华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝中证500增强	
基金主代码	005607	
交易代码	005607	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2018年4月19日	
报告期末基金份额总额	42,412,028.63份	
投资目标	本基金为中证500指数增强型基金,在实现对中证500指数有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理,力争实现超越标的指数的投资收益。	
投资策略	本基金在复制标的指数的基础上优化投资组合,力求通过量化技术实现指数增强的效果。 1、资产配置策略 本基金主要投资于中证500指数成分股及备选股票,也会根据中证500股指期货的基差情况择机部分使用期货替代现货,降低成本。视市场情况本基金也会谨慎地参与一些绝对收益策略。同时,本基金将预留必要的现金,应对期货保证金的增加要求或投资者的赎回申请。 2、股票投资策略 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。在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现,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。 (1)量化行业配置模型 在跟踪偏离风险可控的前提下,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,在标的指数行业权重的基础上进行优化。 (2)量化Alpha选股模型 经过对中国证券市场运行特征的长期研究、大量实证检验和投资实践,量化投资团队自主开发并不断改进Alpha选股模型。该模型主要选取估值、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。以超额收益的水平和稳定性为目标,通过实证分析确定各因子的权重,并动态跟踪适时调整。结合上述因子对股票池中的股票综合打分,根据评分结果在各行业中选出股票,构建股票投资组合。本基金进一步根据个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况,对行业内的个股权重动态调整,以保证股票组合的跟踪误差处于可控范围内。股票池包括标的指数的成分股及备选股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成分股中流动性良好、基本面优质及与成分股相关度高的股票。 (3)风险控制与调整 本基金通常每月定期调整组合,并会对指数成分股保持密切跟踪。在出现因增发、送配、长期停牌后复牌等对权重造成较大影响的情况,或者成分股临时调入调出、成分股出现特殊事件等情况下,本基金将及时对投资组合进行调整。 本基金将根据风险评估模型控制投资组合的跟踪偏离风险。主要采用"跟踪误差"和"跟踪偏离度"这两个指标对投资组合相对于目标指数的偏离情况进行监控与评估。本基金风险控制目标是力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.5%。 3、股指期货投资策略 在不同的市场环境下,本基金将综合考虑股指期货相对现货的基差、流动性、展期收益以及保证金要求等因素,以套期保值为目的,选择部分使用股指期货多头合约替代指数现货,以求提高资金利用效率和组合收益水平。 4、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,可投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,以保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 5、资产支持证券投资策略 在严格控制投资风险的前提下,本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种,选择低估的品种进行投资。 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金将在法律法规允许的范围和比例内,以及风险可控的前提下,基于谨慎原则参与融资和转融通证券出借业务。 参与融资业务时,本基金将力争利用融资的杠杆作用,降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。 参与转融通证券出借业务时,本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象,力争为本基金份额持有人增厚投资收益。 7、权证投资策略 在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以期更好地实现本基金的投资目标。 8、其他金融工具投资策略 在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以期更好地实现本基金的投资目标。 未来如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标,制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。	
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝中证500增强A	华宝中证500增强C
下属分级基金的交易代码	005607	005608
报告期末下属分级基金的份额总额	29,273,927.13份	13,138,101.50份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
	华宝中证500增强A	华宝中证500增强C
1.本期已实现收益	2,519,136.55	1,092,801.30
2.本期利润	5,759,694.51	2,687,996.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.1978	0.1883
4.期末基金资产净值	28,097,886.53	12,562,609.67
5.期末基金份额净值	0.9598	0.9562

注:1.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。

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华宝中证500增强A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	26.22%	1.58%	31.27%	1.63%	-5.05%	-0.05%

华宝中证500增强C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	26.10%	1.58%	31.27%	1.63%	-5.17%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、本基金基金合同生效于2018年4月19日,截止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2018年10月19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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接、华宝中证全指证券公司ETF、华宝券商ETF联接、华宝中证1000指数分级基金经理	2018年4月19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、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。

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、《华宝中证500指数增强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。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

中证500指数在一季度呈现稳健上升的走势,华宝中证500增强基金本报告期运用量化手段进行主动管理,受二月份市场急速上涨过程中之前基本面及市场面有效的因子纷纷失效,甚至出现反方向结果,导致量化模型的结果在与去年截然不同的市场环境中受到较大的跟踪压力。

本报告期为本基金的正常运作期,在实际操作中,我们遵守基金合同,按照既定的指数增强投资策略,通过量化投资方法达到投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额A净值增长率为26.22%;本报告期基金份额C净值增长率为26.10%;同期业绩比较基准收益率为31.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,基金合同于2018年4月19日生效,基金管理人于2018年4月17日运用固有资金作为发起资金认购本基金,且承诺持有期限自本基金合同生效之日起不少于3年。

根据本基金基金合同的规定:基金合同生效日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。基金合同生效三年后继续存续的,基金存续期内,连续20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5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形之一的,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。

截止2019年3月31日,本基金基金合同生效未满三年,基金管理人暂无需对基金持有人数或基金资产净值进行预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	36,594,269.70	88.98
	其中:股票	36,594,269.70	88.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,231,761.75	10.29
8	其他资产	301,003.89	0.73
9	合计	41,127,035.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	235,545.00	0.58
B	采矿业	1,017,038.80	2.50
C	制造业	17,458,212.70	42.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	927,977.00	2.28
E	建筑业	518,214.00	1.27
F	批发和零售业	1,304,950.00	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,005,955.00	2.47
H	住宿和餐饮业	226,630.00	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,035,861.20	7.47
J	金融业	1,111,790.00	2.73
K	房地产业	1,646,427.00	4.05
L	租赁和商务服务业	741,201.00	1.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	238,800.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	358,592.00	0.88
R	文化、体育和娱乐业	731,109.00	1.80
S	综合	679,734.00	1.67
	合计	31,238,036.70	76.83

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,319,258.00	8.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	146,914.00	0.36
E	建筑业	53,766.00	0.13
F	批发和零售业	360,126.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	183,120.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	282,605.00	0.70
J	金融业	147,620.00	0.36
K	房地产业	451,626.00	1.11
L	租赁和商务服务业	73,170.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	338,028.00	0.83
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	5,356,233.00	13.17

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600536	中国软件	6,100	338,550.00	0.83
2	000860	顺鑫农业	5,400	327,402.00	0.81
3	000066	中国长城	26,000	274,820.00	0.68
4	603369	今世缘	9,400	269,780.00	0.66
5	000596	古井贡酒	2,500	268,750.00	0.66
6	603444	吉比特	1,300	268,359.00	0.66
7	002191	劲嘉股份	18,900	268,191.00	0.66
8	600895	张江高科	11,800	267,978.00	0.66
9	300253	卫宁健康	18,300	267,180.00	0.66
10	000778	新兴铸管	51,800	265,216.00	0.65

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603128	华贸物流	22,800	176,016.00	0.43
2	300630	普利制药	2,200	165,418.00	0.41
3	000858	五粮液	1,700	161,500.00	0.40
4	603360	百傲化学	5,400	158,220.00	0.39
5	000560	我爱我家	21,200	154,336.00	0.38

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1906	IC1906	1	1,096,400.00	272,920.00	-
项目					值
公允价值变动总额合计(元)					272,920.00
股指期货投资本期收益(元)					-5,760.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					326,080.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货提高投资效率,以更好地实现本基金的投资目标,降低跟踪误差。此外,在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时,本基金可以通过股指期货进行有效的现金头寸管理。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2 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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	188,656.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	849.30
5	应收申购款	111,498.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,003.89

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝中证500增强A	华宝中证500增强C
报告期期初基金份额总额	29,247,088.16	13,096,493.72
报告期期间基金总申购份额	4,819,676.45	8,884,799.90
减:报告期期间基金总赎回份额	4,792,837.48	8,843,192.12
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	29,273,927.13	13,138,101.50

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	中证500增强A	中证500增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.58	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	23.58	10,000,450.05	23.58	不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,450.05	23.58	10,000,450.05	23.58	-

注:1、本基金募集期间,本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计10,001,000.00元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于3年;

2、本基金管理人运用固有资金于2018年4月16日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为1,000元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20190101~20190331	10,000,450.05	0.00	0.00	10,000,450.05	23.58%
产品特有风险							
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同;

华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书;

华宝中证500指数增强型发起式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。

10.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

10.3 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4月19日

华宝服务优选混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝服务优选混合
基金主代码	000124
交易代码	000124
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月27日
报告期末基金份额总额	742,672,018.24份
投资目标	把握服务相关行业的稳步成长,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策,以及市场流动性等方面因素,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享服务业快速发展所带来的行业高回报。本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,投资的目标是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	112,429,256.27
2.本期利润	201,677,058.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.2917
4.期末基金资产净值	1,234,706,109.25
5.期末基金份额净值	1.663

注:1.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。

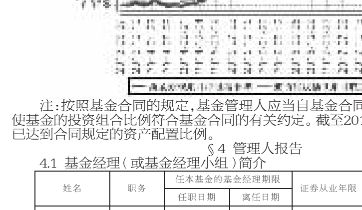
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	20.86%	1.51%	21.08%	1.25%	-0.22%	0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至2013年12月27日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
楼鸿强	本基金基金经理、华宝万物互联混合基金经理	2014年10月22日	-	9年	硕士。曾在兴业证券研究所从事行业分析工作。2011年加入华宝基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理等职务。2014年10月起任华宝服务优选混合型证券投资基金基金经理,2015年6月起任华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《华宝服务优选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年1季度,市场强势上涨,特别是春节后出现普涨行情,几乎所有板块都出现较好的涨幅。年初较为充裕的流动性释放,叠加经济阶段性企稳以及贸易战逐步缓解的预期,市场情绪逐渐乐观。此外,市场监管政策的变化,使得参与者交易风险偏好快速上升。2018年市场极度悲观,市场估值处于相对历史低位。综合以上因素,2019年1季度市场表现非常好。

本基金1季度适当提高了仓位,继续持有医疗服务、科技龙头、新能源等前景明确的成长板块,适度增加部分跌幅较大的品种。

4.5 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20.86%,业绩比较基准收益率为21.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,020,211,084.12	77.30
	其中:股票	1,020,211,084.12	77.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	298,238,625.70	22.60
8	其他资产	1,291,230.46	0.10
9	合计	1,319,740,940.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	592,280,765.40	47.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	340,789,323.26	27.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	668,437.76	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	86,472,557.70	7.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,020,211,084.12	82.63

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002405	四维图新	2,644,909	59,986,536.12	4.86
2	600763	通策医疗	836,845	58,997,572.50	4.78
3	300115	长盈精密	3,952,300	49,798,980.00	4.03
4	300454	深信服	406,780	42,663,086.40	3.46
5	300659	中孚信息	1,187,202	37,658,047.44	3.05
6	300618	寒锐钴业	469,897	37,248,735.19	3.02
7	300572	安车检测	454,000	35,116,900.00	2.84
8	600271	航天信息	1,219,050	34,048,066.50	2.76
9	600887	伊利股份	1,168,100	34,003,391.00	2.75
10	300450	先导智能	904,362	33,633,222.78	2.72

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2 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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,022,128.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	67,801.00
5	应收申购款	201,301.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,291,230.46

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	625,011,283.26
报告期期间基金总申购份额	143,158,499.63
减:报告期期间基金总赎回份额	25,497,764.65
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	742,672,018.24

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	327,192.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	327,192.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.04

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝服务优选混合型证券投资基金基金合同;

华宝服务优选混合型证券投资基金招募说明书;

华宝服务优选混合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。

9.2 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。

9.3 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4月19日

华宝海外中国成长混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝海外中国混合
基金主代码	241001
交易代码	241001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月7日
报告期末基金份额总额	256,575,882.46份
投资目标	主要投资于海外上市的中国公司的股票,在全球资本市场分享中国经济增长,追求资本长期增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。本基金各类资产配置的比例范围为:股票占基金资产总值的60%-95%,债券和其他资产占基金资产总值的5%-40%。
业绩比较基准	中证海外内地股指数。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
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
境外投资顾问	英文名称:-
	中文名称:-
境外资产托管人	英文名称:The Bank of New York Mellon Corporation
	中文名称:纽约梅隆银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-4,771,858.14
2.本期利润	42,724,702.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.1560
4.期末基金资产净值	414,542,460.77
5.期末基金份额净值	1.616

注:1.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。

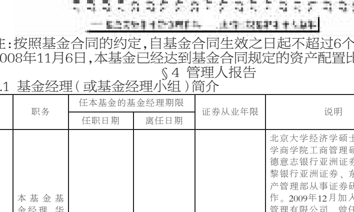
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	10.84%	1.00%	13.44%	1.12%	-2.60%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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,自基金合同生效之日起不超过6个月内完成建仓,截至2008年11月6日,本基金已经达到基金合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周欣	本基金基金经理、华宝香港精选混合基金经理	2009年12月31日	-	19年	北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士,曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009年12月加入华宝基金管理有限公司,曾任海外投资管理部总经理。2009年12月起任华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金经理,2015年9月至2017年8月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理,2018年6月起任华宝港股通香港精选混合型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

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,华宝海外中国成长混合型证券投资基金短期内出现过投资于同一证券发行人发行的证券超过基金资产净值10%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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

一季度港股市场在中国社融数据超预期增长、中美贸易谈判取得进展、以及A股市场转暖带动之下出现修复性上涨。按照人民币计价,一季度恒生指数和恒生国企指数都分别上涨9.4%,中证海外内地指数上涨13.4%。一月社会融资数据达到4.6万亿元,大幅超出市场预期,虽然其中包含了大量票据融资,但仍然比较明确地表现出宏观经济政策短期内更加侧重稳增长的目标,因此极大地提振了市场信心,带动港股上涨。此外中美在一季度进行了多轮贸易谈判,在某些方面的谈判细节取得积极进展,因此美方决定将原定于3月1日将从中国进口的2000亿美元商品关税提高的期限推迟实施。中美国家首脑虽然未能在3月份进行会晤,不过考虑到中美双方工作层面会谈不断取得进展,市场仍对上半年两国达成贸易协议持乐观态度,带动此前受贸易战负面冲击最多的科技板块反弹。此外,美联储在2019年的政策立场明显转为鸽派,继续加息和收缩联储资产负债表的节奏和力度将大为减弱,因而美元指数走弱,国际资金流入新兴市场,对港股和A股带来部分增量资金。A股市场在年初以来流动性放松、MSCI指数提高A股纳入权重、科创板推出提速等因素推动下大幅反弹,对港股市场也有带动作用。今年人大会议上总理政府工作报告中对房地产调控的措辞减少,并且强调今后将坚持分城施策的调控方针。市场预期,今年一二线楼市调控政策将可能边际放松,同时叠加大部分中资港股地产开发商新公布的2018年业绩和2019年合约销售展望基调积极,带动中资地产板块上扬。汽车板块也在流动性改善预期下股价上行。

按照人民币计价调整之后的MSCI分类指数表现来看,一季度表现最好的是可选消费板块,大幅反弹29.3%,主要是汽车板块在货币流动性改善预期带动下上涨。信息科技板块上涨24.5%,主要受到中美贸易谈判取得进展和网络游戏板块回复版号审批所带动。去年下跌较多的医疗服务和必需消费板块也反弹22.7%和19.0%。涨幅最弱的是公用事业板块,小幅上涨1.5%。工业、电信服务、能源和金融板块分别上涨8.0%、9.6%、9.8%、9.8%。一季度我们增持了政策风险释放较为充分的民办教育类股、受益于基建投资增速上升的铁路类股、未来业绩增长较为确定的物业管理板块,部分减持了销售增速放缓的地产开发商类股和原材料类股。一季度由于投资组合股票仓位较低,同时短期涨幅较高的信息科技和医疗板块配置比例较低,因此投资组合跑输业绩基准。

本报告期基金份额净值增长率为10.84%,业绩比较基准收益率为13.44%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	306,477,522.64	72.78
	其中:普通股	306,123,453.66	72.69
	优先股	-	-
	存托凭证	354,068.98	0.08
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	111,528,686.15	26.48
8	其他资产	3,110,971.53	0.74
9	合计	421,117,180.32	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	306,123,453.66	73.84
美国	354,068.98	0.09
合计	306,477,522.64	73.93

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
房地产	100,979,485.29	24.36
非日常生活消费品	46,139,281.93	11.13
工业	10,155,781.61	2.45
公用事业	21,370,830.84	5.16
金融	54,366,561.26	13.11
能源	10,312,289.45	2.49
通信服务	154,829.39	0.04
信息技术	15,585,379.69	3.76
医疗保健	7,359,156.82	1.78
原材料	40,053,926.36	9.66
合计	306,477,522.64	73.93

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港	香港	9,206,000	40,431,246.88	9.75
2	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港	香港	7,712,000	38,037,421.49	9.18
3	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	2007 HK	香港	香港	2,187,000	22,999,344.40	5.55
4	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	香港	香港	1,878,000	20,941,854.78	5.05
5	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	香港	香港	3,343,000	17,836,225.92	4.30
6	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	香港	香港	4,210,000	17,803,493.02	4.29
7	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	香港	香港	829,500	13,860,584.55	3.34
8	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港	香港	3,090,000	12,855,128.48	3.10
9	KWG GROUP HOLDINGS LTD	合景泰富集团	1813 HK	香港	香港	1,342,500	10,905,371.80	2.63
10	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	香港	香港	1,786,000	9,483,055.82	2.29

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,809,756.78
3	应收股利	270.20
4	应收利息	5,091.53
5	应收申购款	295,853.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,110,971.53

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	282,889,293.84
报告期期间基金总申购份额	18,157,143.95
减:报告期期间基金总赎回份额	44,470,555.33
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	256,575,882.46

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金合同;

华宝海外中国成长混合型证券投资基金招募说明书;

华宝海外中国成长混合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。

9.2 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。

9.3 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4月19日