

# 宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：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 8 月 27 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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。

## §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 | 1,328,561,827.41 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 的大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   | 杨凯                | 贺倩                 |
|         | 联系电话 | 0755-83276688     | 010-66060069       |
|         | 电子邮箱 | yangk@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

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com |
| 基金半年度报告备置地点          | 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       | 37,520,099.46               |
| 本期利润          | 332,670,722.87              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2422                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 19.29%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | -1.0165                     |
| 期末基金资产净值      | 1,865,605,997.02            |
| 期末基金份额净值      | 1.404                       |

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。

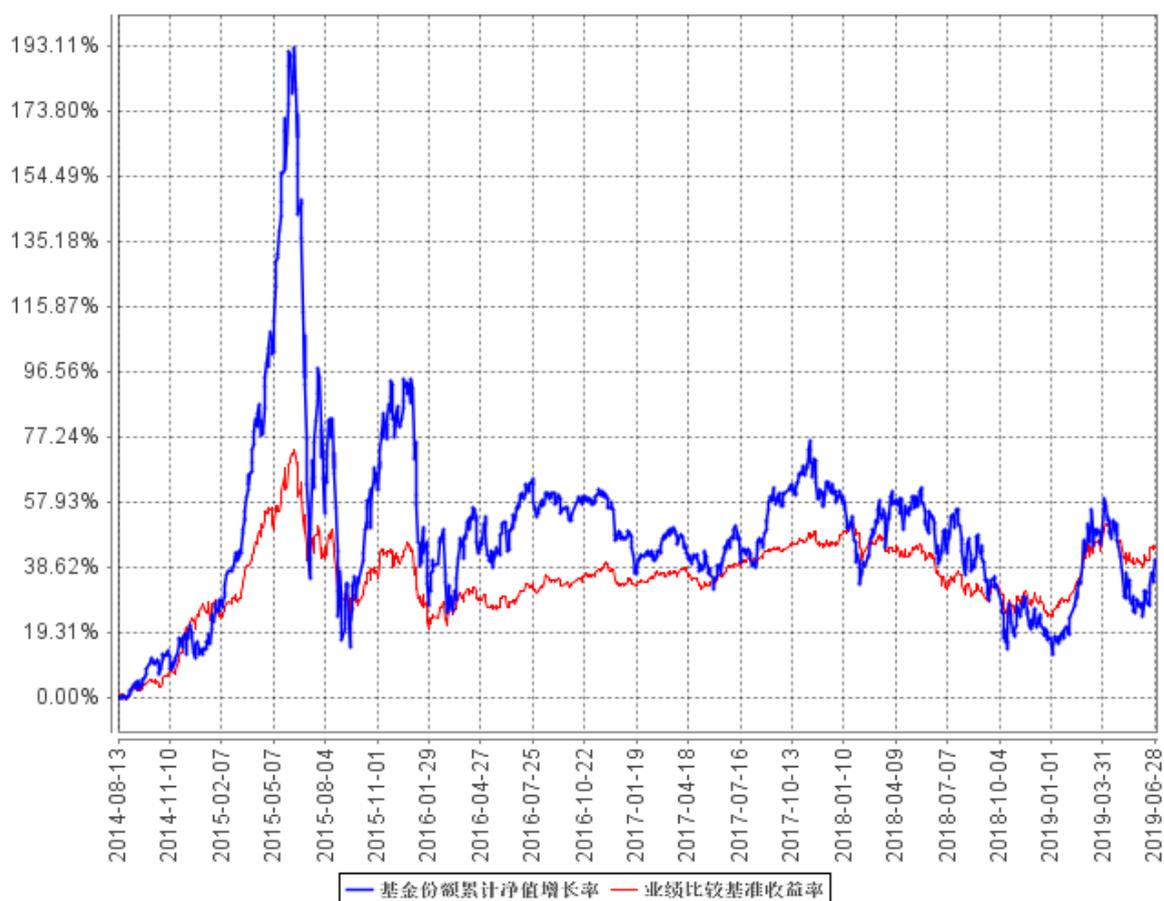
## 3.2 基金净值表现

### 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 9.69%    | 1.79%       | 2.80%      | 0.71%         | 6.89%   | 1.08% |
| 过去三个月      | -6.34%   | 2.10%       | -1.74%     | 0.93%         | -4.60%  | 1.17% |
| 过去六个月      | 19.29%   | 2.01%       | 15.68%     | 0.94%         | 3.61%   | 1.07% |
| 过去一年       | -6.02%   | 1.96%       | 6.39%      | 0.92%         | -12.41% | 1.04% |
| 过去三年       | -10.57%  | 1.52%       | 11.05%     | 0.67%         | -21.62% | 0.85% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.40%   | 2.16%       | 44.26%     | 0.96%         | -3.86%  | 1.20% |

### 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





## §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、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票二十八只基金，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 | -    | 9 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。 |
| 陈卓苗 | 本基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券                               | 2019 年 1 月 18 日 | -    | 4 年    | 陈卓苗先生，金融学硕士。曾就职于上海重阳投资管  |

|  |            |  |  |   |
|--|------------|--|--|---|
|  | 投资基金基金经理助理 |  |  | 理股份有限公司，任研究员；2017 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员。中国国籍，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；  
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 2019 年 6 月 30 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。

### 4.3.2 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

2019 年上半年市场先上后下，一季度市场快速上行后，五月初美国总统特朗普宣布将 2000 亿美元商品关税从 10%加到 25%，中美暂停谈判，使得市场大幅下跌，上半年沪深 300 和创业板分别上涨 27.07%、20.87%。市场表现分化严重，上半年白酒消费等蓝筹股持续上行，科技股则随着中美关系大幅波动。行业指数（以中信一级行业指数为准），涨幅靠前的是食品饮料和非银，分别上涨 60.90%和 44.70%，表现靠后的行业为传媒和建筑，分别上涨 7.97%和 6.59%。本

基金主要投资科技行业中高增长的公司，基金在报告期内持仓维持在 80%-90%之间，主要增加国产软件行业相关公司，报告期内基金上涨 19.29%。

#### 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 1.404 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.29%，业绩比较基准收益率为 15.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5 月 16 日，美国商务部宣布将华为及其附属公司加入管制“实体名单”，此举对于全球科技行业产生重大负面影响，科技行业为全球分工精细的行业，没有一家公司能独立于全球供应链，中美双方从贸易摩擦延伸到科技对抗，大幅压制中国科技行业的发展与科技行业的市场估值。在中美对抗的大背景下，国产化替代成为主要投资方向，尤其在软件和半导体是中国未来发展空间巨大的领域，也是基金重点布局的方向。展望下半年，我们预期科技行业将逐步走出中美贸易战的负面影响，迎接 5G 时代的到来，期待 5G 带来通讯行业的基础建设、消费电子 5G 手机的量产，以及其他 5G 后时代应用的蓬勃发展。

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、消费电子中的光学等。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. 软件行业，包含国产替代相关软件以及转型云化的相关公司。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**

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>      |                        |                          |
| 银行存款            | 174,737,878.60         | 338,176,548.59           |
| 结算备付金           | 2,774,422.24           | 3,014,983.02             |
| 存出保证金           | 928,856.51             | 640,049.94               |
| 交易性金融资产         | 1,701,620,156.43       | 1,344,718,713.53         |
| 其中：股票投资         | 1,699,757,793.55       | 1,344,718,713.53         |
| 基金投资            | -                      | -                        |
| 债券投资            | 1,862,362.88           | -                        |
| 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            | 46,289.13              | 77,933.61                |
| 应收股利            | -                      | -                        |
| 应收申购款           | 2,172,715.43           | 184,953.80               |
| 递延所得税资产         | -                      | -                        |
| 其他资产            | -                      | -                        |
| 资产总计            | 1,882,280,318.34       | 1,686,813,182.49         |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |
|                 | <b>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>2018 年 12 月 31 日</b>  |
| <b>负 债：</b>     |                        |                          |
| 短期借款            | -                      | -                        |
| 交易性金融负债         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债          | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款       | -                      | -                        |
| 应付证券清算款         | 9,234,586.86           | 3,417,054.40             |
| 应付赎回款           | 2,659,010.72           | 584,751.09               |
| 应付管理人报酬         | 2,149,885.91           | 2,193,631.18             |
| 应付托管费           | 358,314.35             | 365,605.21               |
| 应付销售服务费         | -                      | -                        |
| 应付交易费用          | 2,065,612.79           | 1,813,080.07             |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 应交税费          | 14.45            | -                |
| 应付利息          | -                | -                |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 206,896.24       | 200,222.59       |
| 负债合计          | 16,674,321.32    | 8,574,344.54     |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 1,328,561,827.41 | 1,425,468,605.43 |
| 未分配利润         | 537,044,169.61   | 252,770,232.52   |
| 所有者权益合计       | 1,865,605,997.02 | 1,678,238,837.95 |
| 负债和所有者权益总计    | 1,882,280,318.34 | 1,686,813,182.49 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.404 元，基金份额总额

1,328,561,827.41 份。

## 6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           | 357,683,181.66                           | -123,599,928.14                               |
| 1.利息收入                | 1,143,793.09                             | 1,473,696.22                                  |
| 其中：存款利息收入             | 1,013,398.54                             | 1,141,335.71                                  |
| 债券利息收入                | 3,652.62                                 | -   |
| 资产支持证券利息收入            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            | 126,741.93                               | 332,360.51                                    |
| 其他利息收入                | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 60,820,131.89                            | -18,380,501.43                                |
| 其中：股票投资收益             | 54,592,626.01                            | -23,014,600.38                                |
| 基金投资收益                | -  | -   |
| 债券投资收益                | 200,298.11                               | -   |
| 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                  | 6,027,207.77                             | 4,634,098.95                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 295,150,623.41                           | -107,181,195.28                               |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 568,633.27                               | 488,072.35                                    |
| <b>减：二、费用</b>         | 25,012,458.79                            | 27,392,225.52                                 |

|                     |                |                 |
|---------------------|----------------|-----------------|
| 1. 管理人报酬            | 13,792,113.05  | 16,671,152.54   |
| 2. 托管费              | 2,298,685.56   | 2,778,525.41    |
| 3. 销售服务费            | -              | -               |
| 4. 交易费用             | 8,784,778.25   | 7,708,816.38    |
| 5. 利息支出             | -              | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | -              | -               |
| 6. 税金及附加            | 13.19          | -               |
| 7. 其他费用             | 136,868.74     | 233,731.19      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 332,670,722.87 | -150,992,153.66 |
| 减：所得税费用             | -              | -               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 332,670,722.87 | -150,992,153.66 |

### 6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 1,425,468,605.43                           | 252,770,232.52 | 1,678,238,837.95 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 332,670,722.87 | 332,670,722.87   |
| 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）      | -96,906,778.02                             | -48,396,785.78 | -145,303,563.80  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 97,943,190.81                              | 38,557,531.77  | 136,500,722.58   |
| 2. 基金赎回款                               | -194,849,968.83                            | -86,954,317.55 | -281,804,286.38  |
| 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）                        | 1,328,561,827.41                           | 537,044,169.61 | 1,865,605,997.02 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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<br>(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)               | -                | -150,992,153.66 | -150,992,153.66  |
| 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)      | -182,497,674.25  | -100,574,029.95 | -283,071,704.20  |
| 其中：1.基金申购款                             | 85,243,082.22    | 43,066,951.02   | 128,310,033.24   |
| 2.基金赎回款                                | -267,740,756.47  | -143,640,980.97 | -411,381,737.44  |
| 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<br>(基金净值)                    | 1,424,506,510.19 | 703,531,468.86  | 2,128,037,979.05 |

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：

\_\_\_\_\_ 杨凯                      \_\_\_\_\_ 彭玫雯                      \_\_\_\_\_ 何瑜  
 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 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.3 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。

## 6.4.4 关联方关系

### 6.4.4.1 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以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.4.2 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             |
|----------------------------|---------------------|
| 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、注册登记机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |

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。

## 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 6.4.5.2 关联方报酬

#### 6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 13,792,113.05                  | 16,671,152.54                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,852,551.89                   | 8,292,364.07                    |

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。

#### 6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 2,298,685.56               | 2,778,525.41                    |

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  $\times$  0.25% / 当年天数。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内以及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内以及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.5.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.5.5 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月<br>30 日 |                | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                |
|-------|--|----------------|--|----------------|
|       | 期末余额                                     | 当期利息收入         | 期末余额                                       | 当期利息收入         |
|       | 中国农业银行                                   | 174,737,878.60 | 967,254.91                                 | 262,845,473.85 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.6 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.6.1 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

| 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<br>(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

|        |          |                       |                   |            |      |      |       |           |           |   |
|--------|----------|-----------------------|-------------------|------------|------|------|-------|-----------|-----------|---|
| 601236 | 红塔<br>证券 | 2019 年<br>6 月<br>26 日 | 2019 年<br>7 月 5 日 | 新股流<br>通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |
|--------|----------|-----------------------|-------------------|------------|------|------|-------|-----------|-----------|---|

#### 6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.6.3.1 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交易余额。

##### 6.4.6.3.2 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交易余额。

#### 6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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              | 1,699,757,793.55 | 90.30         |
|    | 其中：股票             | 1,699,757,793.55 | 90.30         |
| 2  | 固定收益投资            | 1,862,362.88     | 0.10          |
|    | 其中：债券             | 1,862,362.88     | 0.10          |
|    | 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      | 177,512,300.84   | 9.43          |
| 7  | 其他各项资产            | 3,147,861.07     | 0.17          |
| 8  | 合计                | 1,882,280,318.34 | 100.00        |

### 7.2 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（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
|----|------|---------|---------------|

|   |                  |                  |       |
|---|------------------|------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -                | -     |
| B | 采矿业              | 363,431.25       | 0.02  |
| C | 制造业              | 1,157,330,556.98 | 62.04 |
| 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  | 464,949,818.38   | 24.92 |
| J | 金融业              | 41,653,986.94    | 2.23  |
| K | 房地产业             | -                | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 35,460,000.00    | 1.90  |
| 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               | -                | -     |
|   | 合计               | 1,699,757,793.55 | 91.11 |

### 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  | 002463 | 沪电股份 | 12,221,100 | 166,451,382.00 | 8.92         |
| 2  | 600745 | 闻泰科技 | 5,000,000  | 166,100,000.00 | 8.90         |
| 3  | 300113 | 顺网科技 | 7,500,000  | 117,600,000.00 | 6.30         |
| 4  | 300567 | 精测电子 | 2,083,988  | 109,451,049.76 | 5.87         |
| 5  | 603960 | 克来机电 | 3,800,000  | 103,702,000.00 | 5.56         |
| 6  | 002475 | 立讯精密 | 4,140,126  | 102,633,723.54 | 5.50         |
| 7  | 300450 | 先导智能 | 3,000,000  | 100,800,000.00 | 5.40         |
| 8  | 600588 | 用友网络 | 2,840,104  | 76,341,995.52  | 4.09         |
| 9  | 002371 | 北方华创 | 1,050,000  | 72,712,500.00  | 3.90         |
| 10 | 002916 | 深南电路 | 699,794    | 71,323,004.48  | 3.82         |

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  | 300059 | 东方财富 | 198,068,947.92 | 11.80           |
| 2  | 300113 | 顺网科技 | 157,840,811.08 | 9.41            |
| 3  | 603501 | 韦尔股份 | 155,061,281.44 | 9.24            |
| 4  | 600745 | 闻泰科技 | 146,131,770.42 | 8.71            |
| 5  | 600030 | 中信证券 | 114,030,097.25 | 6.79            |
| 6  | 002371 | 北方华创 | 106,955,230.09 | 6.37            |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 105,005,373.35 | 6.26            |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 100,479,602.48 | 5.99            |
| 9  | 300496 | 中科创达 | 100,296,989.77 | 5.98            |
| 10 | 601688 | 华泰证券 | 97,389,110.95  | 5.80            |
| 11 | 300347 | 泰格医药 | 97,077,616.07  | 5.78            |
| 12 | 300604 | 长川科技 | 88,012,996.34  | 5.24            |
| 13 | 300571 | 平治信息 | 83,719,896.57  | 4.99            |
| 14 | 600570 | 恒生电子 | 69,285,517.72  | 4.13            |
| 15 | 600588 | 用友网络 | 68,895,256.90  | 4.11            |
| 16 | 002463 | 沪电股份 | 67,145,790.65  | 4.00            |
| 17 | 002405 | 四维图新 | 62,785,347.78  | 3.74            |
| 18 | 002916 | 深南电路 | 61,467,256.58  | 3.66            |
| 19 | 300416 | 苏试试验 | 58,540,444.45  | 3.49            |
| 20 | 600438 | 通威股份 | 53,988,956.06  | 3.22            |
| 21 | 600131 | 岷江水电 | 53,174,915.24  | 3.17            |
| 22 | 600519 | 贵州茅台 | 52,154,718.24  | 3.11            |
| 23 | 300590 | 移为通信 | 49,097,512.45  | 2.93            |
| 24 | 002912 | 中新赛克 | 48,629,940.03  | 2.90            |
| 25 | 002439 | 启明星辰 | 46,512,002.17  | 2.77            |
| 26 | 002044 | 美年健康 | 44,080,645.48  | 2.63            |
| 27 | 300559 | 佳发教育 | 43,791,084.36  | 2.61            |
| 28 | 603960 | 克来机电 | 43,431,568.49  | 2.59            |
| 29 | 300567 | 精测电子 | 40,305,391.83  | 2.40            |
| 30 | 601888 | 中国国旅 | 39,320,339.90  | 2.34            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 31 | 300550 | 和仁科技 | 37,559,326.00 | 2.24 |
| 32 | 601318 | 中国平安 | 37,261,596.79 | 2.22 |
| 33 | 300450 | 先导智能 | 36,023,517.67 | 2.15 |
| 34 | 002384 | 东山精密 | 34,511,327.98 | 2.06 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入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。

#### 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  | 300059 | 东方财富 | 260,985,001.96 | 15.55          |
| 2  | 300567 | 精测电子 | 128,987,026.31 | 7.69           |
| 3  | 600030 | 中信证券 | 110,389,941.66 | 6.58           |
| 4  | 603501 | 韦尔股份 | 106,564,081.08 | 6.35           |
| 5  | 002456 | 欧菲光  | 106,179,425.78 | 6.33           |
| 6  | 002410 | 广联达  | 103,415,464.46 | 6.16           |
| 7  | 300347 | 泰格医药 | 96,645,958.27  | 5.76           |
| 8  | 601688 | 华泰证券 | 95,319,138.88  | 5.68           |
| 9  | 300496 | 中科创达 | 93,063,692.10  | 5.55           |
| 10 | 002044 | 美年健康 | 90,701,433.42  | 5.40           |
| 11 | 300604 | 长川科技 | 82,311,392.15  | 4.90           |
| 12 | 002709 | 天赐材料 | 81,047,339.33  | 4.83           |
| 13 | 601012 | 隆基股份 | 76,717,299.61  | 4.57           |
| 14 | 300571 | 平治信息 | 75,119,870.78  | 4.48           |
| 15 | 002415 | 海康威视 | 74,137,594.71  | 4.42           |
| 16 | 601888 | 中国国旅 | 73,779,921.02  | 4.40           |
| 17 | 002463 | 沪电股份 | 72,636,150.20  | 4.33           |
| 18 | 300073 | 当升科技 | 62,874,072.90  | 3.75           |
| 19 | 002405 | 四维图新 | 61,982,912.91  | 3.69           |
| 20 | 600438 | 通威股份 | 60,813,669.98  | 3.62           |
| 21 | 300550 | 和仁科技 | 58,004,456.51  | 3.46           |
| 22 | 002371 | 北方华创 | 54,583,336.98  | 3.25           |
| 23 | 300308 | 中际旭创 | 52,383,006.70  | 3.12           |
| 24 | 600745 | 闻泰科技 | 48,617,141.03  | 2.90           |
| 25 | 603960 | 克来机电 | 47,558,112.38  | 2.83           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 26 | 600570 | 恒生电子 | 47,030,644.49 | 2.80 |
| 27 | 300357 | 我武生物 | 46,220,913.97 | 2.75 |
| 28 | 600131 | 岷江水电 | 44,737,713.86 | 2.67 |
| 29 | 300253 | 卫宁健康 | 44,451,604.80 | 2.65 |
| 30 | 300416 | 苏试试验 | 43,806,889.68 | 2.61 |
| 31 | 603508 | 思维列控 | 40,752,809.77 | 2.43 |
| 32 | 002439 | 启明星辰 | 39,418,964.40 | 2.35 |
| 33 | 300451 | 创业慧康 | 37,067,671.48 | 2.21 |
| 34 | 002912 | 中新赛克 | 36,989,563.76 | 2.20 |
| 35 | 300450 | 先导智能 | 36,158,503.12 | 2.15 |
| 36 | 002475 | 立讯精密 | 35,244,517.86 | 2.10 |

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。

#### 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 | 2,932,500,032.01 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,927,019,038.53 |

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。

#### 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      | -            | -            |
| 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） | 1,862,362.88 | 0.10         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 1,862,362.88 | 0.10         |

#### 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  | 128061 | 启明转债 | 16,772 | 1,862,362.88 | 0.10         |

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 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。

### 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。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 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，在本报告编制日前一年内除闻泰科技、顺网科技外未受到公开谴责、处罚。

2019 年 1 月 9 日，闻泰科技股份有限公司收到上海证券交易所出具的《关于对闻泰科技股

份有限公司和有关责任人予以监管关注的决定》，具体情况如下：2018 年 4 月 28 日，闻泰科技股份有限公司披露了 2017 年度内部控制审计报告。根据上述报告，2017 年 1 月 5 日，公司子公司徐州中茵置业有限公司与关联方西藏中茵集团有限公司签订《借款合同》，约定自 2017 年 1 月 1 日起，中茵集团向徐州中茵提供的借款利率由银行同期贷款利率 4.35% 改为年利率 11.15%，借款期限展期为 2017 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 21 日止。根据公司七届十一次董事会决议，从 2011 年 1 月 1 日起，凡公司及控股子公司向实际控制人及其关联企业借款，一律按银行同等利率计提支付利息。截至 2017 年 12 月 31 日，公司 2017 年度根据上述关联方借款协议计提的关联方借款利息超过同期银行贷款利率部分金额为 52,769,113.34 元，占公司 2016 年经审计净资产的 1.22%，占公司 2016 年经审计净利润的 109.98%，金额较大。根据公司内部的《关联交易制度》，上述关联借款事项应提交董事会审议通过，但公司未就上述关联借款提交董事会审议，截至公司 2017 年年报出具日仍未履行审批程序。据此，公司 2017 年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。同时，根据公司于 2017 年 10 月 31 日披露的 2017 年半年度报告问询函回复公告，截至 2017 年 1 月 1 日，中茵集团向徐州中茵提供的借款余额为 588,753,350.68 元，按照当时约定的借款利率计算，预计 2017 年全年借款利息 65,645,998.60 元。上述借款利息占公司最近一期经审计净资产的 1.53%，达到应当披露的标准。公司应当在 2017 年 1 月签订借款合同时及时披露相关公告，但公司迟至回复 2017 年半年报问询函公告中才予以披露。公司未就上述关联交易事项及时履行信息披露义务。公司于 2017 年 1 月 5 日签订上述关联借款合同时，未及时履行内部决策程序及相应信息披露义务，导致公司 2017 年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 1.4 条、第 2.1 条、第 10.2.4 条等有关规定，对闻泰科技股份有限公司予以监管关注。本基金注意到，以上事件是闻泰科技公司在管理细节上的问题，事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注闻泰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。

2018 年 12 月 25 日，因未及时披露股东质押信息，杭州顺网科技股份有限公司收到深圳证券交易所出具的《关于对杭州顺网科技股份有限公司的监管函》，具体情况如下：公司控股股东华勇于 2018 年 12 月 5 日补充质押 2,154 万股，于 12 月 12 日再次质押 990 万股、质押展期 1,250 万股，合计占公司总股本比例为 6.34%。华勇在办理上述质押业务后已及时告知公司，但公司披露时间为 2018 年 12 月 17 日，因此受到监管关注处分，同时要求公司董事会应充分重视问题，吸取教训，及时整改，采取切实有效措施杜绝此类违规行为的再次发生。根据公司公告，截止 2019 年 5 月 11 日，公司股东华勇已质押 2.06 亿股，占公司总股本的 29.7%，占其持有公

司股份数的 73.67%。公司对相关信息均做了及时准确的披露，有效地杜绝了类似事件的再次发生。《监管函》所揭露的问题已经得到有效整改，对公司业务正常经营不构成影响。

### 7.12.2

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。

### 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   | 928,856.51   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 46,289.13    |
| 5  | 应收申购款   | 2,172,715.43 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,147,861.07 |

### 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，分项与合计项之间可能存在尾差。

## §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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 69,548       | 19,102.80     | 6,473,577.52 | 0.49%      | 1,322,088,249.89 | 99.51%     |

### 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 | 216,510.79 | 0.0163%  |

|       |  |  |
|-------|--|--|
| 持有本基金 |  |  |
|-------|--|--|

**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（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              | 1,425,468,605.43 |
| 本报告期基金总申购份额               | 97,943,190.81    |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 194,849,968.83   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 1,328,561,827.41 |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

(1) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第四次现场会议决议，同意张啸川同志辞去总经理职务。

(2) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第五次现场会议决议，同意聘任杨凯同志担任公司总经理，同时，根据公司章程规定，经营管理层董事由公司总经理担任，经营管理层董事的资格与总经理职务不可分离，任职期间与总经理的任职期间相同，自总经理被任命之日起算，至总经理离职之日自动终止。

(3) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第六次现场会议决议，同意张瑾同志不再担任督察长职务。

以上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。

(4) 根据宝盈基金管理有限公司股东会 2019 年第一次现场会议决议，同意景开强、陈赤不再担任公司董事，马永红、陈恪担任公司董事；同意张建华、刘郁飞不再担任公司监事，陈林、王法立担任公司监事。

(5) 根据宝盈基金管理有限公司第五届监事会第四次现场会议决议，同意张建华不再担任公司监事会主席，由陈林担任监事会主席职务。

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：

(1) 2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

(2) 2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

### 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

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。

## 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 |    |
| 国盛证券   | 1      | 1,908,253,021.30 | 32.58%       | 1,738,992.70 | 32.58%     | -  |
| 浙商证券   | 1      | 879,714,843.51   | 15.02%       | 801,684.74   | 15.02%     | -  |
| 西部证券   | 2      | 730,762,075.64   | 12.48%       | 665,940.48   | 12.48%     | -  |
| 长江证券   | 2      | 616,088,415.67   | 10.52%       | 561,444.12   | 10.52%     | -  |
| 中信证券   | 1      | 523,467,850.25   | 8.94%        | 477,040.08   | 8.94%      | -  |
| 天风证券   | 2      | 374,875,156.55   | 6.40%        | 341,623.90   | 6.40%      | -  |
| 中信建投   | 3      | 318,276,396.89   | 5.43%        | 290,044.84   | 5.43%      | -  |
| 国信证券   | 1      | 253,594,295.98   | 4.33%        | 231,096.92   | 4.33%      | -  |
| 东兴证券   | 1      | 252,413,782.28   | 4.31%        | 230,018.46   | 4.31%      | -  |
| 中泰证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 兴业证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 招商证券   | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 海通证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 银河证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 申万宏源   | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 联储证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 西南证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 国泰君安证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 安信证券   | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 太平洋证券  | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 东方证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中金公司   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 华创证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 金元证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中银国际   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 广发证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 华泰证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 国金证券   | 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席位租用协议。

## 2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

### (I) 租用交易单元情况

本报告期内新租浙商证券深圳交易单元一个；新租中信建投证券深圳交易单元一个；新租国泰君安证券上海交易单元一个；新租海通证券上海交易单元一个；新租银河证券上海交易单元一个；新租金元证券深圳交易单元一个。

### (II) 退租交易单元情况

本报告期内退租中信证券深圳交易单元一个。

## 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 |
| 国盛证券 | 5,703,249.05 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |
| 浙商证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 西部证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 天风证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 中泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源       | - | - | - | - | - | - |
| 联储证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证<br>券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券      | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券       | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际       | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券       | - | - | - | - | - | - |

## §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

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。

### 11.2 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 8 月 27 日