华宝宝康灵活配置证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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	华宝宝康配置混合
基金主代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年7月15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	162,068,068.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	规避系统风险,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略,以债券投资为基础,并把握股市重大投资机会,获取超额回报,同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×65%+沪深300指数收益率×35%。

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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	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	19,792,200.93
本期利润	59,331,687.79
加权平均基金份额本期利润	0.3575
本期基金份额净值增长率	22.16%
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	0.9434
期末基金资产净值	314,960,685.79
期末基金份额净值	1.9434

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

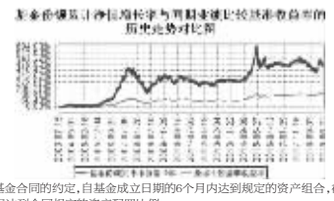
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.58%	0.95%	2.23%	0.40%	3.35%	0.55%
过去三个月	-0.66%	1.28%	0.15%	0.52%	-0.81%	0.76%
过去六个月	22.16%	1.27%	10.53%	0.53%	11.63%	0.74%
过去一年	5.47%	1.20%	7.74%	0.53%	-2.27%	0.67%
过去三年	4.41%	0.88%	15.83%	0.39%	-11.42%	0.49%
自基金合同生效日起至今	501.26%	1.13%	146.63%	0.60%	354.62%	0.53%

注:1、本基金业绩比较基准为:中证综合债指数收益率×65%+沪深300指数收益率×35%。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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2004年1月15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(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、华油天然气基金、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、华宝裕纯债基金、华宝六年健康基金、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		
李鹏	本基金基金经理、华宝第三产业混合基金经理	2013年8月27日	-	12年	硕士,拥有CFA资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理工作。2011年4月加入华宝基金管理有限公司,担任高级策略分析师兼基金经理助理等职务。2013年8月起任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2015年5月至2017年5月任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理,2015年5月至2017年12月任华宝先进成长混合型证券投资基金的基金经理,2017年5月起任华宝第三产业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、《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金契约》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,宝康灵活配置证券投资基金在短期内出现过国债投资占基金资产净值低于20%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,A股在经历了一季报的大幅反弹之后,二季度有所回落。上半年各指数都录得正收益,沪深300上涨26.48%,上证指数上涨17.25%,中小板指数上涨18.99%,创业板指数上涨20.87%,深成指上涨23.06%。一季度市场在流动性放松和中美贸易战缓解的背景下,出现了一轮快速强劲的反弹,其中以创业板反弹力度较强。进入四月份以后,中美贸易谈判又出现了一定反复,而同时国内流动性宽松势头出现了一定预期的降低,导致四月份市场出现了快速回落;而同时由于美国威胁打压华为等国内高科技企业,使得市场对部分科技和出口行业的预期出现了恶化,导致市场下跌过程中,科技、出口和创业板等板块跌幅靠前。市场进入六月以后,在贸易谈判缓解和国内保增长加码的预期下,A股出现了一定反弹,特别是6月份习特会之后暂缓加税,使得市场情绪出现了较大的好转。上半年分行业来看,食品饮料、农林牧渔、非银金融等板块表现较好,板块涨幅都超过四成,市场以白酒为首的消费板块以及MSCI倾向的白马龙头都表现较好。值得强调的是,部分上证50中优质龙头企业股价在二季度逆势创出新高,中国平安、贵州茅台、五粮液、招商银行、恒瑞医药、中国国旅、上海机场等都逆势上涨,弱势背景下,资金存在明显的倾向。

回顾上半年,本基金操作基本踏准了市场脉搏,一季度维持较高仓位并重仓科技板块;二季度高位减仓,重仓食品饮料和养殖板块,市场下跌后又加仓科技和券商等板块,波段和选股都不错,主动选股业绩突出,大幅超越基金基准,总体业绩表现尚可,预计下一阶段仍将保持紧跟市场主要方向。

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22.16%,业绩比较基准收益率为10.53%。

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2019年下半年,国内经济总体平稳,不会有大的经济波动。尽管中美贸易战仍将焦灼,但是预计双方将向着达成协议努力。随着全球经济的进一步回落,理性来看,美国方面无休止的贸易施压已经越来越受到其国内外的限制,有利于贸易战的缓解。从长期来看,中美两国的贸易和科技纷争仍将长期存在,但是我预测最微观的阶段已经过去,下一阶段将朝着理性协调、共同发展的方向前进。在此背景下,预计下半年的国内外市场情绪将有所好转。此外,经济不景气,也使得美联储和世界各国央行停止了紧缩的步伐,下一步降息甚至明显的宽松政策都可能出现。二季度以来,MSCI的资金进一步流入A股市场,而这些资金的选择标的具有明显的倾向,这进一步加剧了大盘优质股票和少数股票的筹码集中,而目前市场的上涨的主要动力也来自于此。全球资金加大A股配置的重要阶段;在这一过程中,无论是对A股传统的投资方法、定价模式,还是资金话语权都在发生深刻变化;而目前证监会推行的注册制、退市制度等措施又在加速国内股市生态向机构化和价值化转型,我们需要格外重视这一变化。

就长期而言,我们对中国经济转型所带来的投资前景充满信心,中国作为世界发展格局中无论经济还是科技的重要推手地位已经越来越明确,中国的崛起已经不可阻挡。但是面对复杂的国际和流动性环境,我们需要保持耐心,我们将继续保持此前小心谨慎的投资风格,需要紧密关注国内外宏观经济和政策变化,仓位较为灵活;标的选择上将紧密跟踪各行业景气度变化,精选优秀的公司并长期持有,分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。感谢基金持有人一直以来对我们的支持,我们将继续勤勉尽责,努力为持有人创造好的回报。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,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:华宝宝康灵活配置证券投资基金

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
资 产:			
银行存款		3,317,600.62	38,714,518.05
结算备付金		1,250,135.70	1,694,789.29
存出保证金		215,192.53	249,697.03
交易性金融资产		305,682,911.64	229,845,517.04
其中:股票投资		229,806,414.44	162,695,517.04
基金投资		-	-
债券投资		75,876,497.20	67,150,000.00
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		5,060,369.72	1,081,868.88
应收利息		1,596,640.19	1,217,194.08
应收股利		-	-
应收申购款		8,035.52	12,620.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		317,130,885.92	272,816,206.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		-	1,165,966.27
应付赎回款		213,273.22	63,535.16
应付管理人报酬		325,780.88	304,546.55
应付托管费		62,650.17	58,566.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		993,482.84	920,732.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		575,013.02	653,432.55
负债合计		2,170,200.13	3,166,779.93
所有者权益:			
实收基金		162,068,068.25	169,504,977.51
未分配利润		152,892,617.54	100,144,447.84
所有者权益合计		314,960,685.79	269,649,425.35
负债和所有者权益总计		317,130,885.92	272,816,206.28

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.9434元,基金份额总额162,068,068.25份。

6.2 利润表

会计主体:华宝宝康灵活配置证券投资基金

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 2019年1月1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
一、收入		64,833,043.48	-16,701,489.72
1.利息收入		1,362,445.54	1,657,637.50
其中:存款利息收入		74,955.88	132,441.56
债券利息收入		1,287,489.66	1,525,195.94
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)		23,900,354.75	29,566,229.33
其中:股票投资收益		22,252,615.71	27,997,096.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-320,069.04	-32,650.00
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		1,967,808.08	1,601,783.11
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		39,539,486.86	-47,963,971.45
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		30,756.33	38,614.90
减:二、费用		5,501,355.69	6,019,619.86
1. 管理人报酬		1,953,184.97	2,210,426.00
2. 托管费		375,612.46	425,081.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,074,454.31	3,287,639.32
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		98,103.95	96,472.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		59,331,687.79	-22,721,109.58
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		59,331,687.79	-22,721,109.58

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝宝康灵活配置证券投资基金

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 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)	169,504,977.51	100,144,447.84	269,649,425.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	59,331,687.79	59,331,687.79
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)	-7,436,909.26	-6,583,518.09	-14,020,427.35
其中:1.基金申购款	2,327,453.07	1,953,496.99	4,280,950.06
2.基金赎回款	-9,764,362.33	-8,537,015.08	-18,301,377.41
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)	162,068,068.25	152,892,617.54	314,960,685.79
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)	179,542,110.58	175,464,470.51	355,006,581.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-22,721,109.58	-22,721,109.58
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)	-8,955,828.54	-8,999,928.70	-17,955,757.24
其中:1.基金申购款	2,428,982.80	2,341,714.15	4,770,696.95
2.基金赎回款	-11,384,811.34	-11,341,642.85	-22,726,454.19
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)	170,586,282.04	143,743,432.23	314,329,714.27

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:

_____黄小薏_____ _____向辉_____ _____张幸骏_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝宝康系列开放式证券投资基金(原名为华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金,以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第62号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》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《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于2003年7月15日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为宝康灵活配置证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康消费品证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,893,701,931.41元,其中包括本基金人民币1,066,581,834.53元、宝康消费品证券投资基金人民币1,540,046,055.09元和宝康债券投资基金人民币1,287,074,041.79元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第96号验资报告予以验证。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》,华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金之宝康灵活配置证券投资基金于2017年12月30日起更名为华宝宝康系列开放式证券投资基金之宝康灵活配置证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝宝康系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等;股票投资方面,主要投资对象为上证180指数、深证100指数的成分股。在正常的市场情况下,本基金组合投资的基本范围为指数的成分股。在正常市场情况下,本基金组合投资范围为:债券20%-90%,股票5%-75%;现金5%以上。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率×65%+沪深300指数收益率×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于2019年8月29日批准报出。

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契约》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。

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2019年1月1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	1,953,184.97	2,210,426.00
其中:支付销售机构的客户维护费	30,910.36	30,337.08

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1.30%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X1.30%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1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	375,612.46	425,081.94

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券 (含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2019年1月1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
基金合同生效日(2003年7月15日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	209,033.80	209,033.80
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	209,033.80	209,033.80
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1300%	0.1200%

注:基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1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
中国建设银行	3,317,600.62	59,783.05	36,844,909.96	117,545.45

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	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

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。

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
600485	*ST信威	2016年12月26日	重大事项停牌	5.97	2019年7月12日	13.86	1,438	49,048.30	8,584.86	-

注:本基金截至2019年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除