华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日
基金管理人：华宝基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：2018年8月24日

§1重要提示及目录

1.1重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华宝量化对冲混合	
基金主代码	000753	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月17日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	529,224,468.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	华宝量化对冲混合A	华宝量化对冲混合C
下属分级基金的交易代码：	000753	000754
报告期末下属分级基金的份额总额	152,875,220.81份	376,349,247.44份

2.2基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用量化行业配置模型和量化Alpha选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。 量化行业配置模型在参考相关指数的行业权重分布的基础上，结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型，在整体风险水平可控的前提下，实现各行业权重的优化配置。 根据对中国证券市场运行特征的长期研究、投研团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了量化Alpha选股模型。该模型规避主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪，以超额收益的水平和稳定性为目标确定各因子的优化权重，根据该模型的综合评分结果，在各行业中选择股票构建股票投资组合。 当股票投资组合构建完成后，本基金会进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，动态优化个股权重，使股票组合的整体风险处于可控范围内。 现阶段，本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华宝量化对冲混合A	华宝量化对冲混合C
3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	8,614,854.16	20,822,489.62
本期利润	1,931,749.32	4,740,750.38
加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0110
本期基金份额净值增长率	1.21%	1.01%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0605	0.0558
期末基金资产净值	162,120,777.84	397,331,738.48
期末基金份额净值	1.0605	1.0558

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日然日（如非交易日）。

4.期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝量化对冲混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.52%	0.14%	0.12%	0.00%	0.40%	0.14%
过去三个月	0.63%	0.12%	0.37%	0.00%	0.26%	0.12%
过去六个月	1.21%	0.22%	0.74%	0.00%	0.47%	0.22%
过去一年	2.51%	0.18%	1.50%	0.00%	1.01%	0.18%
过去三年	8.97%	0.17%	4.62%	0.00%	4.35%	0.17%
自基金合同生效日起至今	24.99%	0.29%	6.71%	0.01%	18.28%	0.28%

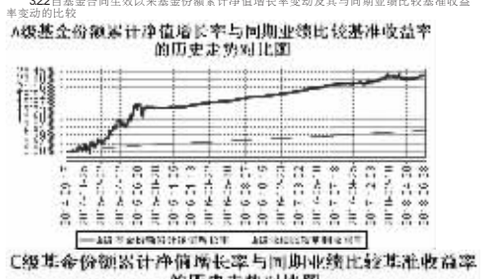
华宝量化对冲混合C

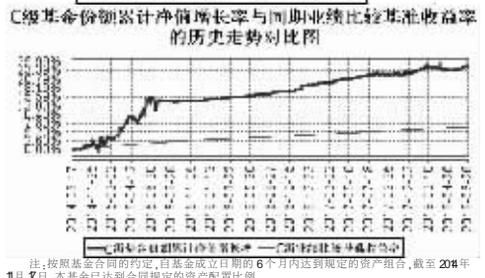
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.49%	0.14%	0.12%	0.00%	0.37%	0.14%
过去三个月	0.53%	0.12%	0.37%	0.00%	0.16%	0.12%
过去六个月	1.01%	0.22%	0.74%	0.00%	0.27%	0.22%
过去一年	2.11%	0.18%	1.50%	0.00%	0.61%	0.18%
过去三年	8.55%	0.17%	4.62%	0.00%	3.93%	0.17%
自基金合同生效日起至今	24.40%	0.29%	6.71%	0.01%	17.69%	0.28%

注：1.本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款利率(税后)

2.净值以及业绩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个日然日(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





注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2014年11月17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2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末(2018年6月30日)，所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证100基金、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、上证180成长ETF、华宝上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证1000分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司ETF、华宝中证军工ETF、华宝新活力基金、华宝沪深300指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝新优享基金、华宝银行ETF、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证500指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商ETF联接基金，所管理的证券投资基金资产净值合计163,280,039.94亿元。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐林明	助理投资总监、量化投资部总经理、本基金基金经理、华宝事件驱动混合、华宝沪深300增强基金经理	2014年9月17日	-	16年	复旦大学经济学硕士，FRM，曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中原证券从事金融工程研发工作，2005年8月加入华宝基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理，2009年9月至2015年11月任华宝中证100指数型证券投资基金基金经理，2010年2月起任量化投资部总经理，2010年4月至2015年11月任华宝上证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，2014年6月任助理投资总监，2014年9月兼任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015年4月起任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016年12月起兼任华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
王正	本基金基金经理助理、华宝事件驱动混合、华宝沪深300增强、华宝新价值混合、华宝新机遇混合、华宝新起点混合、华宝新飞跃混合、华宝新回报混合、华宝新优选混合基金经理助理	2014年10月21日	-	6年	硕士。2012年加入华宝基金管理有限公司，曾任助理量化分析师、投资经理助理，2014年10月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理助理，2015年11月起兼任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理助理，2016年12月起兼任华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理，2017年8月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2017年8月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金和华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
唐雪倩	本基金基金经理助理、华宝沪深300增强、华宝新价值混合、华宝新机遇混合、华宝新起点混合、华宝新飞跃混合、华宝新回报混合、华宝新优选混合基金经理助理	2018年1月23日	-	3年	硕士。2015年加入华宝基金管理有限公司任助理量化分析师，2018年1月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金和华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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、《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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，量化对冲策略混合型发起式证券投资基金在短期内出现过基金资产总值占基金资产净值超过110%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

2018年上半年市场整体呈现较为剧烈的震荡行情，受贸易摩擦升级、信用风险抬升以及资管新规趋严等多重因素的影响，投资者的风险偏好较为脆弱，二月份以后市场连续下行。在此背景下，基金始终坚持市场中性的投资策略，利用股指期货对股票组合进行对冲，有效控制了基金的波动和回撤，报告期间取得了正的收益。选股方面仍然采用此前的量化Alpha选股模型，在沪深300成分股及备选成分股中精选基本面优质的股票，报告期间相对沪深300指数仍然取得了较为稳定的超额收益。对冲方面，受市场下行的影响，沪深300股指期货基差再次转负，大幅提升了对冲成本，基金在此过程中及时进行了灵活的仓位管理，兑现了部分基差收益，但目前期指贴水的状态尚未得到有效的修复，不利于对冲展期等日常操作，基金保持较低仓位运行。闭置资金主要投资于低风险标的或现金管理，积极参与新股申购、协议存款、交易所回购等，力争在风险可控的前提下实现资金的稳健增长。未来基金会紧密跟踪期指的情况，待基差恢复到合理水平时灵活加仓，保持基金的稳健收益属性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内华宝量化对冲A累计单位净值增长率12%，华宝量化对冲C累计单位净值增长率10%，同期业绩比较基准收益率为0.74%，业绩比较基准为一年期银行定期存款利率(税后)。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018上半年中国经济短周期筑顶，中美分歧的加剧，经济预期的弱化和监管调控的升级使得风险偏好受到极大的压制，股票市场大幅波动。市场对于宏观经济短期回落的预期较为一致，贸易战背景下外需的扩展在边界，持续的去杠杆和由此引发的信用紧缩对经济的增长带来一定的挑战。在此背景下，A股多数行业年初至今均经历了较为明显的估值收缩，投资者情绪趋于谨慎，对业绩和成长的确定性的追求不断提高。

展望下半年，经济增速虽预期回落，但韧性仍在。货币政策维持稳健中性，不排除边际宽松的可能。从微观数据来看，行业龙头仍保持较高的盈利和业绩增速。消费的稳健和企业资本开支的上升仍然对经济形成一定的支撑，新旧动能转换逐步推进，有望孕育产业升级的诸多机会。随着市场的回调，A股估值水平逐渐接近历史底部区间，预计将吸引长线资金入市，下半年市场大概率在结构性的机会，盈利和成长确定性较高的股票将具备更高的安全边际，业绩主线仍将是市场关注的焦点。本基金作为市场中性基金，会继续严格控制风险，避免过度的风格偏离和头寸暴露，在股票投资中注重对个股基本面质地的考察，甄选具备良好经营能力和成长能力的优质公司。

股指期货方面，受弱势市场的影响，沪深300股指期货目前仍维持负基差状态，但随着风险的逐步释放，负基差的程度已经企稳修复。股指期货政策未来仍有进一步放开的可能，整体的流动性将进一步提高，基金会继续密切关注股指期货的相关变化，在震荡的市场下利用对冲策略获取稳健的回报。

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，定期评审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，基金管理人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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全履职履责履行了应尽的义务。

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

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

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		92,592,687.18	121,828,361.01
结算备付金		41,552,945.61	109,277,537.22
存出保证金		33,287,441.07	47,415,165.82
交易性金融资产		264,120,971.94	361,769,758.28
其中：股票投资		224,117,971.94	326,914,767.28
基金投资		-	-
债券投资		40,003,000.00	34,854,991.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生工具投资		-	-
买入返售金融资产		132,200,000.00	45,900,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,982,825.28	934,457.53
应收股利		-	-
应收申购款		908,720.77	8,739,194.26
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		566,645,591.85	695,864,474.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,789,023.18	2,906,271.29
应付赎回款		3,671,687.56	4,687,976.09
应付管理人报酬		467,177.36	568,287.11
应付托管费		93,435.48	113,657.42
应付销售服务费		133,211.35	166,361.99
应付交易费用		667,750.83	1,021,697.21
应交税费		227,431.56	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		143,358.21	243,664.25
负债合计		7,193,075.53	9,707,915.36
所有者权益：			
实收基金		529,224,468.25	656,041,125.41
未分配利润		30,228,048.07	30,115,433.35
所有者权益合计		559,452,516.32	686,156,558.76
负债和所有者权益总计		566,645,591.85	695,864,474.12

报告截止日2018年6月30日，华宝量化对冲混合A基金份额净值1.0605元，基金份额总额152,875,220.81份；华宝量化对冲混合C基金份额净值1.0558元，基金份额总额376,349,247.44份。华宝量化对冲混合份额总额合计为529,224,468.25份。

6.2利润表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		12,796,202.36	22,684,973.58
1.利息收入		4,924,840.56	10,446,927.27
其中：存款利息收入		1,970,733.31	8,974,428.66
债券利息收入		662,028.76	601.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,292,078.49	1,471,897.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		29,801,695.53	3,563,954.34
其中：股票投资收益		3,859,145.14	9,397,837.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益		10,503.10	143,740.11
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		23,298,190.03	-7,543,020.00
股利收益		2,633,857.26	1,565,396.83
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)		-22,764,844.08	7,588,827.16
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		834,510.35	1,085,264.81
减：二、费用		6,123,702.66	5,533,113.93
1.管理人报酬		3,115,172.59	3,667,810.59
2.托管费		623,034.51	733,562.06
3.销售服务费		902,855.04	519,050.97
4.交易费用		1,238,615.84	425,158.38
5.利息支出		919.52	-
其中：卖出回购金融资产支出		919.52	-
6.税金及附加		82,129.50	-
7.其他费用		160,975.66	187,531.93
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		6,672,499.70	17,151,859.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		6,672,499.70	17,151,859.65

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

资产	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	656,041,125.41	30,115,433.35	686,156,558.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,672,499.70	6,672,499.70
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)	-126,816,657.16	-6,559,884.98	-133,376,542.14
其中：1.基金申购款	270,498,999.64	14,115,968.44	284,614,968.08
2.基金赎回款	-397,315,656.80	-20,675,853.42	-417,991,510.22
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)	529,224,468.25	30,228,048.07	559,452,516.32
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	644,300,954.26	6,576,019.29	650,876,973.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,151,859.65	17,151,859.65
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)	14,405,616.64	-1,173,105.13	13,232,511.51
其中：1.基金申购款	503,640,821.10	9,021,279.45	512,662,100.55
2.基金赎回款	-489,235,204.46	-10,194,384.58	-499,429,589.04
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)	658,706,570.90	22,554,773.81	681,261,344.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄小意 向辉 张辛骏

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(原名为华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金，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[2014]1337号《关于核准华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司，已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)作为发起人向其他发起人(指华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金募集的批复)