

宝盈人工智能主题股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 8 月 15 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈人工智能股票	
基金主代码	005962	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 15 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	65,261,047.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈人工智能股票 A	宝盈人工智能股票 C
下属分级基金的交易代码:	005962	005963
报告期末下属分级基金的份额总额	29,069,610.73 份	36,191,437.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于人工智能主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在本基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内（A 股）和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、人工智能主题的界定</p> <p>人工智能（Artificial Intelligence）是研究、开发用于模拟、延伸和扩展人的智能的理论、方法、技术及应用系统的一门技术科学。其技术体系分为基础层、技术层和应用层，具体内容包括：</p> <p>1）基础层：核心处理器芯片、底层算法、大数据等；</p> <p>2）技术层：语音识别、图像识别、生物识别、学习能力、逻辑能力等；</p> <p>3）应用层：自动驾驶、智能安防、无人系统、服务机器人等。</p> <p>随着关键技术的突破和产业政策的扶持，人工智能技术与应用的发展出现了向上的拐点。本基金界定的人工智能主题包括以下两类上市公司：</p> <p>（1）直接提供人工智能基础资源、技术以及应用支持的公司，具体包括信息采集技术及设备商、人工智能认知技术提供商、人工智能硬件提供商及相应供应链、人工智能应用支持商以及其他相关领域的上市公司；</p> <p>（2）利用人工智能技术提升产品与服务智能化水平的智能制造（高档数控机床、工业机器人、智能传感与控制系统等）、智能物流（无人化仓储、智能装备与配送等）、智能家居（安防系统、照明控制、智能家居等）和智能医疗（辅助诊断系统、临床应用系统等）领域的上市公司。</p> <p>未来如果由于经济发展、技术进步或政策调整造成人工智能主题的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，可以对上述界定进行调整和修订。</p> <p>2、子行业配置策略</p> <p>行业配置方面，本基金着重分析人工智能主题涵盖的各子行业技术成熟度、行业所处生命周期、行业内外竞争空间、行业盈利前景、行业成长空间及行业估</p>

值水平等多层面的因素，在此基础上判断行业的可持续发展能力，从而确定本基金的行业配置。

3、个股精选策略

本基金主要采取“自下而上”的选股策略，基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量，使用定性与定量相结合的方法精选个股。

4、港股通标的股票投资策略

本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

本基金将对港股通标的股票进行系统性分析，在采用子行业配置策略和个股精选策略的基础上，结合香港股票市场情况，重点投资于港股通标的股票范围内受惠于我国人工智能产业发展，且处于合理价位的具备核心竞争力的上市公司股票。

（三）债券投资策略

在进行债券投资时，本基金将会分析利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略和可转换债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

（四）资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（五）中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券具有二级市场流动性差、信用风险高、票面利率高的特点。本基金将综合运用个券信用分析、收益率预期、收益率利差、收益率曲线变动、相对价值评估等策略，结合中小企业私募债券对基金资产流动性影响的分析，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。

（六）衍生品投资策略

1、权证投资策略

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。

2、股指期货投资策略

	本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。
业绩比较基准	中证人工智能主题指数收益率×60% +恒生综合指数收益率×25% +中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。 本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	郭明
	联系电话	0755-83276688	010-66105798
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	95588
传真		0755-83515599	010-66105799

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8月15日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
	宝盈人工智能股票 A	宝盈人工智能股票 C
本期已实现收益	-449,275.30	-810,189.01
本期利润	-1,531,968.18	-1,908,761.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0446	-0.0203

本期基金份额净值增长率	-5.05%	-5.34%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0505	-0.0534
期末基金资产净值	27,602,735.13	34,257,963.10
期末基金份额净值	0.9495	0.9466

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。

4、本基金合同生效日为 2018 年 8 月 15 日，截止本报告期末基金合同生效未满一年。

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

宝盈人工智能股票 A

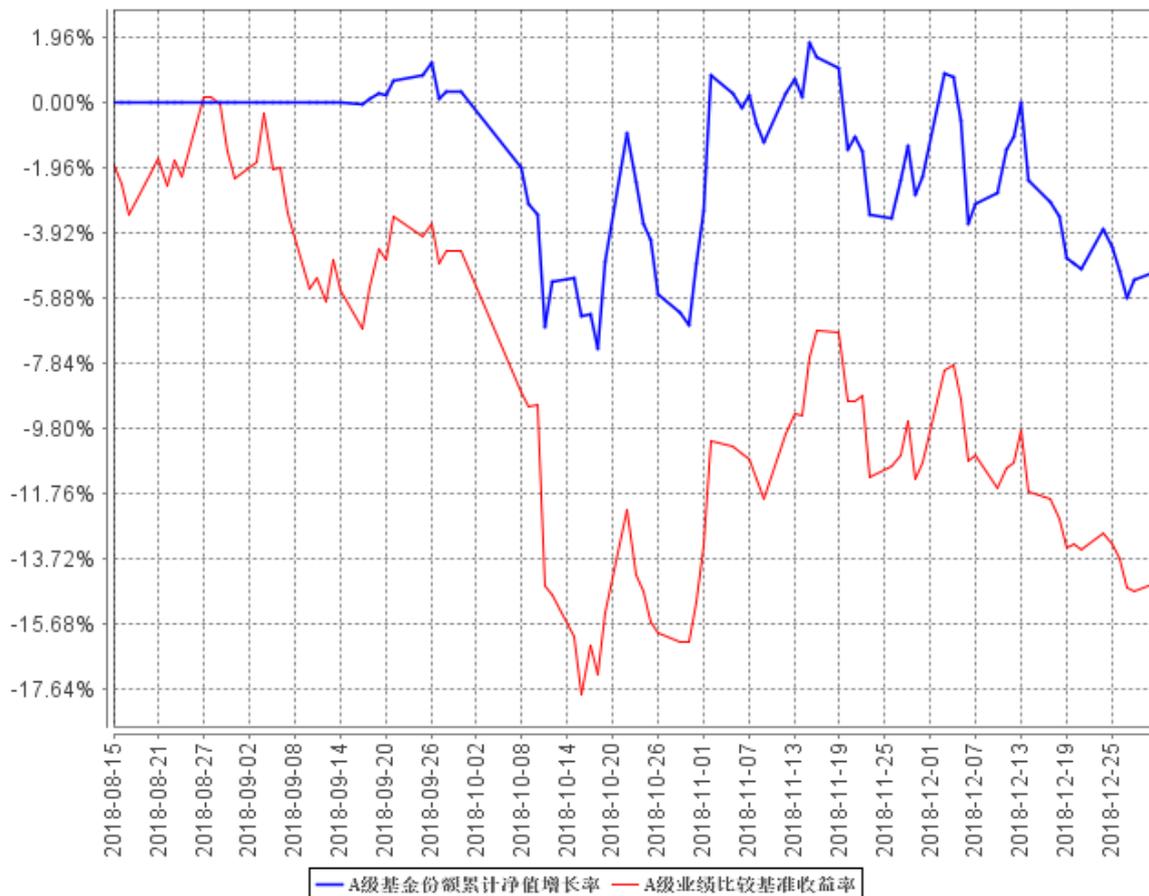
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.34%	1.52%	-10.44%	1.65%	5.10%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-5.05%	1.23%	-14.42%	1.49%	9.37%	-0.26%

宝盈人工智能股票 C

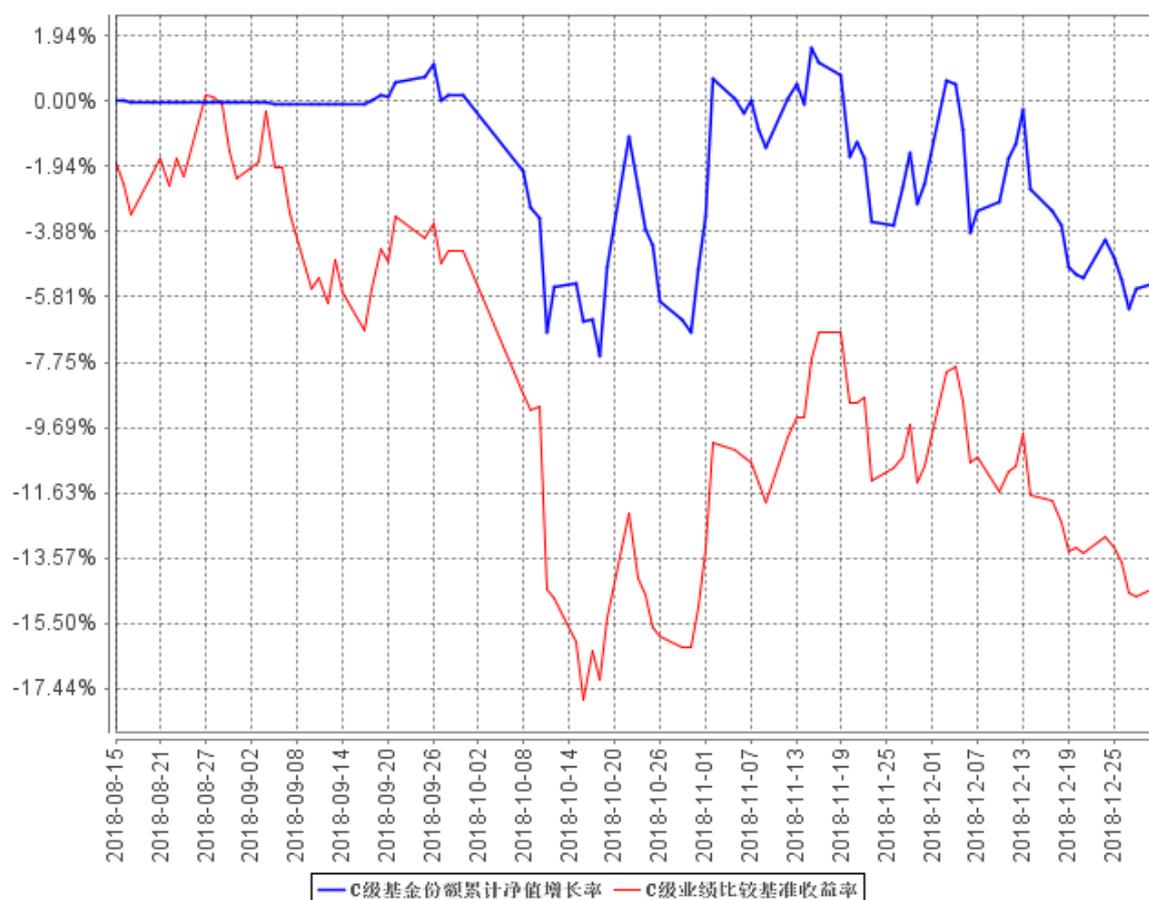
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.52%	1.52%	-10.44%	1.65%	4.92%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-5.34%	1.23%	-14.42%	1.49%	9.08%	-0.26%

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

A级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



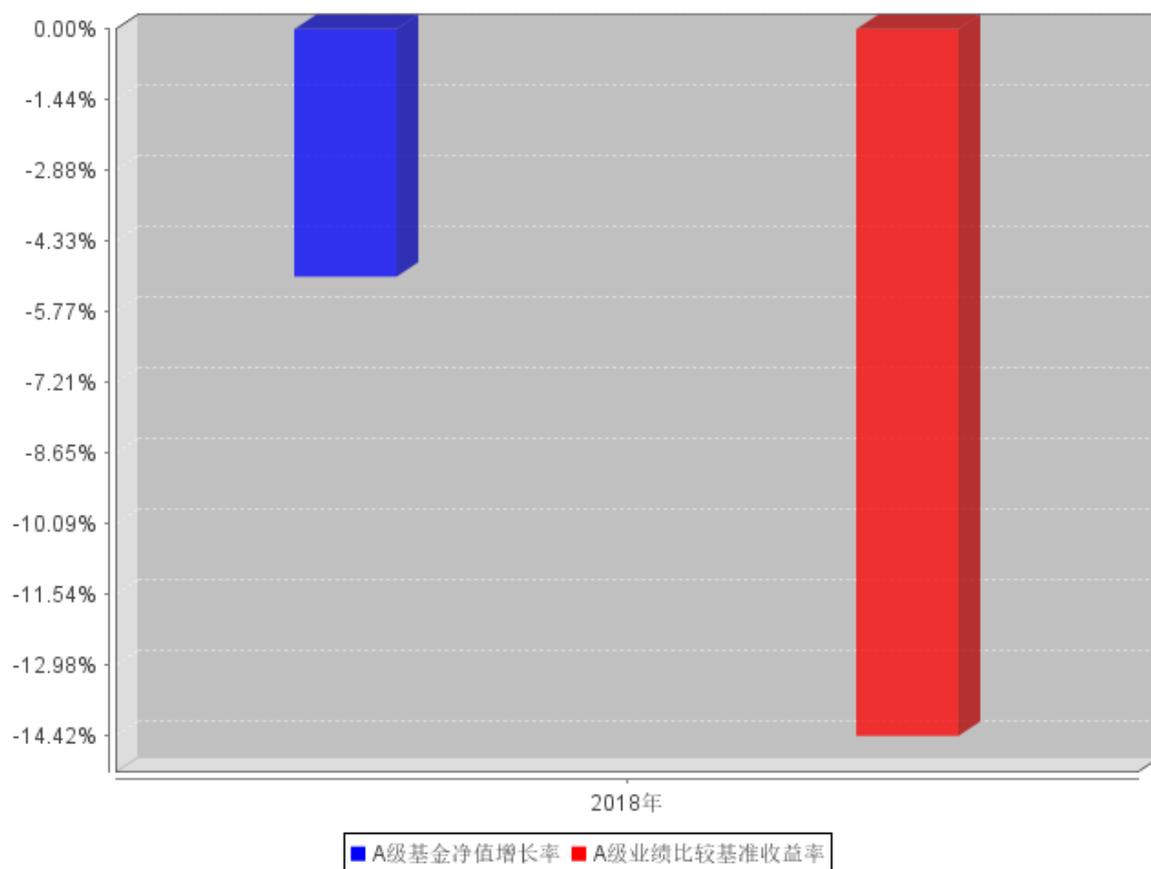
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



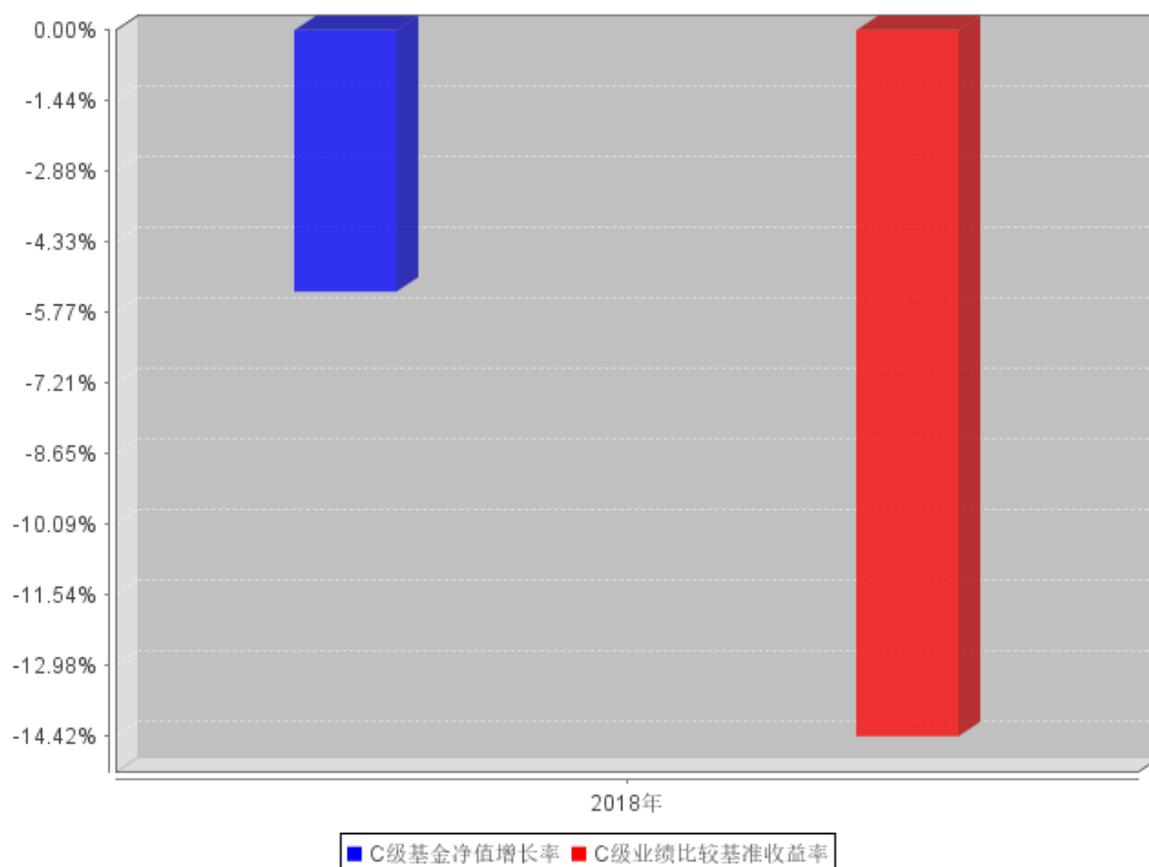
注：1、本基金合同生效日为2018年8月15日，截止本报告期末基金合同生效未满一年。
 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

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

A级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



C级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

本基金合同生效日为 2018 年 8 月 15 日，至报告期末未进行利润分配。

§ 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、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 8 月 15 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、张仲维为首任基金经理，其“任职日期”指基金合同生效日；

2、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遵规守信情况的说明

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%。

本基金主要投资与人工智能相关的行业及公司，人工智能的实现必须有科技硬件为基础，基

金主要布局 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。本基金于 2018 年 8 月 15 日成立，2018 年 A 类基金份额净值下跌 5.05%，C 类基金份额净值下跌 5.34%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈人工智能股票 A 基金份额净值为 0.9495 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.05%，同期业绩比较基准收益率为-14.42%；

截至本报告期末宝盈人工智能股票 C 基金份额净值为 0.9466 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.34%，同期业绩比较基准收益率为-14.42%。

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。

本基金主要投资与人工智能相关的行业及公司，人工智能的实现必须有科技硬件为基础，2019 年主要看好以下方向：1. 5G 相关产业链，包含通信用高频 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验。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

本报告期内，本基金托管人在对宝盈人工智能主题股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，宝盈人工智能主题股票型证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈人工智能主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈人工智能主题股票型证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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20985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：宝盈人工智能主题股票型证券投资基金

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
资 产：	
银行存款	11,813,604.05
结算备付金	207,877.96
存出保证金	21,059.28
交易性金融资产	49,881,257.38
其中：股票投资	49,881,257.38
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	1,026,752.67
应收利息	2,814.69
应收股利	328.05
应收申购款	24,395.54
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	62,978,089.62
负债和所有者权益	本期末 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	345,595.86
应付赎回款	493,482.49
应付管理人报酬	80,227.89
应付托管费	13,371.27
应付销售服务费	23,764.03
应付交易费用	110,469.21
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	50,480.64
负债合计	1,117,391.39
所有者权益：	
实收基金	65,261,047.92
未分配利润	-3,400,349.69
所有者权益合计	61,860,698.23
负债和所有者权益总计	62,978,089.62

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，宝盈人工智能股票 A 基金份额净值 0.9495 元，基金份额总额 29,069,610.73 份；宝盈人工智能股票 C 基金份额净值 0.9466 元，基金份额总额 36,191,437.19 份。宝盈人工智能股票份额总额合计为 65,261,047.92 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：宝盈人工智能主题股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年

	12 月 31 日
一、收入	-2,031,514.47
1. 利息收入	501,037.83
其中：存款利息收入	271,956.64
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	229,081.19
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-409,691.16
其中：股票投资收益	-410,019.21
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	328.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,181,265.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	58,404.38
减：二、费用	1,409,215.36
1. 管理人报酬	700,251.33
2. 托管费	116,708.55
3. 销售服务费	271,100.72
4. 交易费用	238,471.92
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	82,682.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,440,729.83

减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,440,729.83

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈人工智能主题股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 8 月 15 日（基金合同生效日）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）	295,404,342.24	-	295,404,342.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,440,729.83	-3,440,729.83
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）	-230,143,294.32	40,380.14	-230,102,914.18
其中：1. 基金申购款	9,227,414.99	-122,050.08	9,105,364.91
2. 基金赎回款	-239,370,709.31	162,430.22	-239,208,279.09
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）	65,261,047.92	-3,400,349.69	61,860,698.23

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：

_____ 杨凯

基金管理人负责人

_____ 彭玖雯

主管会计工作负责人

_____ 何瑜

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

宝盈人工智能主题股票型证券投资基金(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[2018]719号《关于准予宝盈人工智能主题股票型证券投资基金注册的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈人工智能主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约开放式,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 295,271,106.55 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(2018)第 0482 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈人工智能主题股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 8 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 295,404,342.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,235.69 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《宝盈人工智能主题股票型证券投资基金招募说明书》和《宝盈人工智能主题股票型证券投资基金基金份额发售公告》的规定,根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时,收取认购/申购费用的,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为“A类基金份额”;不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为“C类基金份额”。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《宝盈人工智能主题股票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较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、权证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的相关规定。基金的投资组合比例为:股票(包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票)投资占基金资产的比例为 80%-95%,其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%,投资于人工智能主题相关上市公司股票的比例不低

于非现金基金资产的 80%；本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具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：中证人工智能主题指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×25%+中证综合债券指数收益率×15%。

本财务报表由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

7.4.2 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》、《宝盈人工智能主题股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[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》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2014]81

号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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。

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

(4) 基金卖出股票按 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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴

纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 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(以下简称“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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年8月15日(基金合同生效日)至 2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	700,251.33
其中：支付销售机构的客户维护费	300,354.59

注：支付基金管理人宝盈基金公司的基金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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	116,708.55

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值× 0.25% / 当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈人工智能股票 A	宝盈人工智能股票 C	合计
宝盈基金公司	-	13,618.53	13,618.53
中国工商银行	-	102,058.72	102,058.72
合计	-	115,677.25	115,677.25

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×0.80% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 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

无。

7.4.8.5 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	
	2018 年 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,813,604.05	191,163.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 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 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 49,881,257.38 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 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。

(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	49,881,257.38	79.20
	其中：股票	49,881,257.38	79.20
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	12,021,482.01	19.09
8	其他各项资产	1,075,350.23	1.71
9	合计	62,978,089.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,408,547.28	36.22
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	13,182,122.34	21.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,618,700.00	4.23
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	1,495,000.00	2.42
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,704,369.62	64.18

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例 (%)
------	-----------	---------------

A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	10,176,887.76	16.45
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	10,176,887.76	16.45

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

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	00700	腾讯控股	18,200	5,007,307.76	8.09
2	002463	沪电股份	510,000	3,656,700.00	5.91
3	300567	精测电子	70,000	3,533,600.00	5.71
4	300059	东方财富	250,000	3,025,000.00	4.89
5	300450	先导智能	100,962	2,921,840.28	4.72
6	603960	克来机电	103,600	2,878,008.00	4.65
7	300550	和仁科技	55,000	2,875,400.00	4.65
8	02382	舜宇光学科技	45,000	2,744,258.40	4.44
9	601888	中国国旅	43,500	2,618,700.00	4.23
10	00268	金蝶国际	400,000	2,425,321.60	3.92

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300550	和仁科技	5,973,514.00	9.66
2	300450	先导智能	5,845,177.68	9.45
3	300567	精测电子	5,555,031.21	8.98
4	603960	克来机电	5,324,386.40	8.61
5	00700	腾讯控股	5,235,112.31	8.46
6	00268	金蝶国际	4,704,204.85	7.60
7	300059	东方财富	4,545,770.00	7.35
8	002463	沪电股份	4,456,473.30	7.20
9	02382	舜宇光学科技	4,354,253.21	7.04
10	300308	中际旭创	3,896,770.64	6.30
11	00839	中教控股	3,409,532.93	5.51
12	002410	广联达	3,217,079.71	5.20
13	06068	睿见教育	3,145,400.46	5.08
14	002456	欧菲科技	3,117,740.60	5.04
15	601888	中国国旅	3,110,218.68	5.03
16	002044	美年健康	3,010,509.15	4.87
17	01316	耐世特	2,761,619.53	4.46
18	300571	平治信息	2,693,675.00	4.35
19	601318	中国平安	2,644,721.00	4.28
20	601155	新城控股	2,576,032.70	4.16
21	300347	泰格医药	2,384,128.00	3.85
22	300253	卫宁健康	1,971,399.12	3.19
23	300604	长川科技	1,970,749.00	3.19
24	300073	当升科技	1,909,997.00	3.09

25	002709	天赐材料	1,725,405.00	2.79
26	002439	启明星辰	1,724,135.45	2.79
27	300451	创业慧康	1,625,674.00	2.63
28	603508	思维列控	1,576,572.00	2.55
29	601012	隆基股份	1,442,074.00	2.33
30	300168	万达信息	1,326,895.00	2.14
31	002415	海康威视	1,285,778.00	2.08
32	600570	恒生电子	1,261,961.00	2.04

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300550	和仁科技	3,941,623.00	6.37
2	300308	中际旭创	3,899,641.00	6.30
3	00839	中教控股	3,800,156.34	6.14
4	002456	欧菲科技	3,054,739.20	4.94
5	300450	先导智能	2,839,907.00	4.59
6	06068	睿见教育	2,740,967.86	4.43
7	01316	耐世特	2,672,489.27	4.32
8	603960	克来机电	2,504,719.33	4.05
9	601155	新城控股	2,490,018.00	4.03
10	601318	中国平安	2,489,430.00	4.02
11	300571	平治信息	2,266,402.00	3.66
12	300347	泰格医药	2,190,921.60	3.54
13	00268	金蝶国际	2,188,165.94	3.54
14	002044	美年健康	1,430,174.00	2.31
15	300168	万达信息	1,349,424.00	2.18

16	002415	海康威视	1,248,681.00	2.02
17	600570	恒生电子	1,233,939.83	1.99
18	002463	沪电股份	1,208,145.00	1.95
19	300059	东方财富	1,189,604.24	1.92
20	300602	飞荣达	1,127,600.00	1.82

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	107,159,204.85
卖出股票收入（成交）总额	54,686,662.74

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。

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。

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。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

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未受到公开谴责、处罚。

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

本基金所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	21,059.28
2	应收证券清算款	1,026,752.67
3	应收股利	328.05
4	应收利息	2,814.69
5	应收申购款	24,395.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,075,350.23

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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
宝盈人工智能股票 A	1,206	24,104.15	-	-	29,069,610.73	100.00%
宝盈人工智能股票 C	1,661	21,788.94	-	-	36,191,437.19	100.00%
合计	2,867	22,762.83	-	-	65,261,047.92	100.00%

注：① 本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

② 户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

9.2 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	宝盈人工智能股票 A	52,519.38	0.1807%
	宝盈人工智能股票 C	5,579.74	0.0154%
	合计	58,099.12	0.0890%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	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	宝盈人工智能股票 A	0~10
	宝盈人工智能股票 C	0

有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈人工智能股票 A	0
	宝盈人工智能股票 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈人工智能股票 A	宝盈人工智能股票 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 15 日） 基金份额总额	41,592,292.01	253,812,050.23
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	2,630,408.26	6,597,006.73
减：基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	15,153,089.54	224,217,619.77
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	29,069,610.73	36,191,437.19

§ 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无重大人事变动。

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 50,000 元，目前事务所为第 1 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	
长城证券	1	70,682,863.48	43.67%	64,413.22	44.72%	-
国泰君安	1	48,908,762.99	30.22%	43,351.49	30.10%	-
中泰证券	2	20,913,544.74	12.92%	19,058.54	13.23%	-
中信证券	1	19,988,428.38	12.35%	15,990.75	11.10%	-
浙商证券	2	1,352,268.00	0.84%	1,232.30	0.86%	-
西藏东财证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	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) 本报告期内新租长城证券深圳交易单元一个、国泰君安证券上海交易单元一个、东方证券上海交易单元一个、中信证券深圳交易单元一个、方正证券深圳交易单元一个、川财证券深圳交易单元一个、国信证券深圳交易单元一个、广发证券深圳交易单元一个、中泰证券上海交易单元一个、深圳交易单元一个、浙商证券上海交易单元一个、深圳交易单元一个、西藏东财证券上海交易单元一个、深圳交易单元一个。

(2) 本报告期内无退租交易单元。

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
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	440,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财证券	-	-	-	-	-	-

川财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

§ 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