

华宝多策略增长开放式证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝多策略增长
基金主代码	240005
交易代码	240005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 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	2,833,445,419.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过各风格板块间资产配置以及各板块内精选个股，在控制风险的前提下为持有人谋求最大回报。
投资策略	本基金看好中国经济的发展前景和证券市场存在的投资机会，注重资产在各风格板块间的配置，同时在各风格板块内部精选个股。
业绩比较基准	80%×上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数+20%×上证国债指数 复合指数 = (上证 180 流通市值 / 成分指数总流通市值) × 上证 180 指数 + (深证 100 流通市值 / 成分指数总流通市值) × 深证 100 指数 成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深证 100 流通市值
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

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	104,488,376.42
本期利润	228,966,441.58
加权平均基金份额本期利润	0.0788
本期加权平均净值利润率	17.44%
本期基金份额净值增长率	20.30%
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	-124,731,166.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0440
期末基金资产净值	1,329,982,575.51
期末基金份额净值	0.4694
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	412.08%

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期末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	4.68%	0.95%	4.68%	0.94%	0.00%	0.01%

过去三个月	-2.80%	1.14%	0.00%	1.22%	-2.80%	-0.08%
过去六个月	20.30%	1.22%	22.43%	1.24%	-2.13%	-0.02%
过去一年	3.55%	1.27%	10.37%	1.21%	-6.82%	0.06%
过去三年	4.60%	0.96%	22.28%	0.88%	-17.68%	0.08%
自基金合同生效日起至 今	412.08%	1.48%	225.49%	1.38%	186.59%	0.10%

注：1、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）。

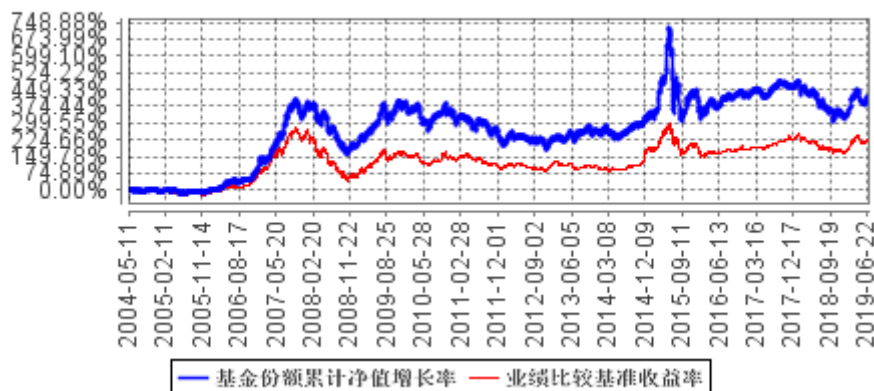
2、本基金业绩比较基准为： $80\% \times$ 上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数 $+20\% \times$ 上证国债指数
 复合指数 = (上证 180 流通市值 / 成分指数总流通市值) \times 上证 180 指数 + (深圳 100 流通市值 / 成分指数总流通市值) \times 深证 100 指数

成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深圳 100 流通市值

流通市值采用上一交易日收盘市值

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：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2004 年 11 月 11 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		
蔡目荣	国内投资部 副总经理、 本基金基金 经理、华宝 资源优选混	2015 年 11 月 5 日	-	16 年	硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作。2008 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理和交易员等职务，

	合、华宝价值发现混合、华宝绿色主题混合基金经理			现任国内投资部副总经理。2012 年 8 月起任华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理,2015 年 6 月至 2017 年 3 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015 年 11 月任华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2018 年 1 月起任华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理,2018 年 9 月起任华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理。
--	-------------------------	--	--	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年国内经济依然低迷，一季度末由于逆周期调节政策以及春节错位等因素国内经济一度出现复苏信号，但随后偏紧的货币政策以及 5 月份以后中美贸易谈判陷入僵局，国内经济再次低迷。从上半年宏观数据看，虽然 3、6 月份部分数据出现反弹，但国内经济放缓压力依然存在。从经济先行指标 PMI 看，2019 年 3、4 月份短暂的回升到荣枯线上以后，5、6 月份再次跌破荣枯线；从规模以上企业工业增加值看，1、2 月低迷后，3 月份数据反弹，但 4、5 月份同比数据较 3 月份逐步下滑，6 月份受采矿业景气提升数据再次反弹，但上半年整体低迷；从社会消费品零售总额增速看，4 月份触及了 2003 年中以来的低点，由于恢复五一小长假 5 月份该数据回升到 8.6%，6 月份因国五车清库存促销带动，该数据继续回升到 9.8%，但预期难以持续；从固定资产投资数据，上半年整体呈现弱回升态势，主要是地产投资增速较为刚性，同时逆周期调节宏观政策对于基建投资有一定的拉动作用；从进出口数据看，中美贸易冲突及国内外经济放缓等影响，上半年进出口数据不佳。从世界各主要经济体的制造业 PMI 以及全球贸易形势等方面看，多数国家的经济景气度已经见顶回落，世界各主要经济体经济增速均有一定放缓压力，其中美国状况稍好，但也出现了回落趋势。未来主要风险点是全球贸易保护主义抬头及全球经济继续放缓。

2019 年上半年 A 股市场波动较大，最终市场整体呈现上涨。1 月份以上证 50 为代表的大股票表现较好，而春节后一个月以创业板为代表的中小股票表现遥遥领先，二季度初开始 A 股市场持续下跌，但以上证 50 为代表的大股票表现较好，而中小板和创业板为代表的中小股票下跌明显。一季度 A 股表现较好主要是货币和财政政策相对较为宽松，以及中美贸易谈判进展较为顺利，同时 2018 年股市大幅调整也使得个股及行业估值较低。二季度 A 股下跌主要因为货币政策较一季度略有收紧，同时中美贸易谈判陷入僵局以及国内外经济增长低于市场预期等。市场表现较好的行业是食品饮料、非银和农业，而建筑、传媒和汽车表现不佳。上半年上证指数涨幅 19.45%，深成指涨幅 26.78%，创业板指数涨幅 20.87%。

本基金在年初仓位较高，随着市场上涨一季度末开始逐步降低了仓位，由于市场大幅调整后股票估值具有较强的吸引力，在二季度末又明显提升了仓位。上半年本基金主要降低了化工、有色和非银配置，增加了传媒、银行和采掘配置。

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 20.30%，业绩比较基准收益率为 22.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，在房地产行业销售放缓，海外经济增速放缓以及中美贸易冲突（双方还在商谈中，能否缓解目前还难以判断）背景下，预计经济增长会有压力。但考虑到经过去库存后国内房地产行业库存较低，房地产投资虽有压力但不用过于担心；基建投资增速 2018 年四季度开始已经企稳回升，2019 年上半年也维持了低速回升的态势，在国内逆周期政策作用下预计未来还有提升空间。国际市场方面，美国 2018 年减税政策实施有望继续带动美国经济向好，但后续增长速度也会受贸易冲突影响。美联储货币政策依然需要重点关注，目前市场对其降息预期较高，如果降息低于预期则会导致经济承受压力。欧洲和日本 2019 年上半年经济继续低迷，2019 年下半年预计在美国及其他国家贸易保护政策性下也难以明显扭转。未来重点关注在经济放缓情况下全球主要央行的货币政策。

对于 A 股市场来说，经过连续三年多调整后，中小市值股票估值较高的压力得到较大程度缓解，部分股票和行业已经具备投资价值，一些低估值高分红的价值股以及业绩增长相对确定的成长行业龙头值得关注。在板块方面，2019 年上半年国内经济有下行压力，为对冲经济下滑，稳增长将会是 2019 年下半年一个重要的投资主线。但未来基建投资更多集中在补短板领域，因此寻找相应的板块（如基建、轨交、环保等）的投资机会，另外还可以关注地产、券商和医疗信息化、5G、游戏和半导体板块的投资机会。本基金计划在 2019 年下半年继续采取较前两年偏乐观仓位策略，密切关注市场风格的变化，紧跟经济形势、政策动向及流动性走势，采取灵活应对措施，在契约规定的范围内进一步优化持仓结构挖掘优质个股以争取获取好的业绩。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝多策略增长开放式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		109,978,309.52	88,473,226.56
结算备付金		2,759,302.03	2,951,707.91
存出保证金		647,919.59	580,684.41
交易性金融资产		1,241,285,655.81	1,047,642,204.11
其中：股票投资		1,148,440,571.01	955,199,281.11
基金投资		-	-
债券投资		92,845,084.80	92,442,923.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		6,760,431.92	10,425,996.77
应收利息		1,613,387.81	1,636,210.67
应收股利		-	-
应收申购款		78,267.30	182,558.25
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,363,123,273.98	1,151,892,588.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25,440,798.99	11,202,879.95
应付赎回款		1,287,856.71	266,607.22
应付管理人报酬		1,627,845.56	1,491,403.15
应付托管费		271,307.58	248,567.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,413,096.22	3,147,100.33

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		99,793.41	382,127.70
负债合计		33,140,698.47	16,738,685.52
所有者权益：			
实收基金		1,234,697,477.37	1,267,851,326.66
未分配利润		95,285,098.14	-132,697,423.50
所有者权益合计		1,329,982,575.51	1,135,153,903.16
负债和所有者权益总计		1,363,123,273.98	1,151,892,588.68

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4694 元，基金份额总额 2,833,445,419.12 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝多策略增长开放式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		247,379,648.99	-155,204,711.28
1.利息收入		2,994,647.04	4,127,651.33
其中：存款利息收入		611,400.72	619,340.81
债券利息收入		2,373,852.07	3,436,698.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,394.25	71,611.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		119,808,179.05	-42,432,645.95
其中：股票投资收益		110,685,167.29	-42,752,346.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-916,689.22	-6,340,532.90
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		10,039,700.98	6,660,233.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		124,478,065.16	-116,999,340.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		98,757.74	99,623.84

减：二、费用		18,413,207.41	18,373,755.32
1. 管理人报酬		9,736,013.52	11,021,120.84
2. 托管费		1,622,668.86	1,836,853.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		6,933,354.37	5,311,988.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.70	-
7. 其他费用		121,169.96	203,792.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		228,966,441.58	-173,578,466.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		228,966,441.58	-173,578,466.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝多策略增长开放式证券投资基金

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）	1,267,851,326.66	-132,697,423.50	1,135,153,903.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	228,966,441.58	228,966,441.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-33,153,849.29	-983,919.94	-34,137,769.23
其中：1. 基金申购款	67,936,573.51	6,895,200.44	74,831,773.95
2. 基金赎回款	-101,090,422.80	-7,879,120.38	-108,969,543.18
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	1,234,697,477.37	95,285,098.14	1,329,982,575.51

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)	1,231,384,613.51	455,528,761.07	1,686,913,374.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-173,578,466.60	-173,578,466.60
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)	40,264,331.75	7,582,617.27	47,846,949.02
其中：1.基金申购款	134,877,106.55	27,298,925.23	162,176,031.78
2.基金赎回款	-94,612,774.80	-19,716,307.96	-114,329,082.76
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)	-	-238,241,073.08	-238,241,073.08
五、期末所有者权益(基金净值)	1,271,648,945.26	51,291,838.66	1,322,940,783.92

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

华宝多策略增长开放式证券投资基金(原名为华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金,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[2004]第 41 号《关于同意华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金设立的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基

金基金合同》)发起，并于 2004 年 5 月 11 日募集成立。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 5,229,237,143.39 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(2004)第 74 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金招募说明书》和《关于对华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 1 月 8 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2.294784076，并于 2008 年 1 月 8 日进行了变更登记。

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》，华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝多策略增长开放式证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝多策略增长开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的 50%-95%，债券为 0%-45%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为：复合指数×80%+上证国债指数×20%；其中，复合指数=(上证 180 流通市值/成分指数总流通市值)×上证 180 指数+(深证 100 流通市值/成分指数总流通市值)×深证 100 指数；其中，成分指数总流通市值=上证 180 流通市值+深证 100 流通市值。

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》、《华宝多策略增长开放式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 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

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

无。

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	9,736,013.52	11,021,120.84
其中：支付销售机构的客户维护费	948,089.97	1,094,384.87

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 1.5% 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 1.5% / 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	1,622,668.86	1,836,853.46

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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	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（2004 年 5 月 11 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,171,745.16	1,171,745.16
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	1,171,745.16	1,171,745.16
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0400%	0.0400%

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	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	109,978,309.52	572,570.59	119,212,818.62	588,900.32

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 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 1,148,383,594.47 元，属于第二层次的余额为 92,902,061.34 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 941,487,674.23 元，第二层次 106,154,529.88 元，无第三层次)。

(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	1,148,440,571.01	84.25
	其中：股票	1,148,440,571.01	84.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	92,845,084.80	6.81
	其中：债券	92,845,084.80	6.81
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	112,737,611.55	8.27
8	其他各项资产	9,100,006.62	0.67
9	合计	1,363,123,273.98	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	85,379,355.24	6.42
C	制造业	453,998,484.93	34.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,374,643.54	2.36
E	建筑业	89,673,478.14	6.74
F	批发和零售业	10,252,362.72	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	84,591,868.06	6.36
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,830,917.86	12.62
J	金融业	112,374,209.90	8.45
K	房地产业	41,031,722.56	3.09
L	租赁和商务服务业	23,814,345.87	1.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,837,000.23	1.42
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	29,282,181.96	2.20
S	综合	-	-
	合计	1,148,440,571.01	86.35

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	601699	潞安环能	5,698,366	45,245,026.04	3.40
2	002555	三七互娱	3,267,229	44,270,952.95	3.33
3	002531	天顺风能	6,705,800	40,503,032.00	3.05
4	002174	游族网络	2,078,394	35,083,290.72	2.64
5	600048	保利地产	2,564,656	32,725,010.56	2.46
6	300253	卫宁健康	2,304,210	32,673,697.80	2.46
7	600388	龙净环保	2,475,256	30,668,421.84	2.31
8	000001	平安银行	2,167,500	29,868,150.00	2.25
9	002384	东山精密	1,892,014	27,566,643.98	2.07
10	601717	郑煤机	4,676,627	26,703,540.17	2.01

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。

7.4 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	601186	中国铁建	60,597,656.81	5.34
2	601699	潞安环能	59,601,567.64	5.25
3	002174	游族网络	57,906,833.44	5.10
4	601398	工商银行	53,847,858.46	4.74
5	600028	中国石化	52,614,074.00	4.63
6	601288	农业银行	52,349,312.00	4.61
7	000625	长安汽车	52,042,249.05	4.58
8	002555	三七互娱	50,057,364.05	4.41
9	600958	东方证券	50,034,230.06	4.41
10	002128	露天煤业	45,451,345.54	4.00
11	600011	华能国际	45,088,822.20	3.97
12	300059	东方财富	44,304,966.01	3.90
13	601668	中国建筑	43,478,988.04	3.83
14	600027	华电国际	42,779,249.32	3.77
15	300253	卫宁健康	42,631,789.00	3.76
16	600029	南方航空	40,297,810.00	3.55
17	601688	华泰证券	37,934,348.14	3.34
18	601998	中信银行	37,624,120.00	3.31
19	601818	光大银行	35,813,923.00	3.15
20	002531	天顺风能	35,064,343.00	3.09
21	300137	先河环保	35,016,303.80	3.08
22	000401	冀东水泥	34,851,585.05	3.07
23	000425	徐工机械	33,726,743.60	2.97
24	601800	中国交建	33,260,855.69	2.93
25	002583	海能达	32,468,532.96	2.86
26	600048	保利地产	31,999,908.32	2.82
27	601857	中国石油	30,232,648.00	2.66
28	002624	完美世界	28,096,216.38	2.48
29	601166	兴业银行	28,013,856.00	2.47
30	000001	平安银行	26,666,113.00	2.35
31	600153	建发股份	26,482,046.67	2.33
32	603517	绝味食品	25,062,332.95	2.21
33	600720	祁连山	24,300,451.74	2.14
34	300144	宋城演艺	24,183,836.40	2.13
35	300192	科斯伍德	23,823,639.60	2.10

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	600958	东方证券	88,679,287.89	7.81
2	601688	华泰证券	70,491,790.98	6.21
3	002648	卫星石化	62,081,467.61	5.47
4	601288	农业银行	51,547,949.00	4.54
5	000960	锡业股份	51,506,696.00	4.54
6	600028	中国石化	49,771,240.91	4.38
7	600388	龙净环保	48,048,200.97	4.23
8	601398	工商银行	40,978,258.00	3.61
9	601186	中国铁建	39,785,900.00	3.50
10	002174	游族网络	39,457,781.41	3.48
11	000425	徐工机械	38,809,992.40	3.42
12	600985	淮北矿业	38,464,790.36	3.39
13	601933	永辉超市	33,941,534.62	2.99
14	600803	新奥股份	33,113,621.79	2.92
15	600115	东方航空	31,450,285.63	2.77
16	000063	中兴通讯	31,162,089.04	2.75
17	600837	海通证券	30,904,052.50	2.72
18	300137	先河环保	30,767,799.93	2.71
19	600153	建发股份	30,653,203.69	2.70
20	300192	科斯伍德	30,251,559.47	2.66
21	603517	绝味食品	29,041,350.90	2.56
22	002202	金风科技	28,777,425.21	2.54
23	601857	中国石油	28,206,726.88	2.48
24	300388	国祯环保	26,980,041.90	2.38
25	600068	葛洲坝	26,709,402.11	2.35
26	300059	东方财富	26,649,688.40	2.35
27	600048	保利地产	26,427,085.00	2.33
28	600011	华能国际	25,480,949.12	2.24
29	002384	东山精密	25,281,063.21	2.23
30	002128	露天煤业	25,125,589.37	2.21
31	601117	中国化学	24,664,671.90	2.17

32	601333	广深铁路	23,263,955.57	2.05
33	000625	长安汽车	23,125,321.86	2.04
34	600720	祁连山	22,806,741.08	2.01

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	2,254,946,406.50
卖出股票收入（成交）总额	2,295,931,152.97

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	92,845,084.80	6.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	92,845,084.80	6.98

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	902,460	92,845,084.80	6.98

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投资。

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

多策略增长基金截至 2019 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的平安银行（000001）于 2018 年 8 月 3 日收到各省市银监局、银保监会处罚通知。由于公司存在办理无真实贸易背景票据业务、办理无真实贸易背景的银行承兑汇票业务、部分个人非房贷类信贷资金用途把控不力，违规流入房地产市场、授权未经任职资格核准的人员实际履行银行高管职权、以不正当手段发放贷款、会计记账违反审慎经营规则，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九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	647,919.59
2	应收证券清算款	6,760,431.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,613,387.81
5	应收申购款	78,267.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,100,006.62

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的情况。

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
66,971	42,308.54	187,571,994.30	6.62%	2,645,873,424.82	93.38%

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	2,969.48	0.0001%

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	0
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（2004年5月11日）基金份额总额	5,233,338,344.60
本报告期期初基金份额总额	2,909,529,696.47
本报告期期间基金总申购份额	155,904,850.75
减：本报告期期间基金总赎回份额	231,989,128.10
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	2,833,445,419.12

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

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，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	
国泰君安	1	786,083,665.23	17.29%	732,080.14	17.29%	-
申万宏源	1	715,960,047.21	15.74%	666,772.76	15.75%	-
国元证券	1	662,446,951.59	14.57%	616,934.75	14.57%	-
招商证券	1	645,593,361.01	14.20%	601,240.63	14.20%	-
华泰证券	1	593,501,435.48	13.05%	552,723.76	13.05%	-
长江证券	1	520,297,055.47	11.44%	484,553.95	11.44%	-
国金证券	1	188,746,707.21	4.15%	175,780.07	4.15%	-
中信建投	1	162,774,902.89	3.58%	151,591.40	3.58%	-
海通证券	1	161,446,082.58	3.55%	150,357.02	3.55%	-
高华证券	1	61,735,171.77	1.36%	56,259.29	1.33%	-
东兴证券	1	48,983,101.14	1.08%	45,617.69	1.08%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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：财力雄厚，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，并能为本基金提供全面的信息服；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. 本基金本报告期停止租用券商交易单元：山西证券。

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
国泰君安	24,433,484.35	25.71%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国元证券	46,184,638.33	48.60%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,108,049.69	4.32%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	20,299,010.46	21.36%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

§ 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。



华宝基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日