

# 宝盈鸿利收益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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈鸿利收益混合
基金主代码	213001
交易代码	213001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 10 月 8 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	444,401,992.13 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，为基金投资人谋求长期资本增值收益。
投资策略	本基金主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益： （一）战略资产配置策略 基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标，对不同市场的风险收益状况做出判断，

	<p>据此调整股票、债券和现金等大类资产的配置比例。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、行业资金配置策略。首先由行业分析师估计各行业未来的期望增长速度，以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整，寻找总体投资价值被相对低估的行业。根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标，结合经济发展不同阶段对不同行业的影响，决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。</p> <p>2、公司选择策略。本基金对上市公司投资价值的判断，主要依赖于两方面的基础工作：一是从行业发展趋势、公司核心竞争优势、公司运营管理效率的角度对公司进行定性分析，二是通过选择适当的估值模型对公司的投资价值进行定量测算。在筛选过程中，更强调公司长期（3-5 年）的发展和竞争优势、稳定成长的市场、可持续的主营业务利润、良好的现金流和满意的红利分配政策。在对行业内上市公司进行合理排序的基础上，重点投资于位于行业前列的收益型上市公司，排序所依据的主要指标为红利收益率和增长率调整后的市盈率。</p> <p>(三) 固定收益类资产投资策略</p> <p>在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略，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。</p> <p>(四) 权证投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%
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	59,203,915.34
本期利润	118,999,728.33
加权平均基金份额本期利润	0.2522
本期基金份额净值增长率	26.09%
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	0.3154
期末基金资产净值	465,565,873.65
期末基金份额净值	1.048

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。

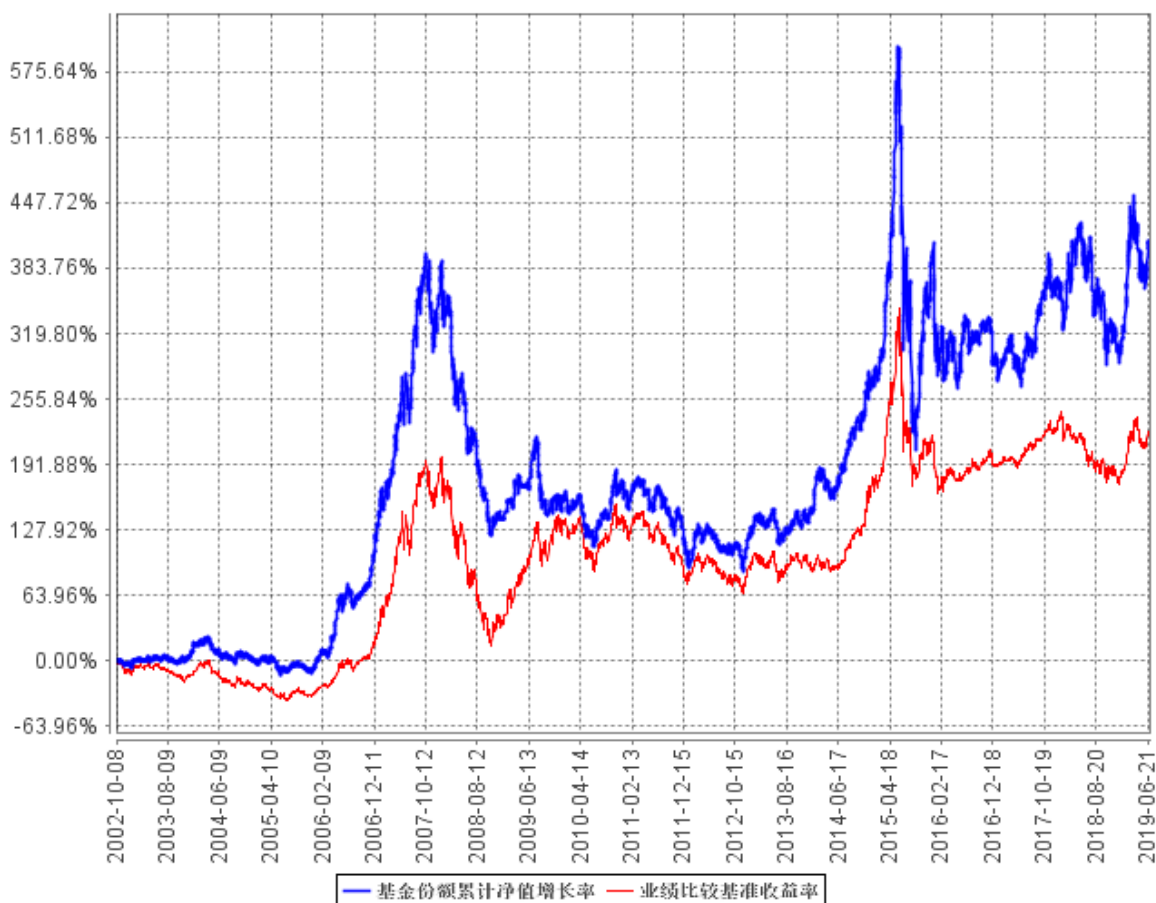
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.90%	1.36%	3.61%	0.75%	1.29%	0.61%
过去三个月	-5.54%	1.59%	-0.70%	0.99%	-4.84%	0.60%
过去六个月	26.09%	1.73%	17.34%	1.00%	8.75%	0.73%
过去一年	2.82%	1.68%	7.49%	0.99%	-4.67%	0.69%
过去三年	19.26%	1.37%	14.58%	0.72%	4.68%	0.65%
自基金合同生效起至今	411.71%	1.41%	222.86%	1.30%	188.85%	0.11%

### 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		
李进	本基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017 年 1 月 4 日	-	9 年	李进先生，武汉大学金融学专业硕士。2007 年 7 月至 2010 年 2 月任职于中国农业银行深圳分行，担任信贷审批员，2010 年 3 月至 2013 年 8 月任职于华泰联合证券研究所，担任研究员。自 2013 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理。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 年上半年本基金配置以成长股为主，基金收益率为 26.09%。组合的配置主要集中在以下 2 个方向：

1、成长股方面，注重增速和估值的匹配，同时考虑稀缺性。集中配置的行业是：新能源、计算机、电子、高端制造业等。

2、业绩稳健增长的医药股。

#### 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 1.048 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.09%，业绩比较基准收益率为 17.34%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济整体风险可控，流动性较为充裕；同时贸易战有所缓解。基于此，我们预计股票市场可能存在结构性机会。

基于当前的时代背景和产业发展趋势，未来组合配置主要集中在医药、新能源、电子、通信、高端制造、券商等行业以及其他估值和业绩相匹配的个股。

### 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

本基金收益分配原则：在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，报告期内本基金共进行了 1 次收益分配：

1、本基金管理人已于 2019 年 5 月 29 日发布公告，以 2019 年 5 月 22 日可供分配利润为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.31 元。

本报告期末宝盈鸿利收益混合可供分配基金份额利润 0.3154 元，基金份额净值 1.048 元。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 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合规守信、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，未发现有关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：宝盈鸿利收益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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	67,493,989.39	137,939,531.27
结算备付金	787,978.94	1,949,173.29
存出保证金	506,307.45	295,721.42
交易性金融资产	416,829,082.58	301,709,002.81
其中：股票投资	416,829,082.58	301,709,002.81
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	-	2,202,322.38
应收利息	11,421.30	31,249.47
应收股利	-	-
应收申购款	256,764.25	20,467.39

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	485,885,543.91	444,147,468.03
<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	17,499,911.80	-
应付赎回款	881,452.43	160,787.93
应付管理人报酬	553,423.66	577,951.97
应付托管费	92,237.23	96,325.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,105,567.63	727,423.57
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,077.51	160,919.29
负债合计	20,319,670.26	1,723,408.10
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	325,420,933.55	378,081,023.25
未分配利润	140,144,940.10	64,343,036.68
所有者权益合计	465,565,873.65	442,424,059.93
负债和所有者权益总计	485,885,543.91	444,147,468.03

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.048 元，基金份额总额 444,401,992.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈鸿利收益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 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
<b>一、收入</b>	126,935,846.86	30,238,897.73
1. 利息收入	334,237.77	331,787.64
其中：存款利息收入	334,237.77	331,787.64
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	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	66,606,282.73	15,973,145.63
其中：股票投资收益	64,374,296.84	15,059,678.15
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	2,231,985.89	913,467.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	59,795,812.99	13,779,763.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	199,513.37	154,200.69
<b>减：二、费用</b>	7,936,118.53	6,379,231.32
1. 管理人报酬	3,557,784.68	3,039,010.74
2. 托管费	592,964.04	506,501.75
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,680,801.69	2,639,232.16
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	104,568.12	194,486.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	118,999,728.33	23,859,666.41
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	118,999,728.33	23,859,666.41

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈鸿利收益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 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）	378,081,023.25	64,343,036.68	442,424,059.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,999,728.33	118,999,728.33

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)	-52,660,089.70	-29,519,768.34	-82,179,858.04
其中：1. 基金申购款	40,829,004.35	16,824,364.28	57,653,368.63
2. 基金赎回款	-93,489,094.05	-46,344,132.62	-139,833,226.67
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)	-	-13,678,056.57	-13,678,056.57
五、期末所有者权益(基金净值)	325,420,933.55	140,144,940.10	465,565,873.65
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	277,025,185.48	112,715,064.47	389,740,249.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,859,666.41	23,859,666.41
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)	124,380,569.67	63,533,541.98	187,914,111.65
其中：1. 基金申购款	188,264,531.35	93,407,340.61	281,671,871.96
2. 基金赎回款	-63,883,961.68	-29,873,798.63	-93,757,760.31
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)	-	-25,292,094.65	-25,292,094.65
五、期末所有者权益(基金净值)	401,405,755.15	174,816,178.21	576,221,933.36

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 \_\_\_\_\_

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

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.2.2 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。

### 6.4.2.3 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。

## 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,557,784.68	3,039,010.74
其中：支付销售机构的客户维护费	558,415.61	573,201.88

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 1.5% 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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	592,964.04	506,501.75

注：支付基金托管人中国农业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

**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**

无。

**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固有资金投资本基金的情况**

无。

**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**

无。

**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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	67,493,989.39	314,912.97	180,499,263.79	311,547.98

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。

**6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	未上市	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

无。

#### 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

无。

##### 6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	416,829,082.58	85.79
	其中：股票	416,829,082.58	85.79
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	68,281,968.33	14.05
7	其他各项资产	774,493.00	0.16
8	合计	485,885,543.91	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	279,143.60	0.06
C	制造业	258,169,947.47	55.45
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	94,769,505.57	20.36
J	金融业	44,948,669.94	9.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,661,816.00	4.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	416,829,082.58	89.53

### 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	000661	长春高新	108,728	36,750,064.00	7.89
2	601688	华泰证券	1,580,000	35,265,600.00	7.57
3	600438	通威股份	2,424,804	34,092,744.24	7.32
4	002912	中新赛克	326,282	30,628,091.34	6.58
5	300601	康泰生物	467,798	24,559,395.00	5.28
6	601012	隆基股份	1,060,400	24,505,844.00	5.26
7	300628	亿联网络	220,875	23,649,086.25	5.08
8	002690	美亚光电	710,800	23,172,080.00	4.98
9	600536	中国软件	428,834	23,015,520.78	4.94
10	300357	我武生物	585,985	19,876,611.20	4.27

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	601688	华泰证券	119,044,636.67	26.91
2	600131	岷江水电	65,579,052.97	14.82

3	600570	恒生电子	45,791,957.35	10.35
4	603826	坤彩科技	45,786,499.44	10.35
5	603019	中科曙光	42,579,403.04	9.62
6	300113	顺网科技	41,005,079.00	9.27
7	000661	长春高新	39,727,791.27	8.98
8	600438	通威股份	39,351,838.62	8.89
9	300122	智飞生物	37,331,254.96	8.44
10	002607	中公教育	36,258,458.00	8.20
11	601318	中国平安	34,073,796.36	7.70
12	300059	东方财富	29,783,864.28	6.73
13	300496	中科创达	29,644,988.75	6.70
14	300567	精测电子	29,277,327.76	6.62
15	300601	康泰生物	28,185,555.23	6.37
16	002912	中新赛克	26,743,367.16	6.04
17	002690	美亚光电	25,903,304.04	5.85
18	002405	四维图新	25,286,185.75	5.72
19	300450	先导智能	24,897,596.08	5.63
20	600745	闻泰科技	24,178,012.35	5.46
21	600536	中国软件	23,614,314.08	5.34
22	600999	招商证券	20,397,219.47	4.61
23	300628	亿联网络	19,812,392.84	4.48
24	300627	华测导航	17,936,066.04	4.05
25	002158	汉钟精机	17,892,776.71	4.04
26	300571	平治信息	16,856,468.00	3.81
27	600763	通策医疗	15,696,552.58	3.55
28	002063	远光软件	15,477,310.40	3.50
29	603960	克来机电	14,559,164.23	3.29
30	300529	健帆生物	14,292,290.22	3.23
31	601012	隆基股份	13,933,843.90	3.15
32	603501	韦尔股份	13,754,349.00	3.11
33	002812	恩捷股份	13,419,663.00	3.03
34	601066	中信建投	12,668,090.00	2.86
35	300188	美亚柏科	12,651,575.84	2.86
36	600741	华域汽车	12,406,222.30	2.80
37	300349	金卡智能	12,197,624.40	2.76
38	300750	宁德时代	12,149,497.50	2.75

39	002371	北方华创	11,931,032.00	2.70
40	000733	振华科技	11,474,709.00	2.59
41	002449	国星光电	11,165,080.48	2.52
42	002709	天赐材料	10,908,001.50	2.47
43	300638	广和通	10,847,090.50	2.45
44	300679	电连技术	10,815,069.40	2.44
45	600837	海通证券	9,679,538.00	2.19
46	300699	光威复材	9,190,486.74	2.08

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。

#### 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	601688	华泰证券	93,228,485.66	21.07
2	300122	智飞生物	76,083,803.35	17.20
3	600131	岷江水电	68,560,096.55	15.50
4	300567	精测电子	62,668,101.08	14.16
5	600438	通威股份	56,650,093.60	12.80
6	603019	中科曙光	52,282,990.35	11.82
7	603826	坤彩科技	47,338,160.40	10.70
8	600570	恒生电子	42,349,587.76	9.57
9	300113	顺网科技	36,289,262.10	8.20
10	601318	中国平安	34,356,844.69	7.77
11	300450	先导智能	33,688,641.91	7.61
12	300601	康泰生物	32,919,377.31	7.44
13	300751	迈为股份	30,012,322.20	6.78
14	002607	中公教育	28,305,230.86	6.40
15	300059	东方财富	28,259,357.38	6.39
16	002912	中新赛克	27,030,295.45	6.11
17	601012	隆基股份	25,479,510.80	5.76
18	300750	宁德时代	25,241,065.57	5.71
19	600999	招商证券	22,180,158.54	5.01
20	600745	闻泰科技	21,985,784.40	4.97
21	002158	汉钟精机	17,060,469.68	3.86
22	600763	通策医疗	16,639,243.00	3.76
23	300571	平治信息	15,301,248.12	3.46

24	300274	阳光电源	15,278,890.59	3.45
25	300496	中科创达	14,401,784.07	3.26
26	002063	远光软件	14,395,009.53	3.25
27	300073	当升科技	14,358,526.47	3.25
28	300349	金卡智能	13,855,831.06	3.13
29	601066	中信建投	13,123,226.81	2.97
30	002812	恩捷股份	12,810,244.61	2.90
31	300357	我武生物	12,758,173.68	2.88
32	002371	北方华创	11,840,699.10	2.68
33	300253	卫宁健康	11,680,264.05	2.64
34	300638	广和通	11,009,801.15	2.49
35	002449	国星光电	10,700,594.75	2.42
36	300188	美亚柏科	10,565,794.00	2.39
37	002709	天赐材料	10,564,566.31	2.39
38	300627	华测导航	10,559,979.52	2.39
39	300679	电连技术	10,407,320.80	2.35
40	600741	华域汽车	10,369,424.51	2.34
41	002405	四维图新	10,142,096.96	2.29
42	600038	中直股份	9,928,300.92	2.24
43	000661	长春高新	9,839,391.20	2.22
44	603960	克来机电	9,343,529.26	2.11

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。

### 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	1,220,533,369.58
卖出股票收入（成交）总额	1,229,583,399.64

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

**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	506,307.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,421.30

5	应收申购款	256,764.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,493.00

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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 (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
21,112	21,049.73	97,301,432.46	21.89%	347,100,559.67	78.11%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	75,606.97	0.0170%

### 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	0~10
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（2002年10月8日）基金份额总额	1,446,415,713.90
本报告期期初基金份额总额	516,306,745.33

本报告期基金总申购份额	55,760,136.91
减:本报告期基金总赎回份额	127,664,890.11
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	444,401,992.13

## § 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	
光大证券	1	736,460,079.86	30.10%	671,137.33	30.04%	-
招商证券	1	535,141,482.25	21.87%	487,674.85	21.83%	-
方正证券	2	531,854,705.83	21.74%	484,683.20	21.69%	-
国信证券	1	349,213,340.35	14.27%	318,232.16	14.24%	-
国泰君安证券	2	230,768,265.82	9.43%	214,914.90	9.62%	-
中信建投证券	1	44,230,507.88	1.81%	40,307.35	1.80%	-
广州证券	2	18,913,502.98	0.77%	17,235.98	0.77%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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、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：



## (I) 租用交易单元情况

本报告期内未新租交易单元。

## (II) 退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

**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**

无。

**§ 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**

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190320-20190630	91,479,387.07	2,858,730.85	-	94,338,117.92	21.23%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，在极端情况下可能存在流动性等风险，敬请投资人留意。							

**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