

# 华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金

## 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：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。

## 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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</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.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝转型升级混合
基金主代码	001967
交易代码	001967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 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	53,315,768.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>股票市场是国民经济的晴雨表，一个国家的经济转型和产业升级进程深刻影响着股市大势和不同行业个股的兴衰起伏。本基金将根据我国不同行业所处的发展阶段以及相关产业政策，借鉴其他国家在经济转型升级过程中产业变迁的经验，采用自上而下和自下而上相结合的方法，选择符合转型升级方向的优势行业和优质企业进行投资。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益率投资工具，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。</p>

	<p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		孔祥清	田国立

### 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	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1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	5,881,355.42
本期利润	7,811,920.62
加权平均基金份额本期利润	0.1397
本期加权平均净值利润率	14.90%
本期基金份额净值增长率	15.82%
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	-3,382,514.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0634
期末基金资产净值	49,933,254.00
期末基金份额净值	0.937
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	-6.30%

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	2.18%	0.80%	2.57%	0.66%	-0.39%	0.14%
过去三个月	-8.85%	1.29%	-1.48%	0.86%	-7.37%	0.43%
过去六个月	15.82%	1.41%	14.52%	0.86%	1.30%	0.55%
过去一年	-7.23%	1.37%	5.87%	0.84%	-13.10%	0.53%
过去三年	-7.04%	1.09%	10.62%	0.62%	-17.66%	0.47%

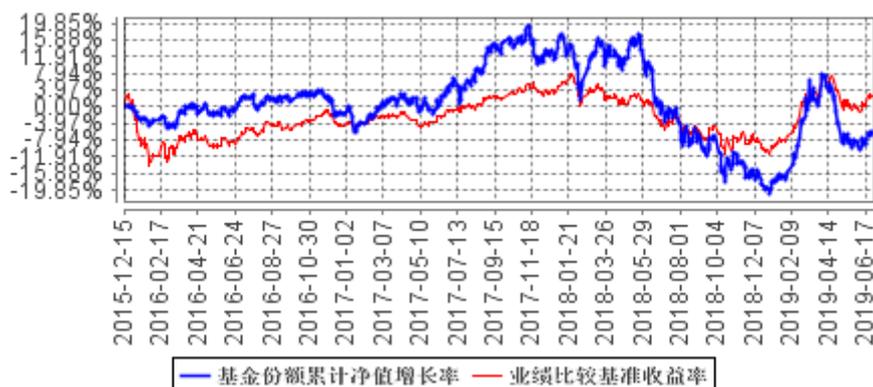
自基金合同生效日起至今	-6.30%	1.02%	2.51%	0.71%	-8.81%	0.31%
-------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

注： 1、本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×55% +上证国债指数收益率×45%。

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

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：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 2016 年 6 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		
贺喆	本基金基金经理、华宝制造股	2018 年 7 月 2 日	-	8 年	本科。曾在上海从容投资管理有限公司任投资管理部基金经理助理。2013 年 10 月加入华宝基金管理

	票基金经理			<p>有限公司，先后任高级分析师、高级分析师、基金经理助理、基金经理职务。2015 年 7 月至 2018 年 8 月任华宝高端制造股票型证券投资基金基金经理助理。2015 年 7 月至 2019 年 7 月任任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理助理。2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理助理。2018 年 7 月起任华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 8 月起任华宝高端制造股票型证券投资基金基金经理。</p>
--	-------	--	--	---

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合规守信情况的说明

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、《华宝转型升级灵活配置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 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

一季度市场在信用、货币双宽松，贸易摩擦缓和的背景下，对经济的预期转向乐观，市场持续上涨最高接近 3300，万得全 A 最大涨幅达到 39%。年初时对指数的乐观预期基本上得到实现。二季度初，随着宽松政策的边际收紧，市场开始了调整，随后贸易摩擦恶化超出市场预期，PMI、发电耗煤、工业增加值等数据的连续回落，指数随之回吐了近一半的一季度涨幅。

本基金持仓的成长性股票一季度上涨明显，但 4 月份后回调明显，在市场大幅波动中被动调整防御，在这个过程中净值回撤较大。

### 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 15.82%，业绩比较基准收益率为 14.52%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为指数重拾上涨需要实体经济有确凿见底的信号，目前尚看不到上市公司盈利下行趋势的扭转。在盈利前景不明的情况下，制造业投资的回升也许在今年很难看到，房地产投资在“杠杆不能上天”和“房住不炒”的政策背景下，增速也难言乐观。在市场估值处于历史低位附近、没有经济和盈利改善预期的背景下，市场将在接下来一段时间内大概率区间震荡。

在行业方面，由于三季度恰逢科创板开闸，这是我国产业升级、经济转型之国家战略在资本市场的体现和重要尝试，可能成为投资者分享新经济红利的重要场所。本基金将努力在科创板上市企业中发掘代表中国经济未来，有潜力成就伟大的公司，同时，抓住沪深两市中优质科技股的阶段性比价机会。另外，在底线思维基础上，我们预计财政政策大概率会在下半年加码基建投资，因此相关产业链的公司也会有投资机会。

#### 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

本基金基金合同生效于2015年12月15日，截止本报告期末，已连续超过二十个工作日基金资产净值低于五千万元。

## § 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：华宝转型升级灵活配置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	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	4,594,983.73	7,583,364.21
结算备付金		164,668.25	621,237.83
存出保证金		66,375.40	85,225.33
交易性金融资产	6.4.7.2	38,851,747.49	39,741,474.05
其中：股票投资		38,851,747.49	39,741,474.05
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,000,000.00	-
应收证券清算款		781,149.71	390,249.81
应收利息	6.4.7.5	1,067.97	2,079.24
应收股利		-	-
应收申购款		295.57	788.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,460,288.12	48,424,418.65
<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		-	-
应付证券清算款		938,820.27	449,928.04
应付赎回款		5,815.00	-
应付管理人报酬		60,501.18	61,866.76
应付托管费		10,083.51	10,311.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	468,298.68	504,853.68

应交税费		12.42	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	43,503.06	140,000.00
负债合计		1,527,034.12	1,166,959.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	53,315,768.73	58,435,063.54
未分配利润	6.4.7.10	-3,382,514.73	-11,177,604.50
所有者权益合计		49,933,254.00	47,257,459.04
负债和所有者权益总计		51,460,288.12	48,424,418.65

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.937 元，基金份额总额 53,315,768.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝转型升级灵活配置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	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
<b>一、收入</b>		9,009,926.11	-5,897,450.86
1.利息收入		42,048.32	42,091.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,191.48	41,981.68
债券利息收入		1,101.84	109.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,755.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,035,435.63	2,408,638.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,758,964.65	2,112,798.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	17,308.17	51,963.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	259,162.81	243,876.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,930,565.20	-8,359,664.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,876.96	11,483.62
<b>减：二、费用</b>		1,198,005.49	981,209.02

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	388,610.06	558,352.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,768.32	93,058.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	699,411.41	257,817.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.60	0.38
7. 其他费用	6.4.7.20	45,212.10	71,979.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7,811,920.62	-6,878,659.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7,811,920.62	-6,878,659.88

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝转型升级灵活配置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）	58,435,063.54	-11,177,604.50	47,257,459.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,811,920.62	7,811,920.62
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）	-5,119,294.81	-16,830.85	-5,136,125.66
其中：1.基金申购款	864,153.60	-34,477.94	829,675.66
2.基金赎回款	-5,983,448.41	17,647.09	-5,965,801.32
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	53,315,768.73	-3,382,514.73	49,933,254.00

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
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	82,711,966.01	10,382,585.59	93,094,551.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,878,659.88	-6,878,659.88
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)	-21,393,096.04	-2,883,272.43	-24,276,368.47
其中：1.基金申购款	3,873,128.45	454,504.60	4,327,633.05
2.基金赎回款	-25,266,224.49	-3,337,777.03	-28,604,001.52
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)	61,318,869.97	620,653.28	61,939,523.25

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：

          黄小慧                                          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

华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金(原名为华宝兴业转型升级灵活配置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”)证监许可[2015]2249号《关于准予华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金

基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 531,445,718.08 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1414 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 531,567,083.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 121,365.17 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。

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》，华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝转型升级灵活配置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《华宝转型升级灵活配置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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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》、《华宝转型升级灵活配置混合型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

本基金本报告期所采用的会计政策和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 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	4,594,983.73
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:	4,594,983.73

### 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	38,506,110.80	38,851,747.49	345,636.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	38,506,110.80	38,851,747.49	345,636.69

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,000,000.00	-

#### 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	963.95
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	74.10
应收债券利息	-
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	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	29.90
合计	1,067.97

**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	468,298.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	468,298.68

**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	0.17
预提费用	43,502.89
合计	43,503.06

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,435,063.54	58,435,063.54
本期申购	864,153.60	864,153.60
本期赎回(以“-”号填列)	-5,983,448.41	-5,983,448.41
- 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	53,315,768.73	53,315,768.73

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
上年度末	-3,938,462.97	-7,239,141.53	-11,177,604.50
本期利润	5,881,355.42	1,930,565.20	7,811,920.62
本期基金份额交易产生的变动数	-257,241.44	240,410.59	-16,830.85
其中：基金申购款	4,064.60	-38,542.54	-34,477.94
基金赎回款	-261,306.04	278,953.13	17,647.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,685,651.01	-5,068,165.74	-3,382,514.73

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,559.04
其他	714.21
合计	34,191.48

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	234,928,804.98
减：卖出股票成本总额	228,169,840.33
买卖股票差价收入	6,758,964.65

**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1月1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	17,308.17
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	17,308.17

**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1月1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	2,613,976.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,593,274.50
减：应收利息总额	3,394.07
买卖债券差价收入	17,308.17

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 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。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	259,162.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	259,162.81

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	1,930,565.20
——股票投资	1,930,565.20
——债券投资	-
——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	1,930,565.20

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	698.35
转换费收入	1,178.61
合计	1,876.96

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于 30 日的投资人的赎回费全额计入基金资产，对持续持有期大于 30 日但少于 3 个月的投资人，应将不低于赎回费总额 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，应将不低于赎回费总额 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，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。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	699,411.41
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	699,411.41

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	18,707.70
银行费用	1,709.21
合计	45,212.10

## 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
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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
华宝证券	13,479,659.50	2.93%	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华宝证券	12,553.89	2.96%	40,245.02	8.59%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华宝证券	-	-	10,305.12	2.05%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 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	388,610.06

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	238,987.84	340,679.90

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 1.50%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 × 1.50%/ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	64,768.32	93,058.79

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
基金合同生效日（2015年12月15日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	247,035.57	247,035.57
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	247,035.57	247,035.57
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4600%	0.4000%

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。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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	4,594,983.73	29,918.23	15,502,885.75	40,259.78

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 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

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	-

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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市

公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告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**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### **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。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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经营管理及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。

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。

#### **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。

于本报告期末，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约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发行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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 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	4,594,983.73	-	-	-	4,594,983.73
结算备付金	164,668.25	-	-	-	164,668.25

存出保证金	66,375.40	-	-	-	66,375.40
交易性金融资产	-	-	-	-38,851,747.49	38,851,747.49
买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	781,149.71	781,149.71
应收利息	-	-	-	1,067.97	1,067.97
应收申购款	-	-	-	295.57	295.57
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,826,027.38	-	-	-39,634,260.74	51,460,288.12
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	938,820.27	938,820.27
应付赎回款	-	-	-	5,815.00	5,815.00
应付管理人报酬	-	-	-	60,501.18	60,501.18
应付托管费	-	-	-	10,083.51	10,083.51
应付交易费用	-	-	-	468,298.68	468,298.68
应交税费	-	-	-	12.42	12.42
其他负债	-	-	-	43,503.06	43,503.06
负债总计	-	-	-	1,527,034.12	1,527,034.12
利率敏感度缺口	11,826,027.38	-	-	-38,107,226.62	49,933,254.00
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	-	-	-	-	-
银行存款	7,583,364.21	-	-	-	7,583,364.21
结算备付金	621,237.83	-	-	-	621,237.83
存出保证金	85,225.33	-	-	-	85,225.33
交易性金融资产	-	-	-	-39,741,474.05	39,741,474.05
应收证券清算款	-	-	-	390,249.81	390,249.81
应收利息	-	-	-	2,079.24	2,079.24
应收申购款	-	-	-	788.18	788.18
资产总计	8,289,827.37	-	-	-40,134,591.28	48,424,418.65
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	449,928.04	449,928.04
应付管理人报酬	-	-	-	61,866.76	61,866.76
应付托管费	-	-	-	10,311.13	10,311.13
应付交易费用	-	-	-	504,853.68	504,853.68
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	1,166,959.61	1,166,959.61
利率敏感度缺口	8,289,827.37	-	-	-38,967,631.67	47,257,459.04

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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 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的股票和债券，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“自上而下和自下而上相结合”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价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 0-95%投资于股票资产，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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来测试本基金面临的潜在价格风险，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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	38,851,747.49	77.81	39,741,474.05	84.10
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,851,747.49	77.81	39,741,474.05	84.10

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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. 业绩比较基准上升 5%	3,707,794.92	2,636,814.75
2. 业绩比较基准下降 5%	-3,707,794.92	-2,636,814.75	

### 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 06 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一层次的余额为 38,817,877.55 元,属于第二层次的余额为 33,869.94 元,无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日:第一层次 39,741,474.05 元,无属于第二或第三层次的余额)。

(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股票和债券,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)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和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,确定相关股票和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 06 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(2018 年 12 月 31 日:同)。

(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	38,851,747.49	75.50
	其中：股票	38,851,747.49	75.50
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	7,000,000.00	13.60
	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	4,759,651.98	9.25
8	其他各项资产	848,888.65	1.65
9	合计	51,460,288.12	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

金额单位：人民币元

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	2,193,381.90	4.39
C	制造业	15,431,135.87	30.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,301,966.00	6.61
E	建筑业	304,916.00	0.61

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	220,259.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	484,812.28	0.97
J	金融业	13,505,540.44	27.05
K	房地产业	2,834,856.00	5.68
L	租赁和商务服务业	238,106.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	260,040.00	0.52
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	76,734.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	38,851,747.49	77.81

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	54,725	1,969,005.50	3.94
2	600900	长江电力	108,400	1,940,360.00	3.89
3	600104	上汽集团	69,700	1,777,350.00	3.56
4	601398	工商银行	292,000	1,719,880.00	3.44
5	002142	宁波银行	55,100	1,335,624.00	2.67
6	601328	交通银行	201,800	1,235,016.00	2.47
7	601009	南京银行	141,600	1,169,616.00	2.34
8	601318	中国平安	13,000	1,151,930.00	2.31
9	000961	中南建设	132,700	1,149,182.00	2.30
10	601766	中国中车	140,100	1,133,409.00	2.27
11	601688	华泰证券	50,300	1,122,696.00	2.25
12	600030	中信证券	46,700	1,111,927.00	2.23

13	600028	中国石化	203,200	1,111,504.00	2.23
14	600340	华夏幸福	32,000	1,042,240.00	2.09
15	603993	洛阳钼业	244,000	966,240.00	1.94
16	601288	农业银行	266,400	959,040.00	1.92
17	600299	安迪苏	79,800	827,526.00	1.66
18	603638	艾迪精密	33,696	758,160.00	1.52
19	600000	浦发银行	60,400	705,472.00	1.41
20	002415	海康威视	25,400	700,532.00	1.40
21	600873	梅花生物	126,955	608,114.45	1.22
22	600741	华域汽车	26,500	572,400.00	1.15
23	000002	万科 A	18,800	522,828.00	1.05
24	600352	浙江龙盛	29,300	462,061.00	0.93
25	600236	桂冠电力	74,400	450,864.00	0.90
26	601377	兴业证券	58,800	396,312.00	0.79
27	600563	法拉电子	9,600	395,232.00	0.79
28	002546	新联电子	83,300	381,514.00	0.76
29	600674	川投能源	34,800	309,720.00	0.62
30	600761	安徽合力	29,100	279,360.00	0.56
31	600507	方大特钢	27,800	271,884.00	0.54
32	603259	药明康德	3,000	260,040.00	0.52
33	002206	海利得	62,000	256,060.00	0.51
34	600309	万华化学	5,900	252,461.00	0.51
35	601211	国泰君安	13,500	247,725.00	0.50
36	603486	科沃斯	7,780	235,345.00	0.47
37	600636	三爱富	21,100	231,467.00	0.46
38	600282	南钢股份	63,600	222,600.00	0.45
39	600660	福耀玻璃	9,100	206,843.00	0.41
40	603338	浙江鼎力	3,500	205,485.00	0.41
41	002414	高德红外	10,484	201,292.80	0.40
42	600023	浙能电力	43,500	192,270.00	0.39
43	002818	富森美	14,800	189,884.00	0.38
44	600027	华电国际	48,900	184,353.00	0.37
45	002332	仙琚制药	27,000	182,520.00	0.37
46	002353	杰瑞股份	7,200	166,320.00	0.33
47	600886	国投电力	19,900	154,623.00	0.31
48	603203	快克股份	6,600	146,718.00	0.29
49	601633	长城汽车	17,500	144,725.00	0.29
50	603986	兆易创新	1,500	130,050.00	0.26
51	600885	宏发股份	5,200	126,360.00	0.25

52	300316	晶盛机电	9,900	125,631.00	0.25
53	002262	恩华药业	11,600	125,164.00	0.25
54	600285	羚锐制药	14,400	121,392.00	0.24
55	600990	四创电子	2,600	120,952.00	0.24
56	601877	正泰电器	5,000	115,450.00	0.23
57	600585	海螺水泥	2,700	112,050.00	0.22
58	600388	龙净环保	9,000	111,510.00	0.22
59	600884	杉杉股份	10,100	107,565.00	0.22
60	000063	中兴通讯	3,300	107,349.00	0.21
61	601668	中国建筑	18,400	105,800.00	0.21
62	603587	地素时尚	4,500	102,330.00	0.20
63	601800	中国交建	8,800	99,616.00	0.20
64	601186	中国铁建	10,000	99,500.00	0.20
65	600837	海通证券	7,000	99,330.00	0.20
66	601166	兴业银行	5,400	98,766.00	0.20
67	002110	三钢闽光	10,600	98,580.00	0.20
68	601229	上海银行	8,300	98,355.00	0.20
69	600048	保利地产	7,600	96,976.00	0.19
70	600570	恒生电子	1,400	95,410.00	0.19
71	601111	中国国航	9,900	94,743.00	0.19
72	300529	健帆生物	1,500	93,525.00	0.19
73	603848	好太太	5,600	81,816.00	0.16
74	600987	航民股份	12,325	81,468.25	0.16
75	601138	工业富联	6,600	79,530.00	0.16
76	603225	新风鸣	6,300	78,687.00	0.16
77	002396	星网锐捷	3,500	78,540.00	0.16
78	000733	振华科技	4,700	77,456.00	0.16
79	600977	中国电影	4,900	76,734.00	0.15
80	000066	中国长城	7,400	76,072.00	0.15
81	300383	光环新网	4,500	75,465.00	0.15
82	002372	伟星新材	4,140	72,036.00	0.14
83	002449	国星光电	5,400	71,712.00	0.14
84	600011	华能国际	11,200	69,776.00	0.14
85	600085	同仁堂	2,400	69,600.00	0.14
86	300124	汇川技术	3,000	68,730.00	0.14
87	002020	京新药业	5,800	66,816.00	0.13
88	000100	TCL 集团	19,100	63,603.00	0.13
89	300725	药石科技	1,005	62,641.65	0.13
90	300750	宁德时代	900	61,992.00	0.12

91	300349	金卡智能	3,400	60,452.00	0.12
92	601100	恒立液压	1,900	59,622.00	0.12
93	002475	立讯精密	2,400	59,496.00	0.12
94	601088	中国神华	2,900	59,102.00	0.12
95	000338	潍柴动力	4,800	58,992.00	0.12
96	002008	大族激光	1,700	58,446.00	0.12
97	002709	天赐材料	2,400	58,080.00	0.12
98	600566	济川药业	1,900	57,209.00	0.11
99	600426	华鲁恒升	3,800	56,468.00	0.11
100	000528	柳工	7,900	52,614.00	0.11
101	600406	国电南瑞	2,800	52,192.00	0.10
102	601628	中国人寿	1,800	50,976.00	0.10
103	600115	东方航空	8,000	50,160.00	0.10
104	000951	中国重汽	3,100	49,755.00	0.10
105	600050	中国联通	8,000	49,280.00	0.10
106	300170	汉得信息	3,600	48,924.00	0.10
107	002439	启明星辰	1,800	48,420.00	0.10
108	600138	中青旅	3,800	48,222.00	0.10
109	600835	上海机电	2,900	48,140.00	0.10
110	300053	欧比特	4,800	47,904.00	0.10
111	300073	当升科技	2,000	45,940.00	0.09
112	300666	江丰电子	1,200	45,504.00	0.09
113	300236	上海新阳	1,400	45,416.00	0.09
114	300531	优博讯	2,500	43,900.00	0.09
115	300577	开润股份	1,100	38,753.00	0.08
116	600308	华泰股份	8,400	37,464.00	0.08
117	300691	联合光电	2,200	36,168.00	0.07
118	300782	卓胜微	322	35,072.24	0.07
119	600703	三安光电	3,100	34,968.00	0.07
120	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.07
121	000921	海信家电	2,700	33,696.00	0.07
122	000050	深天马 A	2,500	33,600.00	0.07
123	002138	顺络电子	1,900	33,402.00	0.07
124	300638	广和通	600	32,964.00	0.07
125	600060	海信电器	3,800	32,756.00	0.07
126	600271	航天信息	1,400	32,270.00	0.06
127	300188	美亚柏科	1,800	32,094.00	0.06
128	600968	海油发展	8,898	31,587.90	0.06
129	600066	宇通客车	2,400	31,248.00	0.06

130	300408	三环集团	1,600	31,120.00	0.06
131	600029	南方航空	4,000	30,880.00	0.06
132	300438	鹏辉能源	1,900	30,742.00	0.06
133	600498	烽火通信	1,100	30,646.00	0.06
134	002191	劲嘉股份	2,400	29,784.00	0.06
135	300699	光威复材	900	29,430.00	0.06
136	300068	南都电源	2,600	29,380.00	0.06
137	600720	祁连山	3,300	29,007.00	0.06
138	603337	杰克股份	1,400	28,686.00	0.06
139	600111	北方稀土	2,200	28,248.00	0.06
140	002035	华帝股份	2,300	28,014.00	0.06
141	000625	长安汽车	4,100	27,183.00	0.05
142	002001	新和成	1,400	27,006.00	0.05
143	603867	新化股份	975	25,164.75	0.05
144	601238	广汽集团	2,300	25,139.00	0.05
145	002189	中光学	1,100	25,014.00	0.05
146	601225	陕西煤业	2,700	24,948.00	0.05
147	600688	上海石化	4,800	24,768.00	0.05
148	000425	徐工机械	5,400	24,084.00	0.05
149	000069	华侨城 A	3,400	23,630.00	0.05
150	601717	郑煤机	4,100	23,411.00	0.05
151	002456	欧菲光	2,900	22,736.00	0.05
152	002013	中航机电	3,300	22,704.00	0.05
153	601006	大秦铁路	2,800	22,652.00	0.05
154	601698	中国卫通	5,759	22,575.28	0.05
155	603660	苏州科达	1,400	21,826.00	0.04
156	600018	上港集团	3,200	21,824.00	0.04
157	603960	克来机电	770	21,013.30	0.04
158	002901	大博医疗	600	19,728.00	0.04
159	601727	上海电气	3,600	19,368.00	0.04
160	300594	朗进科技	433	19,099.63	0.04
161	600176	中国巨石	2,000	19,060.00	0.04
162	002815	崇达技术	1,200	18,708.00	0.04
163	000877	天山股份	1,600	18,592.00	0.04
164	601233	桐昆股份	1,100	17,061.00	0.03
165	600486	扬农化工	300	16,410.00	0.03
166	002925	盈趣科技	400	15,604.00	0.03
167	300470	日机密封	600	14,904.00	0.03
168	002025	航天电器	600	14,628.00	0.03

169	300747	锐科激光	100	14,001.00	0.03
170	600562	国睿科技	900	13,824.00	0.03
171	601689	拓普集团	900	13,788.00	0.03
172	000651	格力电器	200	11,000.00	0.02
173	600559	老白干酒	800	10,472.00	0.02
174	000513	丽珠集团	300	9,969.00	0.02
175	600582	天地科技	2,800	9,660.00	0.02
176	600418	江淮汽车	1,800	9,288.00	0.02
177	300207	欣旺达	800	9,216.00	0.02
178	000786	北新建材	500	9,065.00	0.02
179	000400	许继电气	1,000	9,060.00	0.02
180	300679	电连技术	300	8,358.00	0.02
181	300482	万孚生物	200	7,540.00	0.02
182	002955	鸿合科技	100	5,884.00	0.01
183	000789	万年青	390	3,907.80	0.01

## 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	4,758,126.00	10.07
2	601688	华泰证券	4,133,694.44	8.75
3	002036	联创电子	4,001,145.00	8.47
4	300677	英科医疗	3,729,299.00	7.89
5	002236	大华股份	3,716,335.00	7.86
6	600104	上汽集团	3,489,637.00	7.38
7	603799	华友钴业	3,075,587.00	6.51
8	600837	海通证券	2,858,098.00	6.05
9	603993	洛阳钼业	2,624,586.00	5.55
10	000961	中南建设	2,578,484.00	5.46
11	603360	百傲化学	2,560,738.20	5.42
12	000783	长江证券	2,439,163.00	5.16
13	600109	国金证券	2,431,537.00	5.15

14	300031	宝通科技	2,357,407.00	4.99
15	601111	中国国航	2,293,965.00	4.85
16	600029	南方航空	2,270,924.00	4.81
17	002597	金禾实业	2,269,818.84	4.80
18	000069	华侨城 A	2,250,602.00	4.76
19	300567	精测电子	2,250,511.00	4.76
20	002343	慈文传媒	2,234,984.00	4.73
21	002241	歌尔股份	2,230,308.00	4.72
22	601398	工商银行	2,203,200.00	4.66
23	600352	浙江龙盛	2,197,345.98	4.65
24	002415	海康威视	2,152,399.70	4.55
25	000887	中鼎股份	2,091,396.00	4.43
26	002659	凯文教育	2,081,825.00	4.41
27	600741	华域汽车	2,074,032.00	4.39
28	300618	寒锐钴业	2,049,024.00	4.34
29	601328	交通银行	1,980,417.00	4.19
30	603180	金牌厨柜	1,950,084.00	4.13
31	300115	长盈精密	1,941,207.00	4.11
32	000625	长安汽车	1,937,216.00	4.10
33	603517	绝味食品	1,936,490.00	4.10
34	600036	招商银行	1,914,118.50	4.05
35	300559	佳发教育	1,903,719.00	4.03
36	002436	兴森科技	1,883,450.00	3.99
37	300395	菲利华	1,858,823.00	3.93
38	600900	长江电力	1,836,535.00	3.89
39	002250	联化科技	1,831,250.00	3.88
40	300438	鹏辉能源	1,812,252.00	3.83
41	002709	天赐材料	1,809,829.00	3.83
42	603363	傲农生物	1,743,644.00	3.69
43	300571	平治信息	1,725,614.00	3.65
44	000671	阳光城	1,712,009.00	3.62
45	600500	中化国际	1,696,351.00	3.59
46	002376	新北洋	1,689,123.00	3.57
47	000732	泰禾集团	1,679,612.00	3.55
48	300568	星源材质	1,651,355.00	3.49
49	300648	星云股份	1,604,095.00	3.39

50	002285	世联行	1,600,372.00	3.39
51	300497	富祥股份	1,597,812.00	3.38
52	600486	扬农化工	1,583,998.00	3.35
53	603595	东尼电子	1,575,132.60	3.33
54	600810	神马股份	1,574,057.00	3.33
55	600000	浦发银行	1,563,196.00	3.31
56	600699	均胜电子	1,558,447.00	3.30
57	603111	康尼机电	1,554,914.00	3.29
58	601288	农业银行	1,506,288.00	3.19
59	300607	拓斯达	1,500,099.00	3.17
60	002142	宁波银行	1,470,278.00	3.11
61	600383	金地集团	1,459,246.00	3.09
62	002409	雅克科技	1,457,178.00	3.08
63	601377	兴业证券	1,450,630.00	3.07
64	600686	金龙汽车	1,444,206.90	3.06
65	603626	科森科技	1,435,139.53	3.04
66	600060	海信电器	1,431,994.00	3.03
67	603678	火炬电子	1,427,168.00	3.02
68	601009	南京银行	1,417,006.00	3.00
69	002497	雅化集团	1,373,976.00	2.91
70	603136	天目湖	1,345,668.00	2.85
71	002737	葵花药业	1,329,230.00	2.81
72	601066	中信建投	1,322,103.00	2.80
73	603929	亚翔集成	1,308,267.00	2.77
74	300261	雅本化学	1,302,941.18	2.76
75	002546	新联电子	1,284,116.00	2.72
76	601233	桐昆股份	1,269,685.00	2.69
77	603197	保隆科技	1,243,622.80	2.63
78	002747	埃斯顿	1,236,193.00	2.62
79	600285	羚锐制药	1,232,575.00	2.61
80	603308	应流股份	1,228,952.00	2.60
81	600446	金证股份	1,212,120.00	2.56
82	300059	东方财富	1,205,988.00	2.55
83	300653	正海生物	1,193,156.00	2.52
84	002410	广联达	1,181,394.00	2.50
85	600028	中国石化	1,175,601.93	2.49

86	000921	海信家电	1,174,903.01	2.49
87	600340	华夏幸福	1,169,198.00	2.47
88	603283	赛腾股份	1,158,713.00	2.45
89	601766	中国中车	1,141,201.90	2.41
90	002214	大立科技	1,125,761.00	2.38
91	601318	中国平安	1,029,678.00	2.18
92	002384	东山精密	992,758.00	2.10
93	600873	梅花生物	988,231.00	2.09
94	300550	和仁科技	986,031.00	2.09
95	603801	志邦家居	983,968.00	2.08
96	603225	新凤鸣	981,243.20	2.08
97	002768	国恩股份	956,042.00	2.02
98	603305	旭升股份	950,091.00	2.01

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002236	大华股份	4,423,637.00	9.36
2	002036	联创电子	3,990,191.00	8.44
3	603799	华友钴业	3,812,861.00	8.07
4	600030	中信证券	3,784,789.40	8.01
5	300677	英科医疗	3,750,567.00	7.94
6	002597	金禾实业	3,633,666.38	7.69
7	603360	百傲化学	3,387,185.80	7.17
8	300031	宝通科技	3,169,932.52	6.71
9	601688	华泰证券	3,009,751.00	6.37
10	600837	海通证券	2,769,749.46	5.86
11	300618	寒锐钴业	2,504,539.60	5.30
12	000069	华侨城 A	2,473,543.00	5.23
13	002343	慈文传媒	2,437,158.00	5.16
14	600109	国金证券	2,422,004.00	5.13
15	000671	阳光城	2,376,135.99	5.03
16	601155	新城控股	2,351,472.38	4.98
17	000783	长江证券	2,345,467.00	4.96

18	002415	海康威视	2,333,112.80	4.94
19	300567	精测电子	2,222,286.06	4.70
20	002624	完美世界	2,220,075.00	4.70
21	002250	联化科技	2,187,302.00	4.63
22	600029	南方航空	2,184,680.00	4.62
23	002376	新北洋	2,157,595.00	4.57
24	300115	长盈精密	2,137,511.00	4.52
25	601111	中国国航	2,126,607.00	4.50
26	603517	绝味食品	2,098,033.00	4.44
27	000887	中鼎股份	2,096,104.00	4.44
28	000002	万科 A	2,023,274.85	4.28
29	600873	梅花生物	2,018,590.32	4.27
30	002546	新联电子	1,982,716.00	4.20
31	002659	凯文教育	1,975,716.00	4.18
32	000625	长安汽车	1,966,185.00	4.16
33	000063	中兴通讯	1,947,229.91	4.12
34	000961	中南建设	1,946,264.13	4.12
35	603993	洛阳钼业	1,920,607.00	4.06
36	300395	菲利华	1,917,873.00	4.06
37	600446	金证股份	1,864,676.00	3.95
38	600352	浙江龙盛	1,857,730.00	3.93
39	600383	金地集团	1,829,454.76	3.87
40	300571	平治信息	1,814,593.00	3.84
41	300429	强力新材	1,809,708.60	3.83
42	600741	华域汽车	1,781,606.49	3.77
43	002709	天赐材料	1,762,723.00	3.73
44	002214	大立科技	1,751,836.00	3.71
45	300497	富祥股份	1,745,998.00	3.69
46	002436	兴森科技	1,736,029.00	3.67
47	002241	歌尔股份	1,734,546.00	3.67
48	000732	泰禾集团	1,733,296.00	3.67
49	600340	华夏幸福	1,708,712.12	3.62
50	300607	拓斯达	1,708,207.95	3.61
51	300559	佳发教育	1,687,966.70	3.57
52	300568	星源材质	1,662,222.00	3.52
53	600486	扬农化工	1,593,775.00	3.37
54	002285	世联行	1,589,281.00	3.36
55	600810	神马股份	1,576,345.00	3.34

56	603678	火炬电子	1,572,256.00	3.33
57	603111	康尼机电	1,570,199.00	3.32
58	001979	招商蛇口	1,557,948.33	3.30
59	002409	雅克科技	1,548,640.00	3.28
60	600104	上汽集团	1,543,275.00	3.27
61	603363	傲农生物	1,538,641.00	3.26
62	603595	东尼电子	1,538,040.00	3.25
63	601066	中信建投	1,535,196.00	3.25
64	002497	雅化集团	1,529,726.00	3.24
65	600500	中化国际	1,526,492.70	3.23
66	300648	星云股份	1,522,887.00	3.22
67	601233	桐昆股份	1,509,538.00	3.19
68	300438	鹏辉能源	1,497,219.00	3.17
69	002228	合兴包装	1,460,952.21	3.09
70	600699	均胜电子	1,457,307.00	3.08
71	603626	科森科技	1,453,474.75	3.08
72	600686	金龙汽车	1,436,564.00	3.04
73	600060	海信电器	1,419,901.11	3.00
74	002152	广电运通	1,403,811.92	2.97
75	600636	三爱富	1,400,528.31	2.96
76	002410	广联达	1,393,756.96	2.95
77	300653	正海生物	1,386,159.22	2.93
78	300261	雅本化学	1,385,679.30	2.93
79	002737	葵花药业	1,375,339.00	2.91
80	600612	老凤祥	1,368,698.00	2.90
81	002174	游族网络	1,365,055.00	2.89
82	603180	金牌厨柜	1,343,909.36	2.84
83	000921	海信家电	1,323,402.37	2.80
84	603197	保隆科技	1,314,941.00	2.78
85	603136	天目湖	1,309,414.00	2.77
86	600229	城市传媒	1,279,873.10	2.71
87	600622	光大嘉宝	1,254,047.36	2.65
88	600406	国电南瑞	1,239,117.52	2.62
89	002555	三七互娱	1,209,069.76	2.56
90	603308	应流股份	1,175,229.00	2.49
91	603283	赛腾股份	1,159,576.00	2.45
92	002747	埃斯顿	1,120,572.00	2.37
93	603929	亚翔集成	1,106,189.70	2.34

94	300059	东方财富	1,105,447.00	2.34
95	600285	羚锐制药	1,069,674.00	2.26
96	002384	东山精密	1,042,503.00	2.21
97	601377	兴业证券	1,031,598.00	2.18
98	603801	志邦家居	1,029,842.00	2.18
99	601668	中国建筑	1,022,562.15	2.16
100	000418	小天鹅 A	1,021,299.10	2.16
101	002465	海格通信	999,959.00	2.12
102	002601	龙蟠佰利	999,477.92	2.11
103	300550	和仁科技	987,678.00	2.09
104	600977	中国电影	987,468.62	2.09
105	002153	石基信息	977,881.00	2.07
106	603305	旭升股份	960,590.00	2.03

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	225,349,548.57
卖出股票收入（成交）总额	234,928,804.98

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

转型升级基金截至 2019 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的中南建设（000961）于 2019 年 3 月 29 日收到深交所通报批评。由于公司存在以下违规行为：2017 年 11 月 11 日，中南建设与深圳市和润达投资有限公司（以下简称“深圳和润达”）、深圳三瑞房地产开发有限公司（以下简称“深圳三瑞”）签署《深圳市罗湖区草埔城中村城市更新项目合作协议》，中南建设与深圳三瑞分别将持有的中南（深圳）房地产开发有限公司（以下简称“中南房地产”）47%和 20%的股权转让与深圳和润达。2017 年 11 月 16 日，中南建设完成了转让中南房地产 47%股权转让的工商变更手

续。2017 年 12 月 8 日，中南建设收到交易方深圳和润达支付的股权转让款。本次交易所产生的投资收益共计金额为 50,100 万元，此次交易在扣除所得税影响后，股权转让产生的净利润为 37,357 万元，占中南建设 2016 年度归母净利润的 92.16%。对于上述重大交易事项，中南建设迟至 2018 年 6 月 7 日才履行信息披露义务，并迟至 2019 年 1 月 17 日才履行股东大会审议程序。

转型升级基金截至 2019 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的交通银行（601328）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）不良信贷资产未洁净转让，理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位，内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力；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视为，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证券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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	66,375.40
2	应收证券清算款	781,149.71
3	应收股利	-
4	应收利息	1,067.97
5	应收申购款	295.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	848,888.65

#### **7.12.4 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。

#### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **7.12.6 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
915	58,268.60	247,035.57	0.46%	53,068,733.16	99.54%

### 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	215,106.40	0.4035%

### 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年12月15日）基金份额总额	531,567,083.25
本报告期期初基金份额总额	58,435,063.54
本报告期期间基金总申购份额	864,153.60
减：本报告期期间基金总赎回份额	5,983,448.41
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	53,315,768.73

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

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

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
长江证券	1	64,036,068.60	13.94%	59,635.42	14.08%	-
天风证券	2	50,249,523.66	10.94%	45,972.52	10.85%	-
万联证券	1	31,142,946.71	6.78%	28,380.48	6.70%	-
兴业证券	2	29,289,932.54	6.38%	26,692.03	6.30%	-
中信建投	2	28,279,719.74	6.16%	25,771.48	6.08%	-
东方证券	2	25,007,423.40	5.44%	23,289.59	5.50%	-
华创证券	1	23,068,385.86	5.02%	21,483.47	5.07%	-
民生证券	1	23,037,015.12	5.02%	21,454.12	5.07%	-
海通证券	1	21,500,253.03	4.68%	20,023.15	4.73%	-
招商证券	2	20,495,906.67	4.46%	18,677.75	4.41%	-
广发证券	2	19,168,438.71	4.17%	17,850.99	4.21%	-
中泰证券	2	17,497,942.60	3.81%	15,946.16	3.76%	-
中信证券	2	15,592,346.22	3.39%	14,521.37	3.43%	-
申万宏源	3	14,618,463.66	3.18%	13,613.81	3.21%	-
华宝证券	1	13,479,659.50	2.93%	12,553.89	2.96%	-
安信证券	1	9,474,771.85	2.06%	8,823.87	2.08%	-
东吴证券	1	8,542,027.80	1.86%	7,955.14	1.88%	-
长城证券	1	8,312,324.95	1.81%	7,741.25	1.83%	-
瑞银证券	1	7,548,149.55	1.64%	7,028.59	1.66%	-
光大证券	1	5,876,879.04	1.28%	5,473.18	1.29%	-
华泰证券	1	4,236,955.60	0.92%	3,945.84	0.93%	-
东北证券	1	3,659,072.70	0.80%	3,407.58	0.80%	-
西部证券	1	3,640,883.56	0.79%	2,589.67	0.61%	-
西南证券	1	3,244,371.75	0.71%	3,021.54	0.71%	-
中投证券	1	2,571,254.00	0.56%	2,394.63	0.57%	-
国泰君安	2	2,058,868.00	0.45%	1,893.22	0.45%	-
方正证券	2	1,898,631.00	0.41%	1,730.24	0.41%	-
银河证券	1	1,690,222.80	0.37%	1,574.12	0.37%	-
国金证券	1	104,583.00	0.02%	97.39	0.02%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-

信达证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-

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，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；适当的区域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2. 本基金本报告期券商交易单元新增：红塔证券。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	128,112.00	2.69%	7,000,000.00	8.06%	-	-
天风证券	413,984.58	8.68%	-	-	-	-
万联证券	1,330,099.28	27.90%	-	-	-	-

兴业证券						
中信建投	222,726.13	4.67%				
东方证券						
华创证券			7,000,000.00	8.06%		
民生证券						
海通证券						
招商证券	567,491.99	11.90%				
广发证券			22,000,000.00	25.35%		
中泰证券	219,205.06	4.60%				
中信证券						
申万宏源	162,257.38	3.40%				
华宝证券						
安信证券			40,800,000.00	47.00%		
东吴证券						
长城证券						
瑞银证券						
光大证券						
华泰证券	1,723,634.50	36.15%				
东北证券						
西部证券						
西南证券						
中投证券			10,000,000.00	11.52%		
国泰君安						
方正证券						
银河证券						
国金证券						
广州证券						
中银国际						
川财证券						
东海证券						
信达证券						
华信证券						
国信证券						
高华证券						
华安证券						
太平洋证券						
东兴证券						

红塔证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-

## 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1月1日
2	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019年1月9日
3	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019年1月21日
4	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、基金管理人网站	2019年1月24日
5	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019年1月24日
6	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019年3月18日
7	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019年3月21日
8	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告	基金管理人网站	2019年3月30日
9	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019年3月30日
10	关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购业务费率优惠公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年4月15日
11	华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019年4月19日
12	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富	上海证券报、证券日报、证券时报、中国	2019年6月12日

	(上海)基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券报、基金管理人网站	
13	关于华宝现金宝 E 货币基金定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 18 日
14	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 22 日
15	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	中国证券报、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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

## § 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；  
华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同；  
华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；  
华宝转型升级灵活配置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。

### 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