

# 华宝宝裕纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 3 月 7 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2#</b>
1.1 重要提示.....	2#
1.2 目录.....	3#
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6#</b>
2.1 基金基本情况.....	6#
2.2 基金产品说明.....	6#
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7#
2.4 信息披露方式.....	8#
2.5 其他相关资料.....	8#
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9#</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9#
3.2 基金净值表现.....	9#
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11#</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11#
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12#
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12#
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.....	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.....	13#
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14#
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15#
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.....	15#
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16#</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16#
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.....	16#
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.....	16#
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17#</b>
6.1 资产负债表.....	17#
6.2 利润表.....	18#
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19#

6.4 报表附注.....	20#
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43#</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43#
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43#
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43#
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43#
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44#
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.....	44#
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44#
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.....	45#
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.....	45#
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45#
7.11 投资组合报告附注.....	45#
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47#</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47#
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47#
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.....	47#
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47#</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48#</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48#
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.....	48#
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48#
10.4 基金投资策略的改变.....	48#
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48#
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.....	48#
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48#
10.8 其他重大事件.....	49#
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50#</b>
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.....	50#
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50#

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>51#</b>
12.1 备查文件目录.....	51#
12.2 存放地点.....	51#
12.3 查阅方式.....	51#

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金
基金简称	华宝宝裕债券 A
基金主代码	006826
交易代码	006826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 7 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	860,587,680.89 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得长期稳定的投资收益。
投资策略	<p>本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在基金合同约定的范围内实施稳健的资产配置，通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期收益率的变化情况，进而在在最大限度地降低投资组合的风险前提下，提高投资组合的收益。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。</p> <p>①久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险。</p> <p>②期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。</p> <p>③信用风险控制是基金管理人充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体</p>

	<p>的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。</p> <p>④跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券投资组合，提高投资收益，实现跨市场套利。</p> <p>⑤相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。</p> <p>3、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>4、动态收益增强策略</p> <p>在以上债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益。主要包括骑乘收益率曲线策略、息差策略等。</p> <p>（1）骑乘收益率曲线策略</p> <p>骑乘收益率曲线策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券期限剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。</p> <p>（2）息差策略</p> <p>息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作，只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到杠杆放大的套利目标。</p> <p>本基金将根据对市场回购利率走势的判断，适当地选择杠杆比率，谨慎地实施息差策略，提高投资组合的收益水平。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华宝基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、 021-38924558	95559
传真	021-38505777	021-62701216
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	孔祥清	彭纯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

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



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年3月7日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	8,327,629.90
本期利润	8,429,967.54
加权平均基金份额本期利润	0.0102
本期加权平均净值利润率	1.02%
本期基金份额净值增长率	0.95%
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	8,020,951.80
期末可供分配基金份额利润	0.0093
期末基金资产净值	868,788,101.67
期末基金份额净值	1.0095
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	0.95%

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	0.47%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.05%	-0.01%
过去三个月	0.80%	0.03%	0.64%	0.06%	0.16%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	0.95%	0.03%	1.11%	0.05%	-0.16%	-0.02%

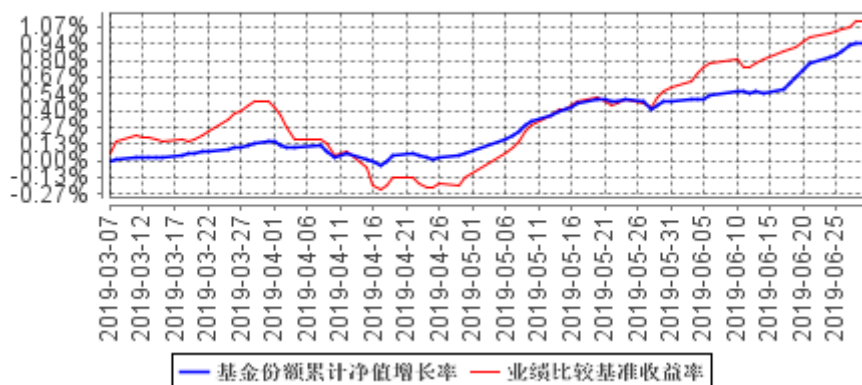
注：1、本基金基金合同生效于2019年3月7日，截至报告日，本基金基金合同生效未满一年。

2、本基金业绩比较基准为：中证综合债指数收益率。

3、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：1、本基金基金合同生效于 2019 年 3 月 7 日，截至报告日，本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起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，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2019 年 6 月 30 日），正在管理运作的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝银行 ETF、华宝银行 ETF 联接基金、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝科技先锋基金、华宝宝裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健 FOF 基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等，正在管理运作的证券投资基金资产净值合计 171,851,775,826.03 元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王慧	本基金基金经理、华宝宝丰高等级债	2019 年 3 月 7 日	-	14 年	硕士。曾在中国银行、南洋商业和苏州从事债券投资管理工作。2016 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，担任投资经理。2018

	券基金 经理、华 宝宝盛 债券基 金经理				年 8 月起任华宝宝丰高等 级债券型发起式证券投资 基金基金经理。2019 年 3 月起任华宝宝裕纯债债券 型证券投资基金基金经 理。2019 年 4 月起任华宝 宝盛纯债债券型证券投资 基金基金经理。
--	----------------------------------	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内宏观经济稳中有降，一、二季度 GDP 当季增速分别为 6.4%和 6.2%。一季度宏观经济变量和市场风险偏好都较 2018 年发生了较大的变化，稳增长、宽信用的对冲政策不断加码，宏观经济显现出一定的企稳迹象；而中美贸易谈判短期乐观，投资者风险偏好提升。长端利率债在年初收益率下行之后震荡上行，但整体上行幅度不是很大。进入 4 月，央行在货币政策委员会例会上意外重提“把好货币供给总闸门，不搞大水漫灌”并且取消“加大逆周期调节的力度”，同时，管理层将“促改革、调结构”的重要性逐渐提升，更加关注供给侧的结构性改革。4 月公布的 3 月 PMI、工业增加值等经济数据以及社融数据全面超预期，同时，央行连续两次辟谣降准传言，导致市场对央行流动性宽松的预期发生转变，隔夜利率维持在 2.5%左右，短端利率快速上行。叠加 2 季度通胀抬头的预期，投资者情绪受到较大影响，债券收益率大幅上行，其中 10 年期国开债收益上行 20BP 左右至 3.85%附近。5 月初，中美贸易谈判暂缓，美方拟于 5 月 10 日对来自中国的 2000 亿美元进口商品的关税从 10%上调至 25%，并称可能对额外的 3000 亿美元商品加征关税，市场风险偏好回落。央行宣布 5 月 15 日开始对中小银行实行较低存款准备金率，释放长期资金约 2800 亿元，隔夜利率快速下行至 1.2%的低点，债券收益也跟随下行。而 4 月经济数据较 3 月有较大回落，同时 CPI 上行幅度低于预期，推动债券收益率进一步下行。5 月 24 日包商银行被接管事件公告后，债市悲观情绪一度升温，但在后续管理层不断加码安抚政策出台后，短期影响消退，过度宽松的货币环境与 5 月较弱的经济数据推动债券收益率进一步下行。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 0.95%，业绩比较基准收益率为 1.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内宏观经济仍有一定的下行压力。近期房地产调控政策趋严，预计房地产投资增速将持续回落；在积极的财政政策支持下，未来基建增速可能会有所回升，但受财政支出节奏提前和隐性债务约束的影响下预计回升幅度相对有限；而制造业投资预计仍将维持弱势。出口方面则在全球 PMI 持续走弱以及 2000 亿美元加征关税的影响下存在较大的不确定性。短期汽车消费大幅上升，主要受到国五向国六标准转变以及新能源车补贴退坡过渡期结束的影响。从中长期来看，前期居民加杠杆的负面影响，以及就业压力带来的可支配收入增速的放缓，都制约了消费

改善的持续性。货币政策方面，全球多国央行开启降息周期，市场预期美联储年内将降息 2-3 次，叠加中美利差维持高位，国内央行货币政策继续维持相对宽松的可能性较大，预计资金利率也将维持低位。此外，国内债市对外海投资者的吸引力提升也将带来一定的配置资金。总体来看，三季度在国内经济基本面继续走弱，货币政策宽松概率较大，海外配资力量较强的背景下，债券收益率震荡下行的可能性较大。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性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，基金托管人在华宝宝裕纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华宝基金管理有限公司在华宝宝裕纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期内，由华宝基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华宝宝裕纯债债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：华宝宝裕纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,641,467.50	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,054,551,000.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,054,551,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	13,825,950.55	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,072,018,418.05	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		202,799,578.60	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		213,562.29	-
应付托管费		71,187.41	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	27,780.91	-

应交税费		39,348.11	-
应付利息		24,725.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	54,133.72	-
负债合计		203,230,316.38	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	860,587,680.89	-
未分配利润	6.4.7.10	8,200,420.78	-
所有者权益合计		868,788,101.67	-
负债和所有者权益总计		1,072,018,418.05	-

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0095 元，基金份额总额 860,587,680.89 份。

本基金基金合同生效于 2019 年 3 月 7 日，无上年末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝宝裕纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年3月7日(基金 合同生效日)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
<b>一、收入</b>		10,265,127.38	-
1.利息收入		10,391,990.26	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	883,781.83	-
债券利息收入		9,431,694.56	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		76,513.87	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-422,237.08	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-422,237.08	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	102,337.64	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	193,036.56	-
<b>减：二、费用</b>		1,835,159.84	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	797,315.37	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	265,771.74	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	9,875.00	-
5. 利息支出		678,603.34	-
其中：卖出回购金融资产支出		678,603.34	-
6. 税金及附加		13,758.41	-
7. 其他费用	6.4.7.21	69,835.98	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,429,967.54	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,429,967.54	-

注：本基金基金合同生效于 2019 年 3 月 7 日，无上年可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝宝裕纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 7 日（基金合同生效日）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）	234,202,900.16	-	234,202,900.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,429,967.54	8,429,967.54
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）	626,384,780.73	-229,546.76	626,155,233.97
其中：1.基金申购款	1,397,599,542.60	703,756.65	1,398,303,299.25
2.基金赎回款	-771,214,761.87	-933,303.41	-772,148,065.28
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)	860,587,680.89	8,200,420.78	868,788,101.67
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注：本基金基金合同生效于 2019 年 3 月 7 日，无上年可比期间数据。

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

华宝宝裕纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝宝裕纯债债券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[2018]2121 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 234,202,900.16 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(19)第 00023 号的验资报告。基金合同于 2019 年 3 月 7 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、赎回费及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费，赎回时收取赎回费而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费，赎回时收取赎回费并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《华宝宝裕纯债债券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，包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 29 日已经本基金的基金管理人批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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》、《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。



#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[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》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	3,641,467.50
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	3,641,467.50

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	1,054,448,662.36	1,054,551,000.00
	合计	1,054,448,662.36	1,054,551,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,054,448,662.36	1,054,551,000.00	102,337.64

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,696.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	13,824,254.17
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	-
合计	13,825,950.55

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	27,780.91
合计	27,780.91

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	54,133.72
合计	54,133.72

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	234,202,900.16	234,202,900.16
本期申购	1,397,599,542.60	1,397,599,542.60
本期赎回(以“-”号填列)	-771,214,761.87	-771,214,761.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	860,587,680.89	860,587,680.89

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	8,327,629.90	102,337.64	8,429,967.54
本期基金份额交易产生的变动数	-306,678.10	77,131.34	-229,546.76
其中：基金申购款	2,426,406.90	-1,722,650.25	703,756.65
基金赎回款	-2,733,085.00	1,799,781.59	-933,303.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,020,951.80	179,468.98	8,200,420.78

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	110,074.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	773,706.95
结算备付金利息收入	-
其他	0.45
合计	883,781.83

注：其他存款利息收入为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期内无股票投资收益。

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

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-422,237.08
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-422,237.08

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	283,986,822.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	281,052,181.00
减：应收利息总额	3,356,878.89
买卖债券差价收入	-422,237.08

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	102,337.64
——股票投资	-
——债券投资	102,337.64
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	102,337.64

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
基金赎回费收入	193,032.18
转换费收入 006826	4.38
合计	193,036.56

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对持续持有期不少于7日的投资者，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于25%的部分归入转出基金的基金财产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	9,875.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	9,875.00

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	19,333.72
信息披露费	34,800.00
银行汇划费用	15,702.26
合计	69,835.98

### 6.4.7.22 分部报告

无。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人
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。



### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1 关联方报酬

##### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效 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
当期发生的基金应支付的管理费	797,315.37	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.3% 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 X 0.3% / 当年天数。

##### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月7日(基金合同生效日) 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
当期发生的基金应支付的托管费	265,771.74	-

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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×0.1% / 当年天数。

##### 6.4.10.1.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

**6.4.10.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
华宝投资有限公司	20,846,239.78	2.4200%	-	-
交通银行股份有限公司	789,601,486.77	91.7500%		

**6.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月7日(基金合同生效日)至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,641,467.50	110,074.43	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.6 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 202,799,578.60 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190302	19 进出 02	2019 年 7 月 1 日	99.91	1,000,000	99,910,000.00
170209	17 国开 09	2019 年 7 月 1 日	101.40	300,000	30,420,000.00
190402	19 农发 02	2019 年 7 月 1 日	99.83	200,000	19,966,000.00
111993347	19 广州农村商业银 行 CD032	2019 年 7 月 1 日	96.95	650,000	63,017,500.00
合计				2,150,000	213,313,500.00

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于风险较小、收益稳定的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、

分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、超短期融资券、短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。本基金不投资股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（分离交易可转债的纯债部分除外）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险的前提下，追求稳定的当期收益和总回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

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

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

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

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	199,947,000.00	-
合计	199,947,000.00	-

注：未评级部分为政策性金融债、短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	116,335,000.00	-
合计	116,335,000.00	-

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	707,849,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	30,420,000.00	-
合计	738,269,000.00	-

注：未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2019 年 6 月 30 日，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本

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

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

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

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

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

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

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,641,467.50	-	-	-	3,641,467.50
交易性金融资产	518,168,000.00	536,383,000.00	-	-	-1,054,551,000.00
应收利息	-	-	-	13,825,950.55	13,825,950.55
资产总计	521,809,467.50	536,383,000.00	-	13,825,950.55	1,072,018,418.05
负债					
卖出回购金融资产款	202,799,578.60	-	-	-	202,799,578.60
应付管理人报酬	-	-	-	213,562.29	213,562.29
应付托管费	-	-	-	71,187.41	71,187.41
应付交易费用	-	-	-	27,780.91	27,780.91
应付利息	-	-	-	24,725.34	24,725.34
应交税费	-	-	-	39,348.11	39,348.11
其他负债	-	-	-	54,133.72	54,133.72
负债总计	202,799,578.60	-	-	430,737.78	203,230,316.38
利率敏感度缺口	319,009,888.90	536,383,000.00	-	13,395,212.77	868,788,101.67
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
负债					

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）



1. 市场利率下降 25 个基点	3,489,807.52	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-3,466,761.43	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,054,551,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

(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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关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，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,054,551,000.00	98.37
	其中：债券	1,054,551,000.00	98.37
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,641,467.50	0.34
8	其他各项资产	13,825,950.55	1.29
9	合计	1,072,018,418.05	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金报告期末未持有股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票投资。

**7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

本基金本报告期内无股票投资。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期内无股票投资。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	432,450,000.00	49.78
	其中：政策性金融债	150,296,000.00	17.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	130,086,000.00	14.97
6	中期票据	375,680,000.00	43.24
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	116,335,000.00	13.39
9	其他	-	-
10	合计	1,054,551,000.00	121.38

**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	190302	19 进出 02	1,000,000	99,910,000.00	11.50
2	111993347	19 广州农村 商业银行 CD032	700,000	67,865,000.00	7.81
3	101800938	18 光明 MTN003	600,000	61,218,000.00	7.05
4	101800526	18 中金集 MTN001BC	500,000	51,185,000.00	5.89
5	101800842	18 华侨城 MTN002	500,000	50,820,000.00	5.85

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

宝裕纯债基金截至 2019 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的 18 平安银行 01 (1828019) 的发行人平安银行于 2018 年 8 月 3 日收到各省市银监局、银保监会处罚通知。由于公司存在办理无真实贸易背景票据业务、办理无真实贸易背景的银行承兑汇票业务、部分个人非房贷类信贷资金用途把控不力, 违规流入房地产市场、授权未经任职资格核准的人员实际履行银行高管职权、以不正当手段发放贷款、会计记账违反审慎经营规则, 处以罚款。

宝裕纯债基金截至 2019 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的 17 民生银行 01 (1728004) 的发行人民生银行于 2018 年 12 月 8 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚通知。由于公司存在:(一) 内控管理严重违反审慎经营规则;(二) 同业投资违规接受担保;(三) 同业投资, 理财资金违规投资房地产, 用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;(四) 本行理财产品之间风险隔离不到位;(五) 个人理财资金违规投资;(六) 票据代理未明示, 增信未簿记和计提资本占用;(七) 为非保本理财产品提供保本承诺; 被处以罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,825,950.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,825,950.55

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
317	2,714,787.64	860,390,789.17	99.98%	196,891.72	0.02%

### 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	175,251.10	0.0204%

### 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	0~10
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（2019年3月7日）基金份额总额	234,202,900.16
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,397,599,542.60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	771,214,761.87
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	860,587,680.89

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财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(2019年3月7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	
天风证券	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. 本报告其租用的证券公司交易单元均为新增。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金招募说明书	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
2	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金合同（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
3	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
4	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
5	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
6	华宝基金管理有限公司关于华宝宝裕纯债债券型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 6 日
7	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 8 日
8	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 3 月 8 日
9	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金开放日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 12 日
10	华宝宝裕纯债债券型证券投资基金暂停个人客户的申购、转换转	中国证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 20 日

	入及定期定额投资业务的公告		
11	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190321~20190415	-	205,337,905.51	205,337,905.51	-	-
	2	20190321~20190630	-	789,601,486.77	-	789,601,486.77	91.75%
	3	20190412~20190412	-	199,899,050.47	199,899,050.47	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金合同；  
华宝宝裕纯债债券型证券投资基金招募说明书；  
华宝宝裕纯债债券型证券投资基金托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2019年8月29日