华宝海外中国成长混合型证券投资基金 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

基金名称	华宝海外中国成长混合型证券投资基金
基金简称	华宝海外中国混合
基金主代码	241001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年05月07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	245,974,748.76份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	-	纽约梅隆银行
	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
注册地址		-	One Wall Street New York, NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		-	NY10286

2.5 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	本基金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。

§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	2,410,504.83
本期利润	47,038,249.29
加权平均基金份额本期利润	0.1810
本期加权平均净值利润率	11.64%
本期基金份额净值增长率	11.73%
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	-61,992,587.80
期末可供分配基金份额利润	-0.2520
期末基金资产净值	400,811,133.17
期末基金份额净值	1.629
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	62.90%

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、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。

4、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)。

3.2 基金净值表现

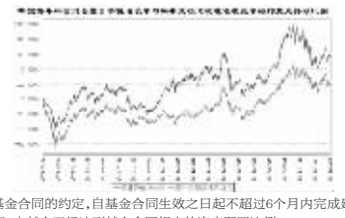
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.44%	0.92%	6.79%	1.10%	-1.35%	-0.18%
过去三个月	0.80%	1.12%	-2.87%	1.00%	3.67%	0.12%
过去六个月	11.73%	1.06%	10.18%	1.07%	1.55%	-0.01%
过去一年	-7.60%	1.47%	-6.44%	1.26%	-1.16%	0.21%
过去三年	37.93%	1.30%	46.71%	1.09%	-8.78%	0.21%
自基金合同生效起至今	62.90%	1.42%	24.10%	1.66%	38.80%	-0.24%

注:1、本基金业绩比较基准为:中证海外内地股指数。

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		
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	-	20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起月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

4.3 管理人对投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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年港股市场在中国社融数据一季度超预期增长、美联储货币政策立场转向鸽派、以及中美贸易谈判在二季度出现反复导致贸易摩擦升级等因素作用下先涨后跌,按照人民币计价,恒生指数上涨10.5%,恒生国企指数上涨7.6%,中证海外内地指数上涨10.2%。一季度社会融资总规模达到81000亿元,同比增长39.6%,明确地表现出宏观经济政策短期内侧重于稳增长的目标,因此极大地提振了市场信心,带动港股上涨。美联储在2019年的政策立场明显转为鸽派,进入二季度之后,市场普遍预期联储将于近期开始降息已应对美国经济增速放缓,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。4月下旬中国中央政治局会议研讨经济形势,由于一季度经济增速达到6.4%且好于预期,会议重提结构性去杠杆和"房住不炒",市场解读为货币政策将由此前的宽松转向中性,地产、周期股显著下跌。5月上旬中美第11轮贸易谈判未能取得进展,美国宣布对2000亿美元中国输美商品关税由10%提高到25%,中国宣布将对600亿美元进口美国商品加征关税,贸易摩擦进一步升级。其后美国又以国家安全为理由,限制美国厂商向华为提供核心零部件和基础服务,两国贸易摩擦向科技战蔓延。受此影响,市场风险偏好大幅下降,手机产业链、科技类股、汽车类股和其他可选消费股大幅下跌。

按照人民币计价调整之后的MSCI分类指数表现来看,上半年表现最强的是必需消费和可选消费板块,分别上涨26.3%和25.5%,主要是非洲猪瘟疫情推动猪肉类股下半年盈利预期改善,餐饮类和纺织服装类股盈利增速强劲带动可选消费行业表现。医疗服务类股因行业监管政策好于此前市场预期而反弹15.6%,信息科技类股受到网络游戏恢复版号审批利好消息带动上涨14.8%。受到国际原油价格下跌拖累,能源板块上半年下跌0.1%。工业、公用事业和电信服务板块因缺乏较强盈利催化剂而表现平稳,分别上涨1.9%、3.4%和4.9%。金融和原材料板块分别上涨9.2%和9.3%。上半年我们我们减持了部分涨幅已经较高的地产开发商类股,减持了销售增速低迷的国产汽车类股,增持了未来三年业绩成长确定性高的物业管理类股,增持了政策监管风险减小的民办教育类股,小幅增持了受益于猪肉价格上涨的养殖类股。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为11.73%,同期业绩比较基准收益率为10.18%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中美两国首脑于6月底日本大阪举行的G20会议上会面,双方商定将不会进一步扩大加征关税的商品范围,将于近期重启贸易谈判。我们预期中美将在下半年进行多轮贸易谈判,美国对华为的供货限制可能也将放松。如果贸易谈判全面破裂,中美展开全方位关税报复,对美国经济、美国股市和美国普通消费者生活成本可能造成显著冲击,对特朗普争取明年总统大选连任十分不利。因此中美双方都有通过谈判达成双方都可以接受的协议的诉求,但双方要能调和政策立场,照顾彼此关切,需要较长的谈判时间,短期内取得突破可能性不大。7月底中央政治局会议将总结上半年经济运行情况,并给下半年经济政策定调,估计可能兼顾"稳增长"和"结构性去杠杆",宏观政策总体保持稳定。下半年宏观经济增速可能在低位企稳。8月将进入港股上市公司半年报业绩期,届时业绩和下半年指引超预期的公司有望有良好表现。我们估计下半年前期涨幅较大、估值较高而与宏观经济增速关系较为密切的板块可能股价出现回调。我们将继续侧重内需驱动、增长持续且估值合理的板块进行布局。

4.7 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。基金在采用新投资策略或投资新品种时,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

基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算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公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式,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。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。

(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》相关规定,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》的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,并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。必要时基金经理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。

4.8 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。

4.9 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履行的义务。

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:华宝海外中国成长混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	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	113,610,164.29	141,970,624.56
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	279,937,207.68	267,054,797.96
其中:股票投资	279,937,207.68	267,054,797.96
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	6,505,340.09	6,317,430.39
应收利息	5,072.44	4,881.85
应收股利	5,118,597.36	415,095.47
应收申购款	359,442.99	420,083.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	405,535,824.85	416,182,913.32
负债和所有者权益	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	9.65	8.71
应付赎回款	3,734,314.47	2,436,359.82
应付管理人报酬	578,340.36	640,803.52
应付托管费	112,455.06	124,600.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	163,234.56	158,650.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	136,337.58	234,793.47
负债合计	4,724,691.68	3,595,216.28
所有者权益:		
实收基金	245,974,748.76	282,889,293.84
未分配利润	154,836,384.41	129,698,403.20
所有者权益合计	400,811,133.17	412,587,697.04
负债和所有者权益总计	405,535,824.85	416,182,913.32

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.629元,基金份额总额245,974,748.76份。

6.2 利润表

会计主体:华宝海外中国成长混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一,收入	51,862,352.53	-24,815,612.78
1.利息收入	64,871.32	199,355.86
其中:存款利息收入	64,871.32	199,355.86
债券利息收入	-	-
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)	7,981,567.47	21,251,521.99
其中:股票投资收益	996,433.10	12,378,159.88
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	6,985,134.37	8,873,362.11
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	44,627,744.46	-48,397,349.72
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-962,304.87	1,433,334.99
5.其他收入(损失以"-"号填列)	150,474.15	697,524.10
减:二,费用	4,824,103.24	8,370,583.96
1. 管理人报酬	3,609,899.83	5,885,331.25
2. 托管费	701,924.92	1,144,369.94
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	417,002.21	1,250,490.03
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	365.64
7. 其他费用	95,276.28	90,027.10
三,利润总额(亏损总额以"-"号填列)	47,038,249.29	-33,186,196.74
减:所得税费用	-	-
四,净利润(净亏损以"-"号填列)	47,038,249.29	-33,186,196.74

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝海外中国成长混合型证券投资基金

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)	282,889,293.84	129,698,403.20	412,587,697.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	47,038,249.29	47,038,249.29
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)	-36,914,545.08	-21,900,268.08	-58,814,813.16
其中:1.基金申购款	37,667,055.68	20,736,300.34	58,403,356.02
2.基金赎回款	-74,581,600.76	-42,636,568.42	-117,218,169.18
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)	245,974,748.76	154,836,384.41	400,811,133.17
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)	411,338,631.89	357,923,305.73	769,261,937.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-33,186,196.74	-33,186,196.74
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)	-103,549,066.17	-90,022,847.83	-193,571,914.00
其中:1.基金申购款	188,020,330.26	167,975,613.56	355,995,943.82
2.基金赎回款	-291,569,396.43	-257,998,461.39	-549,567,857.82
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)	307,789,565.72	234,714,261.16	542,503,826.88

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

华宝海外中国成长混合型证券投资基金(原名为华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金、华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金,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")证监基金字[2007]第333号《关于同意华宝兴业海外中国成长股票型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)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业海外中国成长股票型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,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462,646,980.69元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第062号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》于2008年5月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为462,709,489.02份基金份额,其中认购资金利息折合62,508.33份基金份额。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,境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金于2015年7月22日公告后更名为华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金。

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》,华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金于2017年12月30日起更名为华宝海外中国成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为股票、固定收益证券、银行存款和法律法规允许的其他投资工具,其中股票投资范围包括香港证交所上市的所有股票和在新加坡、美国上市的中国公司,中国公司指收入的50%以上来源于中国大陆的公司;固定收益证券投资范围为具有标准普尔评级为"A"以上或同等评级的发行人在中国证监会认可的中国大陆以外市场(包括香港、新加坡、美国)发行的固定收益证券,在流动性充足的情况下,主要投资香港债券市场。本基金各类资产配置的比例范围是: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%。本基金的业绩比较基准原为MSCI China Free指数(以人民币计算);自2017年8月23日起,本基金的业绩比较基准变更为中证海外内地股指数。

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》、《华宝海外中国成长混合型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。

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于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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的说明

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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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的转让收入免征增值税,对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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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
纽约梅隆银行股份有限公司("纽约梅隆银行")(The Bank of New York Mellon Corporation)	境外资产托管人
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。

6.4.8 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	3,609,899.83	5,885,331.25
其中:支付销售机构的客户维护费	742,222.19	1,347,345.57

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1.8%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×1.8% / 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	701,924.92	1,144,369.94

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0.35%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× 0.35% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

该基金没有销售服务费用。

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(2008年5月7日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,594,043.39	2,594,043.39
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,594,043.39	2,594,043.39
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.05%	0.84%

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

本基金本报告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 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
纽约梅隆银行	88,900,057.80	49.37	54,525,489.05	42.15
中国建设银行	24,710,106.49	64,821.95	32,031,895.66	190,559.83

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管,按适用利率或约定利率计息。

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

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。

6.4.9.2 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