

# 华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                |                 |                |                 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金简称           | 华宝中证 1000 指数分级  |                |                 |
| 场内简称           | 1000 分级         |                |                 |
| 基金主代码          | 162413          |                |                 |
| 基金运作方式         | 契约型开放式          |                |                 |
| 基金合同生效日        | 2015 年 6 月 4 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     | 59,882,654.55 份 |                |                 |
| 基金合同存续期        | 不定期             |                |                 |
| 基金份额上市的证券交易所   | 深圳证券交易所         |                |                 |
| 上市日期           | 2015-06-16      |                |                 |
| 下属分级基金的基金简称    | 1000A           | 1000B          | 华宝中证 1000 指数分级  |
| 下属分级基金场内简称:    | 1000A           | 1000B          | 1000 分级         |
| 下属分级基金的交易代码    | 150263          | 150264         | 162413          |
| 报告期末下属分级基金份额总额 | 1,772,901.00 份  | 1,772,901.00 份 | 56,336,852.55 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。                                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | <p>本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p> <p>在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率 $\times$ 95% + 同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。                                                                                                                                                                                                                                              |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混                                                                                                                                                                                                                                            |

|               |                                |                                |                                                                 |
|---------------|--------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
|               | 合型基金。                          |                                |                                                                 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。 | 华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。 | 本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

## 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                    | 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、<br>021-38924558 | 010—67595096         |
| 传真      |      | 021-38505777                  | 010-66275853         |

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -3,417,472.24                          |
| 本期利润          | 8,666,753.60                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1433                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 20.83%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配基金份额利润  | -1.6924                                |
| 期末基金资产净值      | 48,316,486.63                          |
| 期末基金份额净值      | 0.8069                                 |

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

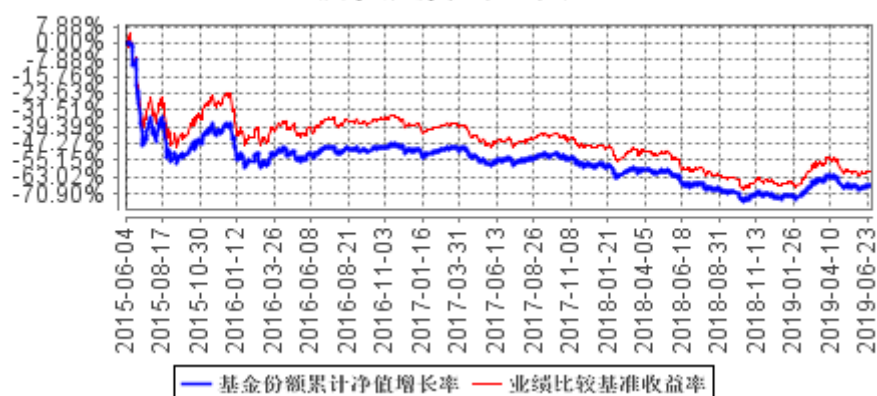
| 阶段          | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月       | 0.10%    | 1.41%       | -0.22%     | 1.45%         | 0.32%  | -0.04% |
| 过去三个月       | -8.16%   | 1.80%       | -9.45%     | 1.84%         | 1.29%  | -0.04% |
| 过去六个月       | 20.83%   | 1.76%       | 19.16%     | 1.80%         | 1.67%  | -0.04% |
| 过去一年        | -3.86%   | 1.64%       | -4.68%     | 1.67%         | 0.82%  | -0.03% |
| 过去三年        | -34.51%  | 1.30%       | -37.34%    | 1.32%         | 2.83%  | -0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | -67.36%  | 1.88%       | -60.64%    | 1.90%         | -6.72% | -0.02% |

注：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 2015 年 12 月 4 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）<br>期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                |
|-----|--------------------|---------------------|------|--------|-----------------------------------|
|     |                    | 任职日期                | 离任日期 |        |                                   |
| 丰晨成 | 本基金基金经理、<br>上证 180 | 2018 年 8 月<br>24 日  | -    | 9 年    | 硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、 |

|    |                                                                                                |                |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|---|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接基金经理                           |                |   |     | 数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2018 年 8 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。 |
| 张奇 | 本基金基金经理助理、华宝中证医疗指数分级、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝业中证军工 ETF、华宝中证银行 ETF、华宝银行 ETF 联接基金经理助理 | 2017 年 4 月 6 日 | - | 9 年 | 本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2015 年 5 月至 2018 年 11 月兼任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接                                   |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 基金基金经理助理，2017 年 4 月至 2019 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理，2017 年 4 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理助理，2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2019 年 1 月起任华宝中证银行交易型开放式指数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、《华宝基金管理有限公司华宝中证 1000 指数分级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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，中证 1000 指数分级证券投资基金在短期内出现过股票投资低于基金资产净值 90%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年在中美贸易战的不确定性及 GDP 增速下降的背景下，市场对于宏观经济的预期放低，A 股市场倒是创出了近几年少有的单季度涨幅，在上涨过程中以中证 1000 为代表的中小市值指数表现较好，尤其是二三月份，在市场热度逐渐升温的过程中，之前被忽视的小盘股明显受到资金的边际参与，走出了一波犀利的反弹行情。四月下旬开始下跌，五月跌幅趋缓并在六月份企稳反弹。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

### 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 20.83%，业绩比较基准收益率为 19.16%。

## 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，面对复杂严峻的形势，未来继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，着力

深化供给侧结构性改革，持续打好三大攻坚战，加快实施新旧动能转换应是题中之义。尽管科创板的推出可能让市场对于小盘股供给过大而压低市场估值的担心，但另一方面以中证 1000 为代表的小盘股可能受益于市场热度回升带来流动性改善。我们认为中证 1000 指数作为小盘股的基准指数，具有重要且独特的配置价值。

作为指数基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，实现对指数的有效跟踪。

#### 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**

本基金基金合同生效于 2015 年 6 月 4 日，截至 2019 年 6 月 30 日，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，基金管理人已拟定解决方案，目前已通过证监会备案，基金管理人将尽快付诸实施，并及时履行信息披露义务。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

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<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            |            | 2,897,112.69                   | 2,632,693.09                     |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | 3,125.81                       | 818.24                           |
| 交易性金融资产         |            | 45,571,341.43                  | 37,797,465.57                    |
| 其中：股票投资         |            | 45,566,453.11                  | 37,797,465.57                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 4,888.32                       | -                                |
| 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         |            | 39,644.54                      | 30,510.65                        |
| 应收利息            |            | 585.60                         | 570.91                           |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 44,733.41                      | 26,802.88                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 48,556,543.48                  | 40,488,861.34                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 16,963.69                      | 72,229.05                        |
| 应付管理人报酬         |            | 39,211.57                      | 35,633.00                        |
| 应付托管费           |            | 8,626.55                       | 7,839.26                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          |            | 56,900.95                      | 66,562.70                        |

|               |  |                |                 |
|---------------|--|----------------|-----------------|
| 应交税费          |  | -              | -               |
| 应付利息          |  | -              | -               |
| 应付利润          |  | -              | -               |
| 递延所得税负债       |  | -              | -               |
| 其他负债          |  | 118,354.09     | 120,263.75      |
| 负债合计          |  | 240,056.85     | 302,527.76      |
| <b>所有者权益：</b> |  |                |                 |
| 实收基金          |  | 148,034,289.42 | 148,771,293.31  |
| 未分配利润         |  | -99,717,802.79 | -108,584,959.73 |
| 所有者权益合计       |  | 48,316,486.63  | 40,186,333.58   |
| 负债和所有者权益总计    |  | 48,556,543.48  | 40,488,861.34   |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.8069 元，基金份额总额 59,882,654.55 份；华宝中证 1000A 份额基金份额参考净值 1.0298 元，基金份额总额 1,772,901.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额参考净值 0.5840 元，基金份额总额 1,772,901.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------------------|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      |     | 9,159,456.85                             | -11,957,286.81                                |
| 1.利息收入           |     | 12,336.16                                | 13,517.83                                     |
| 其中：存款利息收入        |     | 12,333.32                                | 13,517.83                                     |
| 债券利息收入           |     | 2.84                                     | -                                             |
| 资产支持证券利息收入       |     | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入       |     | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入           |     | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |     | -2,953,477.48                            | -6,872,184.03                                 |
| 其中：股票投资收益        |     | -3,303,910.11                            | -7,212,433.67                                 |
| 基金投资收益           |     | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益           |     | -                                        | -                                             |
| 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             |     | 350,432.63                               | 340,249.64                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以   |     | 12,084,225.84                            | -5,109,171.25                                 |

|                            |  |              |                |
|----------------------------|--|--------------|----------------|
| “-”号填列)                    |  |              |                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列)          |  | -            | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列)          |  | 16,372.33    | 10,550.64      |
| <b>减：二、费用</b>              |  | 492,703.25   | 571,017.94     |
| 1. 管理人报酬                   |  | 238,890.75   | 300,293.22     |
| 2. 托管费                     |  | 52,555.95    | 66,064.48      |
| 3. 销售服务费                   |  | -            | -              |
| 4. 交易费用                    |  | 32,545.28    | 41,042.24      |
| 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                    |  | 168,711.27   | 163,618.00     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)</b> |  | 8,666,753.60 | -12,528,304.75 |
| 减：所得税费用                    |  | -            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列)</b>   |  | 8,666,753.60 | -12,528,304.75 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

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<br>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）                   | 148,771,293.31                        | -108,584,959.73 | 40,186,333.58  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | 8,666,753.60    | 8,666,753.60   |
| 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) | -737,003.89                           | 200,403.34      | -536,600.55    |
| 其中：1.基金申购款                        | 33,759,634.83                         | -22,726,022.76  | 11,033,612.07  |
| 2. 基金赎回款                          | -34,496,638.72                        | 22,926,426.10   | -11,570,212.62 |
| 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）                        | 148,034,289.42                             | -99,717,802.79 | 48,316,486.63  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 170,411,754.42                             | -98,487,892.80 | 71,923,861.62  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -12,528,304.75 | -12,528,304.75 |
| 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）      | -24,456,710.35                             | 14,617,707.51  | -9,839,002.84  |
| 其中：1.基金申购款                             | 9,920,382.64                               | -6,037,562.36  | 3,882,820.28   |
| 2.基金赎回款                                | -34,377,092.99                             | 20,655,269.87  | -13,721,823.12 |
| 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）                        | 145,955,044.07                             | -96,398,490.04 | 49,556,554.03  |

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：

|            |           |            |
|------------|-----------|------------|
| <u>黄小慧</u> | <u>向辉</u> | <u>张幸骏</u> |
| 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

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(原名为华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金,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[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》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《华宝兴业中证 1000 指数分级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人民币 330,638,859.16 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额，其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华宝中证 1000 基础份额”)、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华宝中证 1000A 份额”)和华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华宝中证 1000B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后，华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%，华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后，根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配；持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份额的分配。经过上述份额折算后，华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算（基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日）：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝

中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 272 号文审核同意，本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数分级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(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、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；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，应保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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》、《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 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 5,000 万元情形的，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。于 2018 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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 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和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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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  | 238,890.75                            | 300,293.22                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 94,314.06                             | 127,238.30                                 |

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 1.00% 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 × 1.00% / 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 | 52,555.95                       | 66,064.48                       |

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 0.22% 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 × 0.22% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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                              |           | 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    |
| 中国建设银行 | 2,897,112.69                    | 12,126.76 | 3,301,620.70                    | 13,348.75 |

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（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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                |        |      |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 601236               | 红塔证券 | 2019 年 6 月 26 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46   | 9,789    | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

### 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 |
|--------|--------|-----------------|--------|--------|------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 000029 | 深深房 A  | 2016 年 9 月 19 日 | 重大事项停牌 | 10.97  | -    | -      | 6,200 | 81,266.58 | 68,014.00 | -  |
| 002323 | *ST 百特 | 2018 年 8 月 20 日 | 重大事项停牌 | 1.31   | -    | -      | 2,900 | 40,046.79 | 3,799.00  | -  |

注：本基金截至报告期末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 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 45,460,770.17 元，属于第二层次的余额为 110,571.26 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 37,724,412.57 元，第二层次 73,053.00 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 45,566,453.11 | 93.84         |
|    | 其中：股票             | 45,566,453.11 | 93.84         |
| 2  | 基金投资              | —             | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 4,888.32      | 0.01          |
|    | 其中：债券             | 4,888.32      | 0.01          |
|    | 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      | 2,897,112.69  | 5.97          |
| 8  | 其他各项资产            | 88,089.36     | 0.18          |
| 9  | 合计                | 48,556,543.48 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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         | 542,845.10    | 1.12          |
| B  | 采矿业              | 936,560.28    | 1.94          |
| C  | 制造业              | 27,783,850.84 | 57.50         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,228,912.10  | 2.54          |
| E  | 建筑业              | 1,249,794.95  | 2.59          |
| F  | 批发和零售业           | 1,581,376.68  | 3.27          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,007,639.56  | 2.09          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,370,660.64  | 11.12         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| J | 金融业           | 331,024.40    | 0.69  |
| K | 房地产业          | 1,804,843.01  | 3.74  |
| L | 租赁和商务服务业      | 430,965.39    | 0.89  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 837,247.26    | 1.73  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 651,355.51    | 1.35  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | 86,919.00     | 0.18  |
| Q | 卫生和社会工作       | 567,800.00    | 1.18  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 621,638.89    | 1.29  |
| S | 综合            | 298,312.20    | 0.62  |
|   | 合计            | 45,331,745.81 | 93.82 |

### 7.2.2 期末积极投资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              | 29,912.30  | 0.06         |
| C  | 制造业              | 77,595.18  | 0.16         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | 3,799.00   | 0.01         |
| 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  | 21,516.88  | 0.04         |
| J  | 金融业              | 33,869.94  | 0.07         |
| K  | 房地产业             | 68,014.00  | 0.14         |
| 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               | 234,707.30 | 0.49         |

### 7.2.3 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股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资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  | 300347 | 泰格医药 | 4,900  | 377,790.00 | 0.78         |
| 2  | 300014 | 亿纬锂能 | 5,881  | 179,135.26 | 0.37         |
| 3  | 300012 | 华测检测 | 16,100 | 173,880.00 | 0.36         |
| 4  | 600728 | 佳都科技 | 15,680 | 154,448.00 | 0.32         |
| 5  | 600635 | 大众公用 | 23,500 | 150,870.00 | 0.31         |
| 6  | 300285 | 国瓷材料 | 8,150  | 138,631.50 | 0.29         |
| 7  | 002138 | 顺络电子 | 7,800  | 137,124.00 | 0.28         |
| 8  | 600132 | 重庆啤酒 | 2,900  | 136,764.00 | 0.28         |
| 9  | 601799 | 星宇股份 | 1,700  | 134,232.00 | 0.28         |
| 10 | 600776 | 东方通信 | 5,800  | 133,284.00 | 0.28         |

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](http://www.fsfund.com) 的半年度报告正文。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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  | 000029 | 深深房 A | 6,200 | 68,014.00 | 0.14         |
| 2  | 300782 | 卓胜微   | 322   | 35,072.24 | 0.07         |
| 3  | 601236 | 红塔证券  | 9,789 | 33,869.94 | 0.07         |
| 4  | 600968 | 海油发展  | 8,426 | 29,912.30 | 0.06         |
| 5  | 603867 | 新化股份  | 940   | 24,261.40 | 0.05         |

## 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  | 300347 | 泰格医药 | 307,194.00 | 0.76           |
| 2  | 600989 | 宝丰能源 | 212,158.48 | 0.53           |
| 3  | 600635 | 大众公用 | 162,150.00 | 0.40           |
| 4  | 600776 | 东方通信 | 129,354.00 | 0.32           |
| 5  | 600601 | 方正科技 | 92,568.00  | 0.23           |
| 6  | 002123 | 梦网集团 | 92,165.00  | 0.23           |
| 7  | 000667 | 美好置业 | 84,281.00  | 0.21           |
| 8  | 600366 | 宁波韵升 | 80,640.00  | 0.20           |
| 9  | 600503 | 华丽家族 | 74,239.00  | 0.18           |
| 10 | 300401 | 花园生物 | 72,324.00  | 0.18           |
| 11 | 600736 | 苏州高新 | 71,563.00  | 0.18           |
| 12 | 600936 | 广西广电 | 67,450.00  | 0.17           |
| 13 | 002063 | 远光软件 | 66,779.00  | 0.17           |
| 14 | 600850 | 华东电脑 | 66,318.00  | 0.17           |
| 15 | 601519 | 大智慧  | 64,602.00  | 0.16           |
| 16 | 002400 | 省广集团 | 63,812.00  | 0.16           |
| 17 | 600284 | 浦东建设 | 63,450.00  | 0.16           |
| 18 | 603658 | 安图生物 | 62,761.00  | 0.16           |
| 19 | 600761 | 安徽合力 | 61,711.00  | 0.15           |
| 20 | 600483 | 福能股份 | 61,453.00  | 0.15           |

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  | 000977 | 浪潮信息 | 319,410.00 | 0.79           |
| 2  | 002157 | 正邦科技 | 287,704.00 | 0.72           |
| 3  | 600989 | 宝丰能源 | 240,013.82 | 0.60           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 4  | 600763 | 通策医疗 | 218,981.00 | 0.54 |
| 5  | 300601 | 康泰生物 | 217,956.45 | 0.54 |
| 6  | 002821 | 凯莱英  | 196,873.40 | 0.49 |
| 7  | 600745 | 闻泰科技 | 183,903.00 | 0.46 |
| 8  | 300009 | 安科生物 | 143,870.04 | 0.36 |
| 9  | 600486 | 扬农化工 | 139,861.00 | 0.35 |
| 10 | 300207 | 欣旺达  | 127,673.00 | 0.32 |
| 11 | 603939 | 益丰药房 | 121,707.00 | 0.30 |
| 12 | 600845 | 宝信软件 | 116,359.00 | 0.29 |
| 13 | 000883 | 湖北能源 | 116,217.00 | 0.29 |
| 14 | 002958 | 青农商行 | 111,694.08 | 0.28 |
| 15 | 603517 | 绝味食品 | 109,519.80 | 0.27 |
| 16 | 002812 | 恩捷股份 | 100,688.00 | 0.25 |
| 17 | 000301 | 东方盛虹 | 95,259.00  | 0.24 |
| 18 | 002419 | 天虹股份 | 86,026.00  | 0.21 |
| 19 | 300759 | 康龙化成 | 72,533.69  | 0.18 |
| 20 | 002387 | 维信诺  | 72,356.00  | 0.18 |

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 | 10,417,300.83 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 11,428,540.70 |

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      | -        | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -        | -            |
| 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） | 4,888.32 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -        | -            |

|    |    |          |      |
|----|----|----------|------|
| 9  | 其他 | -        | -    |
| 10 | 合计 | 4,888.32 | 0.01 |

## 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  | 128062 | 亚药转债 | 48    | 4,888.32 | 0.01         |

## 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   | 3,125.81  |
| 2  | 应收证券清算款 | 39,644.54 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 585.60    |
| 5  | 应收申购款   | 44,733.41 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 88,089.36 |

**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****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五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<br>净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|-------|-------------|------------------|----------|
| 1  | 000029 | 深深房 A | 68,014.00   | 0.14             | 重大事项停牌   |
| 2  | 601236 | 红塔证券  | 33,869.94   | 0.07             | 新股锁定     |

## § 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 |
| 1000A        | 60       | 29,548.35 | 1,417,560.00 | 79.96% | 355,341.00    | 20.04% |
| 1000B        | 276      | 6,423.55  | 145.00       | 0.01%  | 1,772,756.00  | 99.99% |
| 华宝中证1000指数分级 | 4,346    | 12,962.92 | 402,619.09   | 0.71%  | 55,934,233.46 | 99.29% |
| 合计           | 4,682    | 12,789.97 | 1,820,324.09 | 3.04%  | 58,062,330.46 | 96.96% |

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

| 序号 | 持有人名称        | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例 |
|----|--------------|--------------|----------|
| 1  | 新华人寿保险股份有限公司 | 1,417,560.00 | 79.96%   |
| 2  | 陈云利          | 43,365.00    | 2.45%    |
| 3  | 张翱           | 39,746.00    | 2.24%    |
| 4  | 王少男          | 37,985.00    | 2.14%    |
| 5  | 李惠莲          | 35,051.00    | 1.98%    |
| 6  | 曹蜀湘          | 31,200.00    | 1.76%    |
| 7  | 唐梦雪          | 29,000.00    | 1.64%    |
| 8  | 李文霞          | 27,100.00    | 1.53%    |
| 9  | 张志赟          | 17,241.00    | 0.97%    |
| 10 | 史环宇          | 15,320.00    | 0.86%    |

1000B

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例 |
|----|-------|------------|----------|
| 1  | 朱金元   | 340,790.00 | 19.22%   |
| 2  | 丁建英   | 191,324.00 | 10.79%   |
| 3  | 祝东华   | 106,463.00 | 6.01%    |
| 4  | 曹国安   | 98,400.00  | 5.55%    |

|    |     |           |       |
|----|-----|-----------|-------|
| 5  | 刘娟  | 50,712.00 | 2.86% |
| 6  | 姚绿绿 | 46,000.00 | 2.59% |
| 7  | 谢锦星 | 44,722.00 | 2.52% |
| 8  | 杨玉锋 | 42,314.00 | 2.39% |
| 9  | 张爱勇 | 38,122.00 | 2.15% |
| 10 | 郑昕沂 | 36,900.00 | 2.08% |

### 8.3 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 | 1000A          | —         | —        |
|                  | 1000B          | —         | —        |
|                  | 华宝中证 1000 指数分级 | 13,649.60 | 0.0228%  |
|                  | 合计             | 13,649.60 | 0.0228%  |

### 8.4 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 | 1000A          | 0                 |
|                                | 1000B          | 0                 |
|                                | 华宝中证 1000 指数分级 | 0                 |
|                                | 合计             | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 1000A          | 0                 |
|                                | 1000B          | 0                 |
|                                | 华宝中证 1000 指数分级 | 0                 |
|                                | 合计             | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 1000A         | 1000B         | 华宝中证 1000<br>指数分级 |
|-----------------------------------|---------------|---------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日）基金<br>份额总额 | 29,441,582.00 | 29,441,582.00 | 271,827,940.54    |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 1,598,464.00  | 1,598,464.00  | 56,983,722.42     |
| 本报告期间基金总申购份额                      | -             | -             | 13,656,307.73     |
| 减:本报告期间基金总赎回份额                    | -             | -             | 13,954,303.60     |
| 本报告期间基金拆分变动份额（份额减<br>少以“-”填列）     | 174,437.00    | 174,437.00    | -348,874.00       |
| 本报告期末基金份额总额                       | 1,772,901.00  | 1,772,901.00  | 56,336,852.55     |

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

## § 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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、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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 中泰证券  | 2          | 7,145,812.38 | 34.06%               | 6,511.91  | 33.82%         | —  |
| 中信证券  | 2          | 4,605,126.36 | 21.95%               | 4,288.85  | 22.27%         | —  |
| 天风证券  | 2          | 3,660,622.17 | 17.45%               | 3,335.78  | 17.33%         | —  |
| 广发证券  | 2          | 1,420,455.99 | 6.77%                | 1,323.18  | 6.87%          | —  |
| 国泰君安  | 2          | 1,387,525.03 | 6.61%                | 1,290.52  | 6.70%          | —  |
| 申万宏源  | 3          | 708,124.96   | 3.37%                | 659.32    | 3.42%          | —  |
| 中信建投  | 1          | 686,442.18   | 3.27%                | 625.54    | 3.25%          | —  |
| 东吴证券  | 1          | 429,713.09   | 2.05%                | 400.16    | 2.08%          | —  |
| 海通证券  | 1          | 288,110.01   | 1.37%                | 268.31    | 1.39%          | —  |
| 西部证券  | 1          | 224,107.77   | 1.07%                | 159.41    | 0.83%          | —  |
| 招商证券  | 2          | 201,000.49   | 0.96%                | 183.17    | 0.95%          | —  |
| 银河证券  | 1          | 141,267.00   | 0.67%                | 131.58    | 0.68%          | —  |
| 万联证券  | 1          | 62,771.40    | 0.30%                | 57.20     | 0.30%          | —  |
| 中投证券  | 1          | 20,590.08    | 0.10%                | 19.18     | 0.10%          | —  |
| 国金证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 长城证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 民生证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 华信证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 国信证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 高华证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 西南证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 华安证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 安信证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 光大证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 太平洋证券 | 2          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 东兴证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 东方证券  | 2          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 华宝证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 日信证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 长江证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 红塔证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 平安证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |
| 信达证券  | 1          | —            | —                    | —         | —              | —  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中金国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本基金本报告期券商交易单元新增：红塔证券。

### 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

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。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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