1,082,168,507.12	1,259,960,136.41
负债和所有者权益总计	1,096,451,438.94	1,284,831,652.50

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.710 元，基金份额总额 632,701,808.59 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝服务优选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	-32,719,800.49	-3,265,465.57
1.利息收入	906,354.50	1,761,876.25
其中：存款利息收入	872,876.71	1,612,339.21
债券利息收入	-	298.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	33,477.79	149,238.41
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,643,842.32	-125,758,132.41
其中：股票投资收益	-12,866,586.84	-130,751,124.10
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	84,830.27
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	4,222,744.52	4,908,161.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-25,031,339.80	120,137,506.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	49,027.13	593,283.92
减：二、费用	20,341,859.98	29,769,057.36
1. 管理人报酬	8,516,282.33	11,241,480.77
2. 托管费	1,419,380.43	1,873,580.16
3. 销售服务费		
4. 交易费用	10,217,330.93	16,445,356.82
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	188,866.29	208,639.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-53,061,660.47	-33,034,522.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-53,061,660.47	-33,034,522.93

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝服务优选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	702,108,564.42	557,851,571.99	1,259,960,136.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-53,061,660.47	-53,061,660.47
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）	-69,406,755.83	-55,323,212.99	-124,729,968.82
其中：1.基金申购款	21,623,865.70	15,891,042.96	37,514,908.66
2. 基金赎回款	-91,030,621.53	-71,214,255.95	-162,244,877.48
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）	632,701,808.59	449,466,698.53	1,082,168,507.12
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	1,026,904,452.09	716,472,059.30	1,743,376,511.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,034,522.93	-33,034,522.93
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）	-182,101,460.00	-121,444,782.97	-303,546,242.97
其中：1.基金申购款	31,075,485.88	19,931,532.79	51,007,018.67
2.基金赎回款	-213,176,945.88	-141,376,315.76	-354,553,261.64
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）	844,802,992.09	561,992,753.40	1,406,795,745.49

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

华宝服务优选混合型证券投资基金(原名为华宝兴业服务优选股票型证券投资基金、华宝兴业服务优选混合型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 306 号《关于核准华宝兴业服务优选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月

17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝服务优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,448,794,551.05 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 395 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,449,066,584.71 份基金份额，其中认购资金利息折合 272,033.66 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业服务优选混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝服务优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝服务优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于服务相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金资产支持证券投资市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金权证投资市值不得超过基金资产净值的 3%；其余资产投资于现金、货币市场工具、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证服务业指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率。

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》、《华宝服务优选混合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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 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的说明

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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：

(a) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 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、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

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。

6.4.8.1 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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,516,282.33	11,241,480.77
其中：支付销售机构的客户维护费	3,667,368.85	4,799,998.65

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 1.50% 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 × 1.50% / 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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,419,380.43		1,873,580.16	

注：支付基金托管人 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 × 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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
期初持有的基金份额	327,192.00		327,192.00	
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	327,192.00		327,192.00	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0500%		0.0400%	

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除基金管理人以外的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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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	156,605,177.88	811,855.17	353,936,492.33	1,533,846.66
--------	----------------	------------	----------------	--------------

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（2018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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603939	益丰药房	2018年4月17日	重大事项停牌	53.07	2018年7月16日	65.69	501,500	24,153,185.00	26,614,605.00	-
603636	南威软件	2018年5月29日	重大事项停牌	8.79	-	-	1,992,976	23,737,442.04	17,518,259.04	-

注：本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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) 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 2018 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 885,984,105.60 元，属于第二层次的余额为 44,132,864.04 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 890,480,964.58 元，第二层次 89,012,940.52 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 2018 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(201 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	930,116,969.64	84.83
	其中：股票	930,116,969.64	84.83
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	159,181,093.63	14.52
7	其他各项资产	7,153,375.67	0.65
8	合计	1,096,451,438.94	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	494,815,477.38	45.72
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	116,013,630.80	10.72
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	102,814,055.50	9.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	23,406,293.37	2.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	781,325.52	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	112,469,959.09	10.39
R	文化、体育和娱乐业	79,816,227.98	7.38
S	综合	-	-
	合计	930,116,969.64	85.95

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	000977	浪潮信息	2,648,741	63,172,472.85	5.84
2	300347	泰格医药	932,000	57,662,840.00	5.33
3	603019	中科曙光	727,958	33,391,433.46	3.09
4	002371	北方华创	657,988	32,682,263.96	3.02
5	600763	通策医疗	670,440	32,630,314.80	3.02
6	600271	航天信息	1,286,817	32,517,865.59	3.00
7	000681	视觉中国	1,089,022	31,254,931.40	2.89
8	300413	快乐购	779,214	29,563,379.16	2.73
9	603103	横店影视	869,639	26,715,310.08	2.47
10	603939	益丰药房	501,500	26,614,605.00	2.46

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	000977	浪潮信息	72,495,621.92	5.75
2	002027	分众传媒	71,367,341.43	5.66
3	300271	华宇软件	68,520,684.86	5.44
4	601111	中国国航	65,393,086.65	5.19
5	600115	东方航空	62,501,840.35	4.96
6	300113	顺网科技	61,435,229.66	4.88
7	600782	新钢股份	59,443,681.18	4.72
8	603799	华友钴业	58,857,116.69	4.67
9	600521	华海药业	58,203,129.22	4.62
10	000858	五粮液	55,960,410.90	4.44
11	600585	海螺水泥	55,119,829.05	4.37
12	600029	南方航空	54,660,825.66	4.34
13	601288	农业银行	54,273,964.25	4.31
14	600276	恒瑞医药	54,186,287.75	4.30
15	000513	丽珠集团	53,962,312.12	4.28
16	300347	泰格医药	51,374,563.64	4.08
17	601628	中国人寿	48,840,781.24	3.88
18	000333	美的集团	48,089,035.68	3.82
19	600703	三安光电	48,015,610.36	3.81
20	002373	千方科技	45,531,430.50	3.61
21	603019	中科曙光	44,887,019.94	3.56
22	002127	南极电商	43,436,985.23	3.45
23	603103	横店影视	43,150,699.99	3.42
24	600887	伊利股份	42,797,198.90	3.40
25	600507	方大特钢	42,321,686.63	3.36
26	601318	中国平安	42,305,424.01	3.36
27	000681	视觉中国	42,218,353.24	3.35
28	601636	旗滨集团	40,861,573.30	3.24
29	300413	快乐购	40,638,635.05	3.23
30	600763	通策医疗	39,971,137.74	3.17
31	300078	思创医惠	37,754,095.74	3.00
32	300251	光线传媒	36,804,787.26	2.92
33	300015	爱尔眼科	36,323,585.97	2.88
34	002008	大族激光	34,427,358.20	2.73

35	601998	中信银行	33,912,236.88	2.69
36	601009	南京银行	33,513,477.88	2.66
37	002905	金逸影视	32,816,297.82	2.60
38	600271	航天信息	32,750,978.82	2.60
39	300409	道氏技术	32,257,172.07	2.56
40	600340	华夏幸福	30,898,206.27	2.45
41	601988	中国银行	30,513,025.00	2.42
42	000651	格力电器	30,461,107.64	2.42
43	603233	大参林	30,413,803.00	2.41
44	000066	中国长城	30,337,626.85	2.41
45	000063	中兴通讯	30,028,814.00	2.38
46	002371	北方华创	28,569,104.40	2.27
47	300496	中科创达	28,285,588.57	2.24
48	300618	寒锐钴业	28,253,994.06	2.24
49	300418	昆仑万维	28,171,246.20	2.24
50	600525	长园集团	27,636,714.30	2.19
51	300101	振芯科技	27,417,456.75	2.18
52	600196	复星医药	27,019,846.10	2.14
53	603127	昭衍新药	26,624,203.00	2.11
54	002343	慈文传媒	25,497,959.98	2.02

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	600521	华海药业	95,866,732.14	7.61
2	601318	中国平安	94,775,459.59	7.52
3	000858	五粮液	89,678,415.75	7.12
4	600029	南方航空	83,790,665.97	6.65
5	300271	华宇软件	81,122,699.88	6.44
6	601111	中国国航	77,503,488.43	6.15
7	600703	三安光电	74,083,685.62	5.88
8	601628	中国人寿	70,237,389.33	5.57
9	600887	伊利股份	62,995,346.53	5.00
10	002027	分众传媒	62,626,778.36	4.97

11	600196	复星医药	62,617,596.42	4.97
12	000513	丽珠集团	62,166,072.35	4.93
13	300113	顺网科技	60,729,128.23	4.82
14	600115	东方航空	58,607,465.02	4.65
15	600782	新钢股份	58,422,754.83	4.64
16	600585	海螺水泥	55,239,137.84	4.38
17	600036	招商银行	54,546,102.70	4.33
18	600519	贵州茅台	53,022,975.90	4.21
19	601288	农业银行	51,176,940.00	4.06
20	000596	古井贡酒	48,616,566.89	3.86
21	000063	中兴通讯	48,525,062.16	3.85
22	000333	美的集团	45,398,947.14	3.60
23	000001	平安银行	43,975,939.67	3.49
24	300383	光环新网	42,714,626.85	3.39
25	600507	方大特钢	42,625,514.36	3.38
26	600276	恒瑞医药	40,038,136.27	3.18
27	300078	思创医惠	39,946,226.75	3.17
28	603799	华友钴业	39,824,133.72	3.16
29	601636	旗滨集团	39,106,759.54	3.10
30	300059	东方财富	38,957,540.89	3.09
31	600388	龙净环保	35,017,998.52	2.78
32	300409	道氏技术	33,961,157.10	2.70
33	601233	桐昆股份	33,161,406.45	2.63
34	601998	中信银行	32,969,292.89	2.62
35	300251	光线传媒	32,911,190.20	2.61
36	601009	南京银行	32,267,706.69	2.56
37	600340	华夏幸福	31,882,160.46	2.53
38	002008	大族激光	31,537,833.44	2.50
39	300316	晶盛机电	31,380,635.57	2.49
40	600346	恒力股份	30,249,443.17	2.40
41	002146	荣盛发展	30,181,404.93	2.40
42	002373	千方科技	29,571,908.90	2.35
43	300418	昆仑万维	28,862,507.06	2.29
44	600525	长园集团	28,401,393.32	2.25
45	000651	格力电器	28,293,687.72	2.25
46	601988	中国银行	27,937,306.00	2.22
47	002773	康弘药业	27,108,637.84	2.15
48	300188	美亚柏科	26,255,069.70	2.08

49	603127	昭衍新药	25,562,541.30	2.03
50	300203	聚光科技	25,486,591.29	2.02
51	600183	生益科技	25,441,763.82	2.02

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	3,397,882,739.66
卖出股票收入（成交）总额	3,409,361,748.48

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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	885,870.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,758.07
5	应收申购款	6,235,747.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,153,375.67

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603939	益丰药房	26,614,605.00	2.46	重大事项停牌

§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
76,199	8,303.28	585,656.71	0.09%	632,116,151.88	99.91%

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	350,306.42	0.0554%

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（2013年6月27日）基金份额总额	1,449,066,584.71
本报告期期初基金份额总额	702,108,564.42
本报告期基金总申购份额	21,623,865.70
减：本报告期基金总赎回份额	91,030,621.53
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	632,701,808.59

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

2018 年 4 月 11 日, 经公司董事会审议通过, 聘任李慧勇为公司副总经理。该事项经中国证券投资基金业协会备案, 并在指定媒体上披露。

2、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

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 (2013 年 6 月 27 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	1,274,071,843.02	18.72%	1,161,061.10	18.71%	-
国泰君安	2	791,204,646.92	11.62%	736,851.05	11.88%	-
中信建投	2	773,259,153.00	11.36%	720,134.89	11.61%	-
中信证券	1	521,847,663.52	7.67%	485,994.69	7.83%	-
西部证券	1	420,775,972.82	6.18%	307,715.76	4.96%	-
兴业证券	2	396,745,114.58	5.83%	369,487.09	5.96%	-
国信证券	1	385,975,499.92	5.67%	359,459.37	5.79%	-
东吴证券	2	367,693,445.41	5.40%	335,801.49	5.41%	-
西藏东方财富	1	361,004,051.20	5.30%	328,983.34	5.30%	-
长江证券	1	333,128,888.53	4.89%	310,242.54	5.00%	-
东北证券	2	276,318,751.17	4.06%	257,334.59	4.15%	-
华创证券	1	198,987,362.51	2.92%	181,337.65	2.92%	-
上海证券	1	145,124,670.08	2.13%	132,251.45	2.13%	-
方正证券	1	144,017,575.66	2.12%	134,122.56	2.16%	-
华泰证券	1	138,067,975.78	2.03%	128,582.42	2.07%	-
东方证券	1	105,514,882.56	1.55%	96,155.98	1.55%	-
民生证券	1	68,661,358.68	1.01%	62,571.43	1.01%	-
海通证券	2	37,428,256.92	0.55%	34,108.19	0.55%	-
中金国际	1	36,312,688.44	0.53%	33,817.90	0.55%	-
浙商证券	1	30,860,046.93	0.45%	28,122.61	0.45%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	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： 资质雄厚，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新增：长城证券、国盛证券

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2018 年 3 月 28 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告》，公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

华宝基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日