

# 宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈科技 30 混合
基金主代码	000698
交易代码	000698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 13 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,425,468,605.43 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于以科技创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的一类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组

	成。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

### 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		宝盈基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	贺倩
	联系电话	0755-83276688	010-66060069
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95599
传真		0755-83515599	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-303,394,672.58	-666,017,503.41	-488,135,176.59
本期利润	-595,328,914.12	200,958,348.63	-1,151,372,346.10
加权平均基金份额本期利润	-0.4115	0.1105	-0.4807
本期基金份额净值增长率	-26.16%	8.21%	-23.12%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-1.0438	-0.8318	-0.4962
期末基金资产净值	1,678,238,837.95	2,562,101,836.91	2,943,861,674.09
期末基金份额净值	1.177	1.594	1.473

注：1、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。

2、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、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。

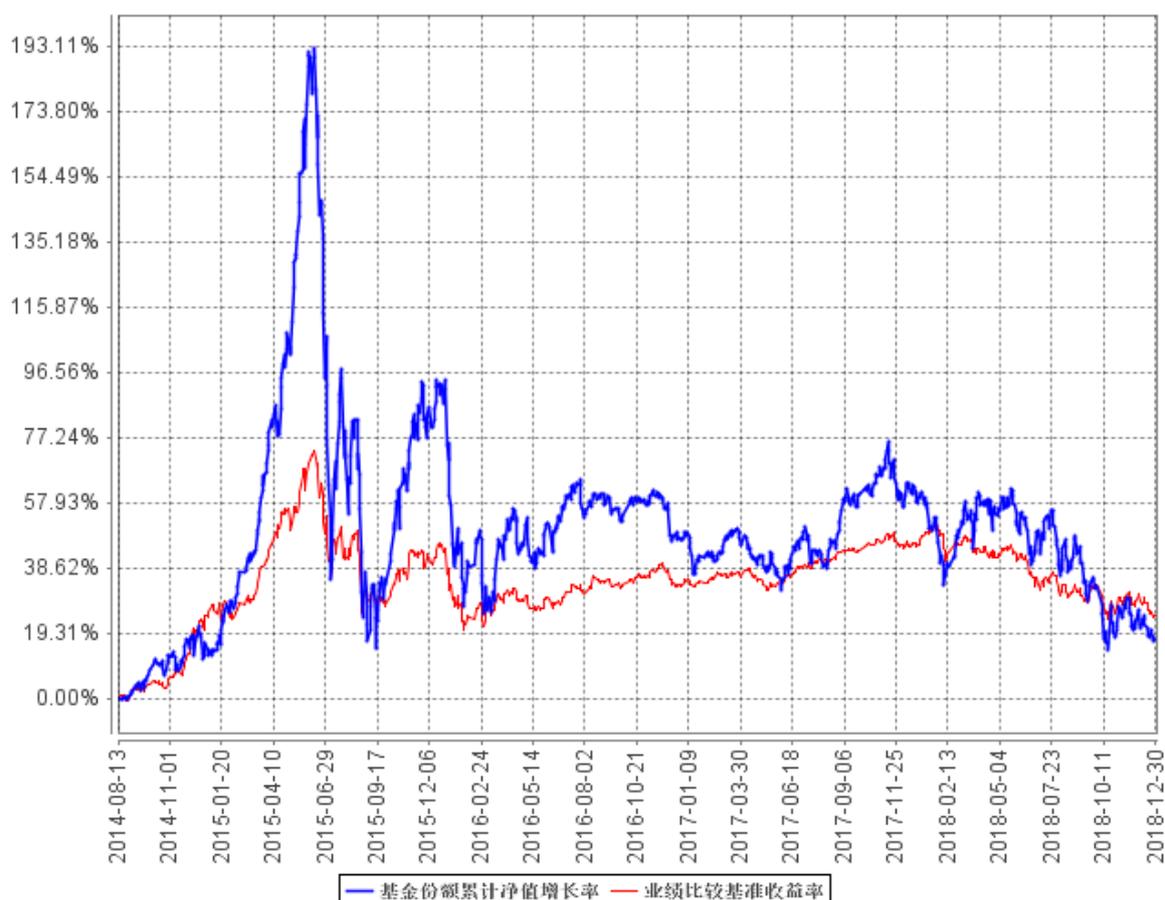
### 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	-11.57%	2.03%	-6.64%	0.99%	-4.93%	1.04%
过去六个月	-21.22%	1.91%	-8.03%	0.89%	-13.19%	1.02%
过去一年	-26.16%	1.84%	-14.38%	0.80%	-11.78%	1.04%
过去三年	-38.57%	1.71%	-12.92%	0.74%	-25.65%	0.97%
自基金合同生效起至今	17.70%	2.18%	24.71%	0.97%	-7.01%	1.21%

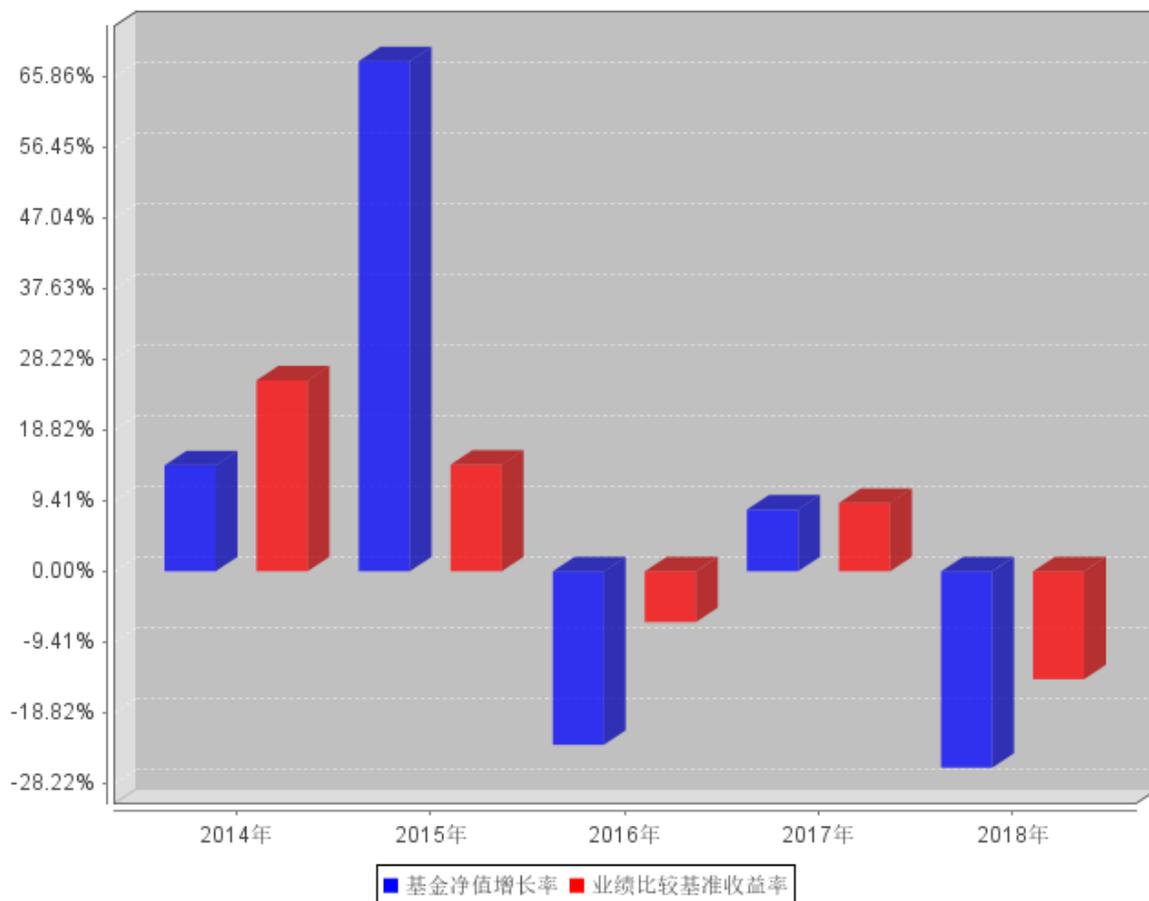
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年以来未进行利润分配。

## §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：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券二十五只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

#### 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		
张仲维	本基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金、宝盈人工智能主题股票型证券投资基金的基金经理	2016 年 9 月 21 日	-	8 年	张仲维先生，台湾政治大学国际贸易硕士。曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司国际部研究员、基金经理，华润元大基金管理有限公司研究员、基金经理；自 2015 年 5 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员、投资经理。中国台湾籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2018 年 12 月 31 日。

## 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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资合同同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

## 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 年市场全年震荡下行，沪深 300 和创业板指的收益率分别为-25.31%、-28.65%。宏观经济出现了比较大变化，主要是两方面：首先是金融去杠杆持续深化落实，导致了信用债违约频发、上市公司股权质押爆仓等事件；第二是中美关系恶化，影响市场对于成长股的风险偏好，同时人民币汇率也出现了非常大幅度快速的贬值，导致资金面进一步出现紧缩预期。

行业指数全数下跌（以中信一级行业指数为准），跌幅较少的是餐饮旅游和银行，分别下跌 8.69%和 10.95%，表现最差的行业为综合和电子，分别下跌 42.45%和 41.31%。

本基金主要投资科技行业中高增长的公司，主要布局 5G、半导体、云计算、光学和新能源汽车供应链等。宏观经济数据持续疲弱，科技行业下游如手机、通讯和汽车需求持续下滑，导致科技硬件类股票业绩和估值持续承压，因此基金在报告期内适度降低与经济周期强相关的个股，加码与经济周期弱相关的股票，例如医疗信息化、新能源行业等，2018 年基金下跌 26.16%。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.177 元；本报告期基金份额净值增长率为-26.16%，业绩比较基准收益率为-14.38%。

## 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，利好包括：1. 政府应对经济下行采取积极的财政政策以及宽松的货币政策。2. 中美持续释放积极谈判的意愿。2018 年的负面因素逐渐消除，目前市场估值也是处于相对低的位置，对于行业趋势好且公司业绩增速高的标的，目前是比较好的投资时间点。

本基金主要投资科技行业中高增长的公司，2019 年主要看好以下方向：1. 5G 相关产业链，包含通讯用高频 pcb、射频天线等。2. 半导体行业，中国将持续加大半导体的投入与发展，看好相关半导体行业公司。3. 新能源行业，包含新能源汽车供应链以及光伏行业供应链。4. 人工智能在各行业应用落地的投资机会，包含安防、智能驾驶、医疗行业等。

## 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和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部负责人共同组成，以上人员均具

备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—宝盈基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### **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**

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字（2019）第 20984 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	338,176,548.59	182,553,766.17
结算备付金	3,014,983.02	3,645,716.78
存出保证金	640,049.94	800,711.67
交易性金融资产	1,344,718,713.53	2,166,045,857.36
其中：股票投资	1,344,718,713.53	2,166,045,857.36
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	-	200,000,300.00
应收证券清算款	-	19,327,723.14
应收利息	77,933.61	227,486.12
应收股利	-	-
应收申购款	184,953.80	805,372.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,686,813,182.49	2,573,406,933.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,417,054.40	-

应付赎回款	584,751.09	5,083,015.46
应付管理人报酬	2,193,631.18	3,411,003.57
应付托管费	365,605.21	568,500.59
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,813,080.07	2,042,045.39
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,222.59	200,531.35
负债合计	8,574,344.54	11,305,096.36
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,425,468,605.43	1,607,004,184.44
未分配利润	252,770,232.52	955,097,652.47
所有者权益合计	1,678,238,837.95	2,562,101,836.91
负债和所有者权益总计	1,686,813,182.49	2,573,406,933.27

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.177 元，基金份额总额

1,425,468,605.43 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-545,381,737.79	267,731,669.36
1. 利息收入	2,769,741.52	3,649,196.17
其中：存款利息收入	2,233,571.75	2,796,581.43
债券利息收入	-	1,521.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	536,169.77	851,093.21
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-257,105,146.22	-603,986,441.22
其中：股票投资收益	-262,251,186.12	-613,460,773.70
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	38,342.75
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	5,146,039.90	9,435,989.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	-291,934,241.54	866,975,852.04

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	887,908.45	1,093,062.37
<b>减: 二、费用</b>	<b>49,947,176.33</b>	<b>66,773,320.73</b>
1. 管理人报酬	30,938,583.41	40,759,668.83
2. 托管费	5,156,430.56	6,793,278.13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,388,438.85	18,754,395.31
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	463,723.51	465,978.46
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-595,328,914.12</b>	<b>200,958,348.63</b>
减: 所得税费用	-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-595,328,914.12</b>	<b>200,958,348.63</b>

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	1,607,004,184.44	955,097,652.47	2,562,101,836.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-595,328,914.12	-595,328,914.12
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)	-181,535,579.01	-106,998,505.83	-288,534,084.84
其中: 1. 基金申购款	190,303,686.17	73,164,434.50	263,468,120.67
2. 基金赎回款	-371,839,265.18	-180,162,940.33	-552,002,205.51
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)	1,425,468,605.43	252,770,232.52	1,678,238,837.95

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	1,998,675,640.01	945,186,034.08	2,943,861,674.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	200,958,348.63	200,958,348.63
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）	-391,671,455.57	-191,046,730.24	-582,718,185.81
其中：1. 基金申购款	222,246,356.20	129,472,186.39	351,718,542.59
2. 基金赎回款	-613,917,811.77	-320,518,916.63	-934,436,728.40
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）	1,607,004,184.44	955,097,652.47	2,562,101,836.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          杨凯          </u>	<u>          彭玖雯          </u>	<u>          何瑜          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.2.1 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。

#### 7.4.2.2 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。

#### 7.4.2.3 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。

### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.5.2 关联方报酬

###### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	30,938,583.41	40,759,668.83
其中：支付销售机构的客户维护费	15,383,251.59	20,152,601.88

注：支付基金管理人宝盈基金公司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。

###### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,156,430.56	6,793,278.13

注：支付基金托管人中国农业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。

**7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.5.4.2 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**

无。

**7.4.5.5 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 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	338,176,548.59	2,161,981.19	182,553,766.17	2,707,022.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.5.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.6 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.6.1 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

7.4.12.1.1 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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

**7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.7 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 12 月 31 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 1,344,668,567.73 元，属于第二层次的余额为 50,145.80 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 2,139,308,647.63 元，第二层次 26,737,209.73 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 2018 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(2017 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	1,344,718,713.53	79.72
	其中：股票	1,344,718,713.53	79.72
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	-	-
	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	341,191,531.61	20.23
8	其他各项资产	902,937.35	0.05
9	合计	1,686,813,182.49	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	825,561,383.07	49.19
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	381,035,276.16	22.70
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	66,220,000.00	3.95
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	47,840,000.00	2.85
R	文化、体育和娱乐业	24,011,908.50	1.43
S	综合	-	-
	合计	1,344,718,713.53	80.13

### 8.3 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	300567	精测电子	2,523,600	127,391,328.00	7.59
2	300450	先导智能	3,199,876	92,604,411.44	5.52
3	300059	东方财富	7,500,000	90,750,000.00	5.41
4	002463	沪电股份	11,800,000	84,606,000.00	5.04
5	300550	和仁科技	1,550,000	81,034,000.00	4.83
6	603960	克来机电	2,900,000	80,562,000.00	4.80
7	002410	广联达	3,800,000	79,078,000.00	4.71
8	601888	中国国旅	1,100,000	66,220,000.00	3.95
9	300308	中际旭创	1,350,000	54,931,500.00	3.27
10	002456	欧菲科技	5,700,000	52,383,000.00	3.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司

<http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	300059	东方财富	218,382,953.72	8.52
2	300567	精测电子	169,247,402.24	6.61

3	002044	美年健康	133,498,304.80	5.21
4	300571	平治信息	133,483,977.38	5.21
5	002410	广联达	119,142,782.82	4.65
6	300550	和仁科技	112,905,462.94	4.41
7	601398	工商银行	112,323,168.44	4.38
8	002456	欧菲科技	102,001,662.69	3.98
9	603960	克来机电	95,802,223.61	3.74
10	300450	先导智能	94,757,060.79	3.70
11	002463	沪电股份	93,148,047.10	3.64
12	300373	扬杰科技	90,770,480.31	3.54
13	002273	水晶光电	89,067,070.46	3.48
14	000333	美的集团	79,850,145.22	3.12
15	300604	长川科技	78,030,115.79	3.05
16	300308	中际旭创	75,187,950.47	2.93
17	600887	伊利股份	71,626,626.95	2.80
18	601888	中国国旅	70,876,981.31	2.77
19	600276	恒瑞医药	70,555,776.19	2.75
20	002920	德赛西威	70,427,058.98	2.75
21	002384	东山精密	69,644,770.80	2.72
22	300357	我武生物	69,583,812.33	2.72
23	300253	卫宁健康	66,779,223.02	2.61
24	002916	深南电路	66,396,399.06	2.59
25	600519	贵州茅台	65,999,514.00	2.58
26	600760	中航沈飞	64,455,671.62	2.52
27	002475	立讯精密	63,248,479.08	2.47
28	002709	天赐材料	62,904,651.25	2.46
29	300347	泰格医药	60,665,304.72	2.37
30	300015	爱尔眼科	58,682,590.12	2.29
31	000063	中兴通讯	55,315,848.00	2.16
32	300170	汉得信息	51,458,103.47	2.01

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	002273	水晶光电	164,680,729.94	6.43
2	000333	美的集团	149,570,538.14	5.84
3	300567	精测电子	139,024,033.41	5.43
4	300308	中际旭创	128,847,988.63	5.03
5	300373	扬杰科技	128,771,155.48	5.03
6	601318	中国平安	117,472,231.64	4.58
7	300571	平治信息	116,021,841.85	4.53
8	300059	东方财富	114,092,793.78	4.45
9	600887	伊利股份	103,378,566.08	4.03
10	002833	弘亚数控	101,926,289.36	3.98
11	601398	工商银行	100,591,944.74	3.93
12	300671	富满电子	98,490,161.74	3.84
13	002773	康弘药业	98,224,716.66	3.83
14	002044	美年健康	95,225,277.97	3.72
15	002456	欧菲科技	93,173,444.25	3.64
16	300604	长川科技	91,280,352.58	3.56
17	000063	中兴通讯	90,139,846.51	3.52
18	002463	沪电股份	82,890,319.50	3.24
19	603197	保隆科技	80,836,692.01	3.16
20	002624	完美世界	79,542,085.19	3.10
21	300450	先导智能	72,069,253.46	2.81
22	300136	信维通信	68,819,499.48	2.69
23	603960	克来机电	67,838,025.76	2.65
24	300015	爱尔眼科	67,323,540.53	2.63
25	002439	启明星辰	66,562,561.89	2.60
26	300613	富瀚微	65,714,972.90	2.56
27	002916	深南电路	65,310,526.78	2.55
28	600760	中航沈飞	64,117,061.03	2.50
29	600276	恒瑞医药	63,858,259.51	2.49
30	600519	贵州茅台	63,743,428.06	2.49
31	002920	德赛西威	59,748,807.22	2.33
32	300347	泰格医药	58,935,588.88	2.30
33	002050	三花智控	55,578,453.13	2.17
34	300097	智云股份	54,687,334.50	2.13
35	002384	东山精密	53,505,251.04	2.09
36	300170	汉得信息	51,585,005.80	2.01

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 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	4,286,062,648.76
卖出股票收入（成交）总额	4,553,204,364.93

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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投资。

### 8.6 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投资。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

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，在本报告编制日前一年内除欧菲科技外未受到公开谴责、处罚。

欧菲科技股份有限公司（以下简称“欧菲科技”）于 2018 年 1 月收到《深圳证监局关于对欧菲科技股份有限公司采取监管谈话措施的决定》，主要原因是子公司苏州欧菲光科技有限公司在 2016 年 2 月 3 日与苏州市相城区签订框架性意向协议后未做及时的信息披露。考虑到上述投资协议的签署及后续投资未对公司的资产、负债、权益和经营成果产生重要影响，并且上市公司在短期也采取了签订《补充协议》并予以公告的补救措施，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条第二项的规定，监管机构对公司采取了监管谈话的行政监管措施。

欧菲科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2018 年 5 月 14 日收到深圳证券交易所中小板公司管理部向公司出具的《关于对欧菲科技股份有限公司 2017 年年报的问询函》。后于 2018 年 6 月 1 日，公司披露《关于会计差错更正的公告》，称在 2017 年度报告中，误将控股股东业绩承诺补偿金额 220,233,953.14 元确认为营业外收入，对应的所得税影响 33,035,092.97 元确认为所得税费用。本次会计差错更正调减公司 2017 年度合并资产负债表未分配利润项目 179,097,645.74 元，调增资本公积项目 187,198,860.17 元，调减盈余公积项目 8,101,214.43 元；调减公司 2017 年度合并利润表营业外收入、所得税费用、净利润项目分别为 220,233,953.14 元、33,035,092.97 元、187,198,860.17 元，净利润项目调整金额占更正后当年净利润的比例为 22.8%。深圳交易所称上述行为违反了《股票上市规则（2018 年修订）》第 1.4 条和第 2.1 条的规定，因此给予监管关注。

本基金关注到以上事件是欧菲科技公司在管理细节上的问题，在事件发生后，欧菲科技也立即启动了签订补充协议的措施，事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注欧菲科技自身业务发展的同时，也会持续关注公司在公司治理方面的改善，并将公司治理加入到对该公司的长期价值评估中。

### 8.12.2 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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	640,049.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	77,933.61
5	应收申购款	184,953.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	902,937.35

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

#### 8.12.6 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，分项与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
72,540	19,650.79	6,585,897.02	0.46%	1,418,882,708.41	99.54%

### 9.2 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	9,682.72	0.0007%

### 9.3 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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年8月13日）基金份额总额	1,291,529,429.81
本报告期期初基金份额总额	1,607,004,184.44
本报告期期间基金总申购份额	190,303,686.17
减:本报告期期间基金总赎回份额	371,839,265.18
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,425,468,605.43

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第五次临时会议决议，同意张新元辞去副总经理职务。该变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 100,000 元，目前事务所已连续 5 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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		23,153,535,781.32	35.69%	2,873,823.43	35.69%	-
中泰证券		11,543,309,822.90	17.47%	1,406,419.57	17.47%	-
中信证券		21,146,181,893.14	12.97%	1,044,512.57	12.97%	-
东兴证券	1	696,644,059.66	7.88%	634,852.52	7.88%	-
中金公司	1	694,019,564.00	7.86%	632,461.71	7.86%	-
华创证券	1	686,536,130.67	7.77%	625,639.91	7.77%	-
太平洋证券	2	450,410,355.32	5.10%	410,459.04	5.10%	-
西部证券	2	268,842,325.44	3.04%	244,996.46	3.04%	-
国金证券	1	195,663,902.50	2.21%	178,308.05	2.21%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 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。
- (5) 具备基金运作所需的高效、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。
- (6) 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。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单  
元租用协议。

2、应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券  
商的佣金合计，不单独指股票交易佣金。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

- (1) 新租太平洋证券上海、深圳交易单元各一个。新租西部证券上海、深圳交易单元各一个。  
新租招商证券上海交易单元一个。新租国盛证券深圳交易单元一个。
- (2) 本报告期内未退租交易单元。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	110,000,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

宝盈基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日