

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告（摘要）

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
基金主代码	162413		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 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	57,103,244.34 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-16		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金场内简称:	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金份额总额	1,562,512.00 份	1,562,512.00 份	53,978,220.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混

	合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。	华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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

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	本基金半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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,419,133.50
本期利润	-12,528,304.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1841
本期基金份额净值增长率	-19.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-1.6881
期末基金资产净值	49,556,554.03
期末基金份额净值	0.8678

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、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、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。

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

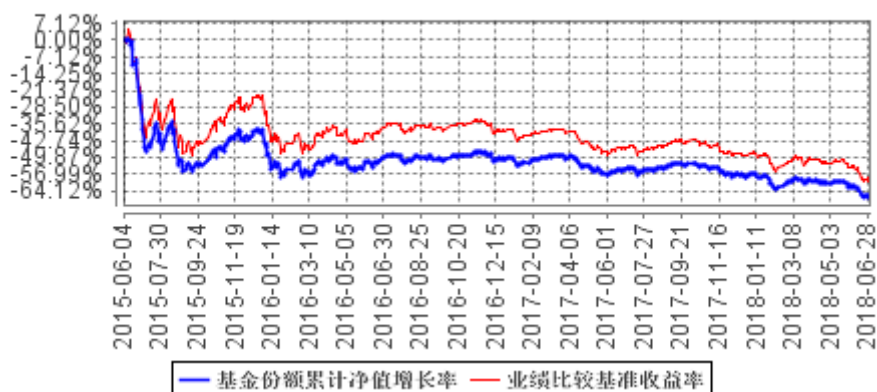
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-10.51%	1.82%	-10.64%	1.87%	0.13%	-0.05%
过去三个月	-16.59%	1.35%	-16.68%	1.38%	0.09%	-0.03%
过去六个月	-19.55%	1.41%	-19.11%	1.43%	-0.44%	-0.02%
过去一年	-24.51%	1.19%	-23.71%	1.21%	-0.80%	-0.02%
过去三年	-55.87%	1.88%	-48.54%	1.92%	-7.33%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	-66.05%	1.95%	-58.70%	1.97%	-7.35%	-0.02%

注：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 2015 年 12 月 4 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（2018 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝新优享基金、华宝银行 ETF、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 153,280,039,194.92 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		
胡洁	量化投资部副总经理、本基金基金经理、上证 180 成长	2015 年 6 月 4 日	-	12 年	金融学硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任上证 180 成

	ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接、华宝中证医疗指数分级、华宝中证军工 ETF、华宝标普中国 A 股红利机会指数 (LOF)、华宝中证银行 ETF（场内简称“银行 ETF”）基金经理			长交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 8 月起兼任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月兼任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月任量化投资部副总经理。
张奇	本基金基金经理助理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接、华宝中证医疗指数分级、华宝中证军工 ETF 基金经理助理	2017 年 4 月 6 日	-	8 年 本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2015 年 5 月起兼任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金

					经理助理，2017 年 4 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 1000 指数分级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

2018 年上半年，国际经济形势较为错综复杂，全球政治经济形式不确定性上升。国内方面，在中国政府坚定的去杠杆的决心之下，经济增速恐有所放缓，经济结构调整大势所趋。国际方面，贸易摩擦不断升温，人民币汇率出现较大波动。在此背景下，政府关注到了市场对中国宏观经济下滑的预期，积极采取了定向降准措施，对冲内外需下降对经济增速的影响。市场表现来看，今年上半年 A 股整体先扬后抑，1 月白马蓝筹股延续了去年的上涨动量，整体表现强势。随后 2 月开始在美股剧烈调整、美联储加息以及贸易战等多因素影响下，A 股开始进入系统性调整。目前，代表新兴经济和高成长的创业板及中小市值股票率先企稳，蓝筹股在持续一年多的稳健上涨后调整幅度较深。指数方面，各主流指数出现不同幅度的下跌。本报告期内，以沪深 300 指数和中证 100 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别下跌了 12.9%和 11.77%；而以中证 500 和中证 1000 为代表的中小盘股指数分别下跌了 16.53%和 20.08%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 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-19.55%，同期业绩比较基准收益率为-19.11%，基金表现落后业绩比较基准 0.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年，中国经济增速可能适度放缓，压力来自经济结构调整与去杠杆。一方面，政府对房地产行业的调控决心空前坚定；另一方面，对于“影子银行”的清理所带来的信用收缩也是大势所趋。经济结构调整必将带来短期阵痛，但有利于经济的长期持续健康发展。央行对货币政策的表态表现了政府对维护经济稳定、不发生系统性风险的信心和决心。总体来说，中国经济

基本面依然向好，金融风险整体可控。随着中国加入 MSCI，A 股市场投资者结构将进一步转变，市场参与者将更加趋于理性及成熟。长期来看，投资者更应该关注上市公司盈利质量和可持续性，经营稳定、已经具有一定规模效应和经营壁垒的行业龙头股和优质白马股更具有长期配置的价值。短期来看，投资者同时可以关注估值修复下的结构性行情机会。中证 1000 指数作为中小市值股票的代表，个股集中度低，行业配置分散，是投资 A 股中小市值公司的有效工具。中证 1000 指数经过了 2017 年以来近一年半的调整，风险释放已经较为充分，估值处于相对底部，估值水平较为合理，投资价值逐步显现。

本基金为分级基金，为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具。作为指数基金的管理人，我们将严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成份股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证 1000 指数的有效跟踪。

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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		3,301,620.70	4,357,559.83
结算备付金		3,507.18	659.67
存出保证金		2,836.83	3,423.38
交易性金融资产		46,825,227.14	67,809,162.38
其中：股票投资		46,825,227.14	67,809,162.38
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		-	-
应收利息		682.33	997.97
应收股利		-	-
应收申购款		146,335.92	90,705.86
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		50,280,210.10	72,262,509.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		367,152.41	1.20
应付赎回款		95,912.75	24,210.13
应付管理人报酬		42,909.31	62,259.51
应付托管费		9,440.06	13,697.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		94,744.48	88,468.04

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		113,497.06	150,011.50
负债合计		723,656.07	338,647.47
所有者权益：			
实收基金		145,955,044.07	170,411,754.42
未分配利润		-96,398,490.04	-98,487,892.80
所有者权益合计		49,556,554.03	71,923,861.62
负债和所有者权益总计		50,280,210.10	72,262,509.09

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.8678 元，基金份额总额 142830020.07 份；华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0223 元，基金份额总额 1562512.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额净值 0.7133 元，基金份额总额 1562512.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-11,957,286.81	-7,953,840.33
1.利息收入		13,517.83	22,169.81
其中：存款利息收入		13,517.83	22,169.81
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）		-6,872,184.03	-1,253,874.89
其中：股票投资收益		-7,212,433.67	-1,596,223.96
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		340,249.64	342,349.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,109,171.25	-6,735,897.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）		10,550.64	13,762.14
减：二、费用		571,017.94	852,663.73
1. 管理人报酬		300,293.22	488,355.17
2. 托管费		66,064.48	107,438.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		41,042.24	61,802.72
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		163,618.00	195,067.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,528,304.75	-8,806,504.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,528,304.75	-8,806,504.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	170,411,754.42	-98,487,892.80	71,923,861.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,528,304.75	-12,528,304.75
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）	-24,456,710.35	14,617,707.51	-9,839,002.84
其中：1.基金申购款	9,920,382.64	-6,037,562.36	3,882,820.28
2.基金赎回款	-34,377,092.99	20,655,269.87	-13,721,823.12
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）	145,955,044.07	-96,398,490.04	49,556,554.03
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	212,869,103.61	-107,892,474.27	104,976,629.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,806,504.06	-8,806,504.06
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）	-23,723,752.29	12,614,196.38	-11,109,555.91
其中：1.基金申购款	5,024,169.42	-2,651,383.39	2,372,786.03
2.基金赎回款	-28,747,921.71	15,265,579.77	-13,482,341.94
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）	189,145,351.32	-104,084,781.95	85,060,569.37

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

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(原华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金,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]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级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 330,638,859.16 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 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售,按照每份基金份额 1.00 元计算,本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额,其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。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》,华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华宝中证 1000 基础份额”)、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华宝中证 1000A 份额”)和华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华宝中证 1000B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额,将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后,华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A

份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%，华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后，根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配；持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份额的分配。经过上述份额折算后，华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算（基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日）：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝

中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 272 号文审核同意，本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数分级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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值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，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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》、《华宝中证 1000 指数分级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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[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：

(a) 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。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 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、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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华宝证券	-	-	192,771.74	0.52%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	179.55	0.53%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

6.4.8.2 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 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	300,293.22
其中：支付销售机构的客户维护费	127,238.30	178,727.56

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% 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 X 1% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
	当期发生的基金应支付的托管费	66,064.48

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 0.22% 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×0.22%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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	3,301,620.70	13,348.75	5,080,602.31	21,912.24

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（2018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	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
000022	深赤湾 A	2017 年 11 月 20 日	重大事项停牌	22.82	2018 年 7 月 10 日	20.55	2,400	42,985.59	54,768.00	-
000029	深深房 A	2016 年 9 月 14 日	重大事项停牌	11.17	-	-	6,200	81,266.58	69,254.00	-
000035	中国天楹	2017 年 8 月 22 日	重大事项停牌	6.72	2018 年 7 月 9 日	6.05	12,400	103,669.00	83,328.00	-
000038	深大通	2018 年 2 月 26 日	重大事项停牌	18.10	-	-	1,580	47,074.98	28,598.00	-
000048	ST 康达	2018 年 5 月 2 日	重大事项停牌	21.90	2018 年 7 月 2 日	20.81	4,200	147,427.74	91,980.00	-
000545	金浦钛业	2018 年 6 月 11 日	重大事项停牌	3.76	-	-	8,700	59,021.77	32,712.00	-
000584	哈工智能	2018 年 3 月 29 日	重大事项停牌	13.87	2018 年 7 月 16 日	12.48	5,900	69,115.60	81,833.00	-
000603	盛达矿业	2018 年 6 月 11 日	重大事项停牌	10.83	2018 年 8 月 21 日	9.75	4,300	76,475.20	46,569.00	-

		日			日						
000666	经纬 纺机	2018年 3月12 日	重大事 项停牌	18.08	-	-	2,200	47,277.01	39,776.00	-	
000673	当代 东方	2018年 5月23 日	重大事 项停牌	18.34	2018年 8月2 日	16.51	5,300	81,250.81	97,202.00	-	
000711	京蓝 科技	2018年 3月26 日	重大事 项停牌	10.02	-	-	4,800	50,152.33	48,096.00	-	
000796	凯撒 旅游	2018年 1月19 日	重大事 项停牌	12.90	2018年 7月19 日	11.61	3,700	61,610.00	47,730.00	-	
000967	盈峰 环境	2018年 5月18 日	重大事 项停牌	8.70	2018年 7月31 日	8.01	6,292	62,334.49	54,740.40	-	
002053	云南 能投	2018年 5月28 日	重大事 项停牌	10.08	2018年 7月13 日	9.07	3,000	36,978.99	30,240.00	-	
002059	云南 旅游	2018年 3月26 日	重大事 项停牌	7.28	-	-	4,000	39,038.10	29,120.00	-	
002086	东方 海洋	2018年 6月15 日	重大事 项停牌	6.68	-	-	5,700	61,665.00	38,076.00	-	
002089	新海 宜	2018年 4月20 日	重大事 项停牌	6.05	2018年 7月20 日	5.45	13,100	144,354.10	79,255.00	-	
002102	冠福	2018年	重大事	4.07	-	-	28,600	131,758.12	116,402.00	-	

	股份	6 月 1 日	项停牌								
002113	天润数娱	2018 年 2 月 1 日	重大事 项停牌	5.78	-	-	9,860	72,116.21	56,990.80	-	-
002121	科陆电子	2018 年 6 月 7 日	重大事 项停牌	6.49	2018 年 8 月 6 日	5.84	7,600	87,418.25	49,324.00	-	-
002171	楚江新材	2018 年 6 月 7 日	重大事 项停牌	6.78	-	-	5,800	58,695.71	39,324.00	-	-
002210	飞马国际	2018 年 4 月 18 日	重大事 项停牌	12.33	-	-	8,980	96,071.16	110,723.40	-	-
002226	江南化工	2018 年 5 月 2 日	重大事 项停牌	5.42	-	-	5,100	41,375.53	27,642.00	-	-
002239	奥特佳	2018 年 4 月 2 日	重大事 项停牌	3.62	-	-	12,800	63,398.10	46,336.00	-	-
002256	兆新股份	2018 年 3 月 2 日	重大事 项停牌	4.52	2018 年 7 月 2 日	4.07	11,300	69,147.91	51,076.00	-	-
002263	*ST 东南	2018 年 2 月 26 日	重大事 项停牌	2.96	-	-	22,900	108,062.28	67,784.00	-	-
002301	齐心集团	2018 年 2 月 2 日	重大事 项停牌	10.50	2018 年 7 月 9 日	9.45	3,900	51,738.83	40,950.00	-	-

002436	兴森科技	2018年 6月14 日	重大事 项停牌	4.29	-	-	15,100	102,706.88	64,779.00	-
002445	中南文化	2018年 6月13 日	重大事 项停牌	8.44	-	-	6,300	119,797.27	53,172.00	-
002464	众应互联	2018年 2月2 日	重大事 项停牌	21.19	2018年 7月31 日	19.07	2,996	87,324.73	63,485.24	-
002502	骅威文化	2018年 6月5 日	重大事 项停牌	5.82	-	-	5,800	80,259.58	33,756.00	-
002609	捷顺科技	2018年 6月19 日	重大事 项停牌	9.52	2018年 7月3 日	8.57	4,200	78,901.70	39,984.00	-
002610	爱康科技	2018年 6月5 日	重大事 项停牌	2.10	-	-	48,800	153,001.70	102,480.00	-
002611	东方精工	2018年 6月19 日	重大事 项停牌	6.17	2018年 7月3 日	6.01	7,040	66,851.15	43,436.80	-
002617	露笑科技	2018年 5月9 日	重大事 项停牌	8.15	-	-	7,399	65,349.81	60,301.85	-
002630	华西能源	2018年 6月20 日	重大事 项停牌	6.54	-	-	11,900	98,700.87	77,826.00	-
002650	加加食品	2018年 3月12 日	重大事 项停牌	4.86	-	-	9,500	67,742.23	46,170.00	-

		日								
002656	摩登大道	2018年 6月19日	重大事 项停牌	9.61	-	-	3,580	49,207.27	34,403.80	-
002668	奥马电器	2018年 6月15日	重大事 项停牌	20.10	-	-	4,820	109,806.08	96,882.00	-
002716	金贵银业	2018年 5月3日	重大事 项停牌	16.84	-	-	4,600	57,704.62	77,464.00	-
002721	金一文化	2018年 5月29日	重大事 项停牌	8.99	2018年 7月9日	8.35	5,600	115,253.58	50,344.00	-
002872	天圣制药	2018年 4月3日	重大事 项停牌	31.05	2018年 7月3日	27.95	900	26,983.80	27,945.00	-
300008	天海防务	2018年 6月4日	重大事 项停牌	4.81	2018年 7月2日	5.20	7,250	64,744.29	34,872.50	-
300090	盛运环保	2018年 6月20日	重大事 项停牌	8.32	2018年 7月4日	7.49	18,000	189,247.64	149,760.00	-
300118	东方日升	2018年 5月7日	重大事 项停牌	10.80	2018年 8月7日	9.63	6,100	90,519.39	65,880.00	-
300131	英唐智控	2018年 5月29日	重大事 项停牌	5.67	-	-	7,200	91,285.11	40,824.00	-
300198	纳川	2018年	重大事	5.99	2018年	5.38	9,580	63,831.94	57,384.20	-

	股份	2月2日	项停牌		8月2日						
300229	拓尔思	2018年4月17日	重大事 项停牌	15.88	2018年7月17日	14.29	2,600	70,337.78	41,288.00	-	
300238	冠昊生物	2018年2月2日	重大事 项停牌	18.87	2018年7月18日	16.96	3,300	144,822.14	62,271.00	-	
300299	富春股份	2018年6月19日	重大事 项停牌	4.67	2018年7月17日	5.14	4,640	53,105.75	21,668.80	-	
300317	珈伟股份	2018年2月5日	重大事 项停牌	11.90	2018年7月3日	10.71	5,325	120,384.39	63,367.50	-	
300343	联创互联	2018年6月19日	重大事 项停牌	10.00	-	-	3,730	76,885.09	37,300.00	-	
300350	华鹏飞	2018年5月10日	重大事 项停牌	8.13	2018年7月16日	7.32	2,840	35,434.86	23,089.20	-	
300362	天翔环境	2018年6月8日	重大事 项停牌	9.68	-	-	2,200	37,864.09	21,296.00	-	
600146	商赢环球	2018年6月19日	重大事 项停牌	22.22	2018年8月15日	20.00	3,000	74,100.00	66,660.00	-	
600165	新日恒力	2018年2月13日	重大事 项停牌	16.51	2018年7月5日	14.06	6,250	70,563.73	103,187.50	-	

600175	美都能源	2018 年 5 月 30 日	重大事 项停牌	4.16	2018 年 8 月 17 日	3.74	28,900	148,909.11	120,224.00	-
600217	中再资环	2018 年 3 月 29 日	重大事 项停牌	6.13	-	-	9,600	69,216.00	58,848.00	-
600226	瀚叶股份	2017 年 11 月 28 日	重大事 项停牌	4.56	-	-	26,806	158,633.06	122,235.36	-
600318	新力金融	2018 年 3 月 23 日	重大事 项停牌	11.04	-	-	5,300	71,635.76	58,512.00	-
600399	抚顺特钢	2018 年 1 月 31 日	重大事 项停牌	5.50	-	-	14,100	128,260.45	77,550.00	-
600490	鹏欣资源	2018 年 4 月 16 日	重大事 项停牌	8.67	-	-	18,000	149,188.07	156,060.00	-
600641	万业企业	2018 年 4 月 17 日	重大事 项停牌	12.18	2018 年 8 月 9 日	10.96	5,500	73,563.85	66,990.00	-
600745	闻泰科技	2018 年 4 月 18 日	重大事 项停牌	30.48	-	-	4,600	107,203.69	140,208.00	-
600764	中国海防	2018 年 4 月 16 日	重大事 项停牌	31.77	-	-	2,200	69,847.99	69,894.00	-
600784	鲁银投资	2018 年 1 月 11 日	重大事 项停牌	5.46	2018 年 7 月 9 日	5.24	7,100	78,823.20	38,766.00	-

		日			日					
600800	天津磁卡	2018年5月22日	重大事件停牌	5.47	-	-	6,600	67,661.68	36,102.00	-
603299	井神股份	2018年6月28日	重大事件停牌	8.25	2018年7月5日	8.48	3,500	49,543.77	28,875.00	-
603636	南威软件	2018年5月29日	重大事件停牌	8.79	-	-	3,600	55,658.31	31,644.00	-
603939	益丰药房	2018年4月17日	重大事件停牌	53.07	2018年7月16日	65.69	2,000	72,093.84	106,140.00	-
603997	继峰股份	2018年5月31日	重大事件停牌	10.87	-	-	2,550	36,434.04	27,718.50	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 2018 年 6 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 42,519,092.69 元，属于第二层次的余额为 4,306,134.45 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 63,255,338.89 元，第二层次 4,553,823.49 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 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。

§ 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	46,825,227.14	93.13
	其中：股票	46,825,227.14	93.13
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	3,305,127.88	6.57
7	其他各项资产	149,855.08	0.30
8	合计	50,280,210.10	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	421,787.90	0.85
B	采矿业	1,077,502.02	2.17
C	制造业	29,756,958.13	60.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,102,712.10	2.23
E	建筑业	1,272,416.54	2.57
F	批发和零售业	1,969,147.72	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,106,043.34	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,722,585.34	9.53
J	金融业	196,881.00	0.40
K	房地产业	1,508,523.67	3.04

L	租赁和商务服务业	612,218.60	1.24
M	科学研究和技术服务业	473,092.90	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	559,873.30	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	465,678.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	801,132.86	1.62
S	综合	400,625.50	0.81
	合计	46,447,178.92	93.73

7.2.2 期末积极投资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	-	-
C	制造业	254,378.00	0.51
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	69,254.00	0.14
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	-	-
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	54,416.22	0.11
	合计	378,048.22	0.76

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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

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	300142	沃森生物	15,800	315,684.00	0.64
2	600779	水井坊	4,400	243,012.00	0.49
3	300347	泰格医药	3,900	241,293.00	0.49
4	300601	康泰生物	3,245	201,352.25	0.41
5	300168	万达信息	9,300	189,720.00	0.38
6	300176	鸿特科技	2,100	174,153.00	0.35
7	600567	山鹰纸业	41,100	158,646.00	0.32
8	002821	凯莱英	1,800	157,014.00	0.32
9	002507	涪陵榨菜	6,100	156,648.00	0.32
10	600490	鹏欣资源	18,000	156,060.00	0.31

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fsfund.com 的半年度报告正文。

7.3.2 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

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	000048	康达尔	4,200	91,980.00	0.19
2	600399	抚顺特钢	14,100	77,550.00	0.16
3	000029	深深房 A	6,200	69,254.00	0.14
4	002263	*ST 东南	22,900	67,784.00	0.14
5	600784	鲁银投资	7,100	38,766.00	0.08

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	300176	鸿特科技	162,617.20	0.23
2	601699	潞安环能	153,736.00	0.21
3	300601	康泰生物	145,835.00	0.20
4	002507	涪陵榨菜	143,028.00	0.20
5	002821	凯莱英	108,890.00	0.15
6	000697	炼石有色	102,102.00	0.14
7	002727	一心堂	97,950.00	0.14
8	300558	贝达药业	97,289.00	0.14
9	600200	江苏吴中	88,624.00	0.12
10	603399	吉翔股份	87,071.00	0.12
11	000799	酒鬼酒	82,940.00	0.12
12	000507	珠海港	82,015.00	0.11
13	002292	奥飞娱乐	79,942.00	0.11
14	000710	贝瑞基因	78,865.00	0.11
15	601100	恒立液压	76,833.00	0.11
16	600146	商赢环球	74,100.00	0.10
17	601929	吉视传媒	72,880.00	0.10
18	300091	金通灵	71,898.00	0.10
19	600851	海欣股份	71,794.00	0.10
20	002020	京新药业	70,527.40	0.10

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	300418	昆仑万维	159,556.00	0.22
2	002600	领益智造	156,835.00	0.22
3	603885	吉祥航空	146,975.80	0.20

4	300308	中际旭创	105,268.00	0.15
5	002302	西部建设	103,016.00	0.14
6	002647	民盛金科	99,218.40	0.14
7	002625	光启技术	96,875.80	0.13
8	002509	天广中茂	88,757.56	0.12
9	000518	四环生物	87,901.00	0.12
10	600777	新潮能源	87,632.00	0.12
11	000980	众泰汽车	84,184.00	0.12
12	000735	罗牛山	79,942.00	0.11
13	600057	厦门象屿	77,419.00	0.11
14	002212	南洋股份	76,214.00	0.11
15	000553	沙隆达 A	67,315.00	0.09
16	600620	天宸股份	65,977.00	0.09
17	000042	中洲控股	62,626.00	0.09
18	600258	首旅酒店	62,486.00	0.09
19	000752	西藏发展	58,522.00	0.08
20	300086	康芝药业	57,835.50	0.08

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	7,820,756.16
卖出股票收入（成交）总额	16,483,086.48

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。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2

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	2,836.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	682.33
5	应收申购款	146,335.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,855.08

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600490	鹏欣资源	156,060.00	0.31	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000048	康达尔	91,980.00	0.19	重大事项停牌
2	600399	抚顺特钢	77,550.00	0.16	重大事项停牌
3	000029	深深房 A	69,254.00	0.14	重大事项停牌
4	002263	*ST 东南	67,784.00	0.14	重大事项停牌
5	600784	鲁银投资	38,766.00	0.08	重大事项停牌

§ 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

份额级别	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
1000A	61	25,614.95	1,418,376.00	90.78%	144,136.00	9.22%
1000B	299	5,225.79	145.00	0.01%	1,562,367.00	99.99%
华宝中证 1000 指数分级	3,961	13,627.42	389,408.38	0.72%	53,588,811.96	99.28%
合计	4,321	13,215.28	1,807,929.38	3.17%	55,295,314.96	96.83%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	1,417,560.00	90.72%
2	张志赟	16,675.00	1.07%
3	郑建伟	14,618.00	0.94%
4	郑志	13,869.00	0.89%
5	梁小红	13,598.00	0.87%
6	黄晖	12,398.00	0.79%
7	曾亭曦	6,900.00	0.44%
8	孙大威	6,663.00	0.43%
9	曲惠琴	6,482.00	0.41%
10	邵文杰	5,911.00	0.38%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	朱金元	339,291.00	21.71%
2	祝东华	156,463.00	10.01%
3	吴天爵	81,056.00	5.19%
4	谢锦星	50,722.00	3.25%

5	杨玉锋	42,314.00	2.71%
6	张珊珊	40,050.00	2.56%
7	刘文卿	35,311.00	2.26%
8	王跃文	28,194.00	1.80%
9	施春阳	26,500.00	1.70%
10	姚焕炯	25,724.00	1.65%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝中证 1000 指数分级	34,772.18	0.0644%
	合计	34,772.18	0.0609%

8.4 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	份额级别	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	1000A	0
	1000B	0
	华宝中证 1000 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝中证 1000 指数分级	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日） 基金份额总额	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
本报告期期初基金份额总额	7,220,835.00	7,220,835.00	93,613,788.63
本报告期基金总申购份额	-	-	4,562,522.01
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	15,376,680.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-5,658,323.00	-5,658,323.00	-28,821,409.97
本报告期期末基金份额总额	1,562,512.00	1,562,512.00	53,978,220.34

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§ 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

2018 年 4 月 11 日, 经公司董事会审议通过, 聘任李慧勇为公司副总经理。该事项经中国证券投资基金业协会备案, 并在指定媒体上披露。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金资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	
天风证券	2	9,854,150.90	40.58%	8,993.32	40.14%	-
长江证券	1	4,202,628.80	17.31%	3,914.15	17.47%	-
东吴证券	1	2,095,664.32	8.63%	1,951.61	8.71%	-
国泰君安	2	1,995,375.00	8.22%	1,858.73	8.30%	-
东北证券	1	1,573,475.00	6.48%	1,465.38	6.54%	-
东方证券	2	1,237,516.00	5.10%	1,152.45	5.14%	-
中泰证券	2	664,292.80	2.74%	605.31	2.70%	-
东兴证券	1	645,846.93	2.66%	588.61	2.63%	-
中信证券	2	580,850.40	2.39%	540.99	2.41%	-
国信证券	1	323,874.00	1.33%	301.60	1.35%	-
华创证券	1	284,178.00	1.17%	264.69	1.18%	-
民生证券	1	231,011.00	0.95%	215.22	0.96%	-
方正证券	2	190,792.79	0.79%	177.86	0.79%	-
瑞银证券	1	146,018.00	0.60%	136.07	0.61%	-
中金国际	1	129,253.00	0.53%	120.43	0.54%	-
太平洋证券	2	125,777.50	0.52%	117.22	0.52%	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资力雄厚，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要，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；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元无变动。

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
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2018 年 3 月 28 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告》，公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

华宝基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日