

宝盈优势产业灵活配置混合型  
证券投资基金  
2019 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商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。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10        |
| 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.....             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12        |
| 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.....       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 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..... | 13        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 14        |
| 6.2 利润表.....                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 33        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 34        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 34        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 36        |
| 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.....      | 36        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 36        |
| 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.....   | 36        |
| 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.....      | 36        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 36        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 37        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 37        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>40</b> |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....               | 40        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....            | 40        |
| 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 .....   | 40        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                  | <b>41</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                    | <b>42</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                     | 42        |
| 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 .....    | 42        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....         | 42        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                       | 42        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....               | 42        |
| 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 .....       | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....              | 43        |
| 10.8 其他重大事件.....                          | 44        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>46</b> |
| 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 ..... | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 46        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                    | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                          | 47        |
| 12.2 存放地点.....                            | 47        |
| 12.3 查阅方式.....                            | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 宝盈优势产业混合            |
| 基金主代码      | 001487              |
| 交易代码       | 001487              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2015 年 8 月 25 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 | 92,610,641.22 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金将通过积极的大类资产配置，重点关注我国的优势产业，深入研究行业个股，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   | <p>本基金的投资策略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金融衍生品投资策略四部分组成。</p> <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。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金遵循重点投资优势产业与行业内精选个股相结合的股票投资策略，包括行业配置策略和个股投资策略。</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）金融衍生品投资策略</p> <p>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×65% + 中证综合债券指数收益率×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                   | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨凯                           | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 0755-83276688                | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | yangk@byfunds.com            | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-300                 | 95588               |
| 传真      |      | 0755-83515599                | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501     | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址    |      | 广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 518034                       | 100140              |
| 法定代表人   |      | 李文众                          | 陈四清                 |

### 2.4 信息披露方式

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 上海证券报           |
| 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    |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                         |
|--------|------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司 | 广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层 |

### § 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       | 15,817,963.75               |
| 本期利润          | 39,977,433.23               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.4059                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 35.09%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 44.03%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 25,843,939.60               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2791                      |
| 期末基金资产净值      | 118,454,580.82              |
| 期末基金份额净值      | 1.279                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 45.83%                      |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

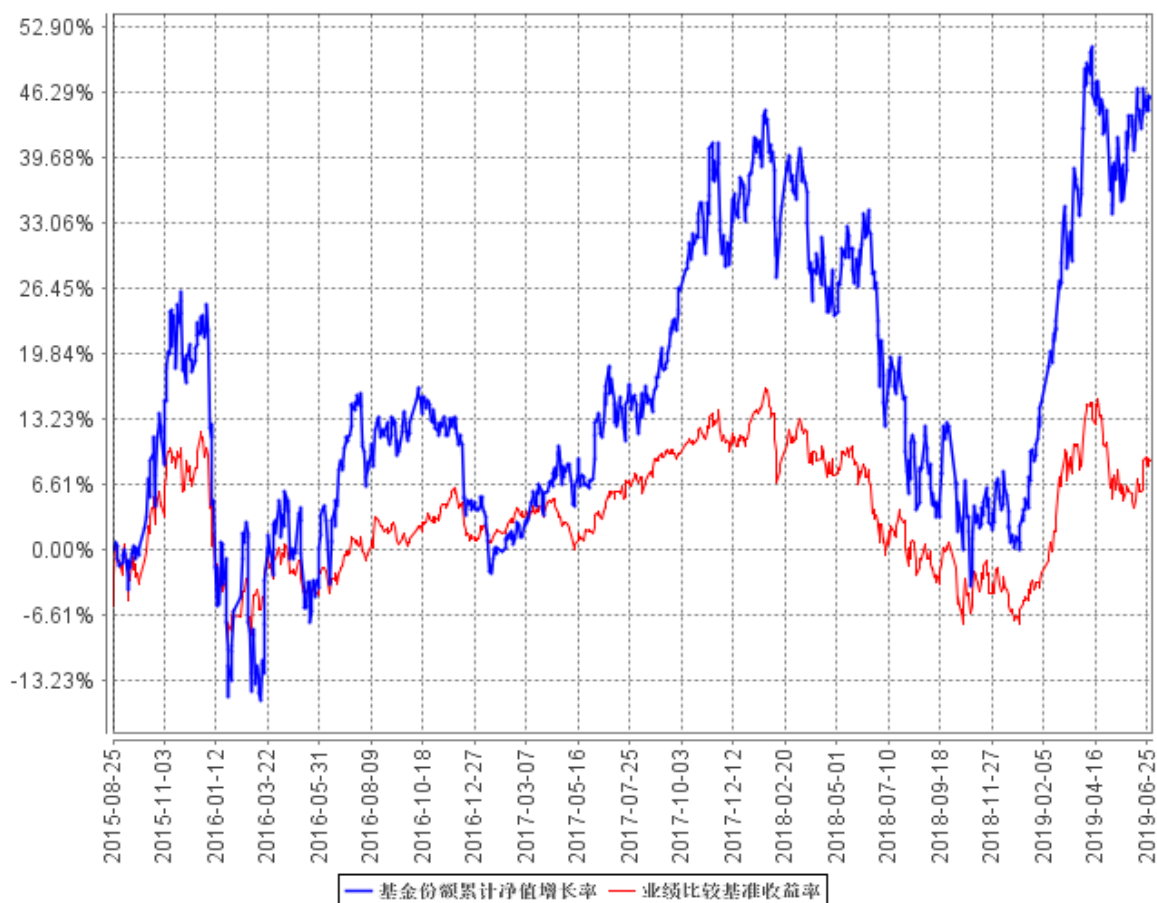
#### 3.2 基金净值表现

##### 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      | 1.35%    | 1.20%       | 2.99%      | 0.77%         | -1.64% | 0.43% |
| 过去三个月      | 2.16%    | 1.70%       | -1.96%     | 1.01%         | 4.12%  | 0.69% |
| 过去六个月      | 44.03%   | 1.61%       | 16.84%     | 1.02%         | 27.19% | 0.59% |
| 过去一年       | 20.32%   | 1.68%       | 6.32%      | 0.99%         | 14.00% | 0.69% |
| 过去三年       | 34.35%   | 1.39%       | 10.87%     | 0.73%         | 23.48% | 0.66% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.83%   | 1.69%       | 9.05%      | 0.90%         | 36.78% | 0.79% |

### 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 |        |   |
| 肖肖  | 本基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈品牌消费股票型证券投资基金基金经理；研究部副总经理 | 2017 年 1 月 7 日  | -    | 11 年   | 肖肖先生，北京大学金融学硕士。2008 年 7 月至 2011 年 4 月任职于联合证券有限责任公司，担任研究员；2011 年 5 月至 2014 年 5 月任职于民生证券有限责任公司，担任研究员；2014 年 6 月至 2015 年 2 月任职于方正证券股份有限公司，担任研究员，自 2015 年 2 月加入宝盈基金管理有限公司研究部，担任研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
| 方佳佳 | 本基金、宝盈消  | 2019 年 1 月 18   | -    | 8 年    | 方佳佳女士，管理学硕士。  |

|  |                                    |   |  |  |
|--|------------------------------------|---|--|--|
|  | 费主题灵活配置<br>混合型证券投资<br>基金基金经理助<br>理 | 日 |  | 曾担任华为技术有限公司海外财经管理部项目财务、深圳展博投资管理有限公司研究部高级研究员,2014年10月加入宝盈基金管理有限公司,担任研究部研究员。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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

回顾 2019 年半年度，本基金在板块选择上坚持选择高景气和稳定成长的细分行业及个股，随着市场整体风险偏好的修复和经济托底政策效应的显现，重点持仓个股的企业价值逐步得到市场发现及认可。本半年度主要持仓集中在地产、白电、乳制品、调味品、保险、白酒、养猪业、煤

炭等估值具备安全边际，同时伴随中国经济增长能获得稳定现金流回报的企业和个股。

#### 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 1.279 元；本报告期基金份额净值增长率为 44.03%，业绩比较基准收益率为 16.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为，2019 年中国的宏观经济将处于磨底的过程。不可忽视的是，经过近几年的去产能及 2016 年以来的供给侧改革，部分传统行业已有显著改善，加上改革和创新的持续推进，向好的力量渐有积蓄。

A 股目前整体处于“估值低分位+盈利能力高分位”的状态，2019 年盈利增速趋势向下，但权益资产价格已部分反映了机构投资者对宏观经济下行的预期。从投资的角度来看，即使经济出现一定程度下滑，部分优质标的的估值水平也提供了较高的安全边际，本产品将继续聚焦核心资产，守正用奇，以守为攻。

目前来看，市场的悲观因素经过一年多的时间已大部分 price in，G20 会谈后中美贸易战再次获得边际改善，有利于整体市场风险偏好的转暖，贸易摩擦对微观经济的影响将会边际减弱，同时相信政府有充足的政策工具实现经济托底。从价值投资的角度来看，目前自下而上选股仍有相当一部分股票处于合理的价值投资区间。

本基金将继续秉承中观行业高景气+自下而上精选高成长个股的策略，坚持价值投资的理念，为投资者追求较高的收益。

#### 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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对宝盈优势产业灵活配置混合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，宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈优势产业灵活配置混合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。本报告期内宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：宝盈优势产业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              | 附注号        | 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            | 6.4.7.1    | 7,254,251.44                   | 4,688,057.64                     |
| 结算备付金           |            | 93,057.64                      | -                                |
| 存出保证金           |            | 25,991.08                      | 8,982.98                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 112,194,322.51                 | 79,202,499.00                    |
| 其中：股票投资         |            | 112,194,322.51                 | 79,202,499.00                    |
| 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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | 277,501.51                       |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,444.94                       | 1,072.49                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 105,250.70                     | 24,835.81                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 119,674,318.31                 | 84,202,949.43                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 824,793.49                     | 82,980.81                        |
| 应付管理人报酬         |            | 145,503.59                     | 109,400.34                       |
| 应付托管费           |            | 24,250.60                      | 18,233.41                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 56,510.33                      | 29,782.20                        |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 168,679.48     | 150,071.62     |
| 负债合计          |          | 1,219,737.49   | 390,468.38     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 92,610,641.22  | 94,333,421.02  |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 25,843,939.60  | -10,520,939.97 |
| 所有者权益合计       |          | 118,454,580.82 | 83,812,481.05  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 119,674,318.31 | 84,202,949.43  |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.279 元，基金份额总额 92,610,641.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈优势产业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                    | 附注号        | 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>           |            | 41,248,731.89                            | -10,229,900.89                                |
| 1.利息收入                |            | 24,927.37                                | 28,577.54                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 24,927.37                                | 28,577.54                                     |
| 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）      |            | 16,756,992.50                            | 4,020,414.33                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 15,863,996.53                            | 3,244,655.83                                  |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 892,995.97                               | 775,758.50                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 24,159,469.48                            | -14,380,056.90                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 307,342.54                               | 101,164.14                                    |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 1,271,298.66                             | 1,360,529.67                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 843,366.34                               | 876,694.98                                    |

|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 140,561.11    | 146,115.83     |
| 3. 销售服务费                   |            | -             | -              |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 217,509.83    | 157,488.19     |
| 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                    | 6.4.7.20   | 69,861.38     | 180,230.67     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 39,977,433.23 | -11,590,430.56 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 39,977,433.23 | -11,590,430.56 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈优势产业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）                        | 94,333,421.02                         | -10,520,939.97 | 83,812,481.05  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 39,977,433.23  | 39,977,433.23  |
| 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）      | -1,722,779.80                         | -3,612,553.66  | -5,335,333.46  |
| 其中：1.基金申购款                             | 60,556,306.17                         | 8,364,904.40   | 68,921,210.57  |
| 2.基金赎回款                                | -62,279,085.97                        | -11,977,458.06 | -74,256,544.03 |
| 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）                        | 92,610,641.22                         | 25,843,939.60  | 118,454,580.82 |



| 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(基金净值)                        | 110,422,115.14                             | 20,229,410.73  | 130,651,525.87 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | -11,590,430.56 | -11,590,430.56 |
| 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)      | -16,018,781.39                             | -2,730,736.84  | -18,749,518.23 |
| 其中：1.基金申购款                             | 30,413,458.82                              | 6,012,440.28   | 36,425,899.10  |
| 2.基金赎回款                                | -46,432,240.21                             | -8,743,177.12  | -55,175,417.33 |
| 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)                        | 94,403,333.75                              | 5,908,243.33   | 100,311,577.08 |

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       | 彭玖雯       | 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 基金基本情况

宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]1119号《关于核准宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司根据经批准的《宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》向社会公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 683,315,539.80 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(2015)第 1042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈优势产业灵活配置混合型证券

投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 683,476,202.80 份基金份额，其中认购资金利息折合 160,663.00 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈优势产业灵活配置混合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良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；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%；本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 7,254,251.44           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 7,254,251.44           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |                |               |
|-------------------|------------------------|----------------|---------------|
|                   | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票                | 90,282,097.37          | 112,194,322.51 | 21,912,225.14 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券                | 交易所市场                  | -              | -             |
|                   | 银行间市场                  | -              | -             |
|                   | 合计                     | -              | -             |
| 资产支持证券            | -                      | -              | -             |
| 基金                | -                      | -              | -             |
| 其他                | -                      | -              | -             |
| 合计                | 90,282,097.37          | 112,194,322.51 | 21,912,225.14 |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,360.41          |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 41.90             |
| 应收债券利息     | -                 |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | 30.93             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 11.70             |
| 合计         | 1,444.94          |

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 56,510.33         |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 56,510.33         |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|       | 2019 年 6 月 30 日 |
|-------|-----------------|
| 应付赎回费 | 564.64          |
| 预提费用  | 168,114.84      |
| 合计    | 168,679.48      |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 94,333,421.02                         | 94,333,421.02  |
| 本期申购          | 60,556,306.17                         | 60,556,306.17  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -62,279,085.97                        | -62,279,085.97 |
| 本期末           | 92,610,641.22                         | 92,610,641.22  |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 13,120,115.49  | -23,641,055.46 | -10,520,939.97 |
| 本期利润           | 15,817,963.75  | 24,159,469.48  | 39,977,433.23  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,138,309.07  | -2,474,244.59  | -3,612,553.66  |
| 其中：基金申购款       | 11,663,911.36  | -3,299,006.96  | 8,364,904.40   |
| 基金赎回款          | -12,802,220.43 | 824,762.37     | -11,977,458.06 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 27,799,770.17  | -1,955,830.57  | 25,843,939.60  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 908.86                                |
| 其他        | 186.10                                |
| 合计        | 24,927.37                             |

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 74,785,133.13              |
| 减：卖出股票成本总额 | 58,921,136.60              |
| 买卖股票差价收入   | 15,863,996.53              |

**6.4.7.13 债券投资收益**

无。

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 892,995.97                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 892,995.97                 |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 24,159,469.48              |
| ——股票投资     | 24,159,469.48              |
| ——债券投资     | -                          |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——贵金属投资    | -                          |

|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| ——其他                       | -             |
| 2. 衍生工具                    | -             |
| ——权证投资                     | -             |
| 3. 其他                      | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -             |
| 合计                         | 24,159,469.48 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 292,521.89           |
| 基金转换费收入 | 14,820.65            |
| 合计      | 307,342.54           |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 217,509.83           |
| 银行间市场交易费用 | -                    |
| 合计        | 217,509.83           |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期                   |
|--------|----------------------|
|        | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 审计费用   | 24,795.19            |
| 信息披露费  | 43,319.65            |
| 银行汇划费用 | 1,746.54             |
| 合计     | 69,861.38            |



## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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（“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（“中国工商银行”） | 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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 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 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 843,366.34                     | 876,694.98                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 373,749.41                     | 390,495.15                      |

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 1.50%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50%/ 当年天数。

**6.4.10.2.2 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 | 140,561.11           | 146,115.83           |

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的费率计提，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。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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    |
| 中国工商银行 | 7,254,251.44         | 23,832.41 | 8,455,570.95         | 27,544.78 |

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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               | 红塔证券 | 2019 年 6 月 26 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46   | 9,789        | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%；且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%；本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月30日   | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|---------------------|--------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                  |              |      |      |                |                |
| 银行存款                | 7,254,251.44 | -    | -    | -              | 7,254,251.44   |
| 结算备付金               | 93,057.64    | -    | -    | -              | 93,057.64      |
| 存出保证金               | 25,991.08    | -    | -    | -              | 25,991.08      |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 112,194,322.51 | 112,194,322.51 |
| 应收利息                | -            | -    | -    | 1,444.94       | 1,444.94       |
| 应收申购款               | -            | -    | -    | 105,250.70     | 105,250.70     |
| 资产总计                | 7,373,300.16 | -    | -    | 112,301,018.15 | 119,674,318.31 |
| 负债                  |              |      |      |                |                |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 824,793.49     | 824,793.49     |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 145,503.59     | 145,503.59     |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 24,250.60      | 24,250.60      |
| 应付交易费用              | -            | -    | -    | 56,510.33      | 56,510.33      |
| 其他负债                | -            | -    | -    | 168,679.48     | 168,679.48     |
| 负债总计                | -            | -    | -    | 1,219,737.49   | 1,219,737.49   |
| 利率敏感度缺口             | 7,373,300.16 | -    | -    | 111,081,280.66 | 118,454,580.82 |
| 上年度末<br>2018年12月31日 | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                  |              |      |      |                |                |
| 银行存款                | 4,688,057.64 | -    | -    | -              | 4,688,057.64   |
| 存出保证金               | 8,982.98     | -    | -    | -              | 8,982.98       |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 79,202,499.00  | 79,202,499.00  |
| 应收证券清算款             | -            | -    | -    | 277,501.51     | 277,501.51     |
| 应收利息                | -            | -    | -    | 1,072.49       | 1,072.49       |
| 应收申购款               | 497.51       | -    | -    | 24,338.30      | 24,835.81      |
| 资产总计                | 4,697,538.13 | -    | -    | 79,505,411.30  | 84,202,949.43  |
| 负债                  |              |      |      |                |                |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 82,980.81      | 82,980.81      |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 109,400.34     | 109,400.34     |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付托管费   | -            | - | - | 18,233.41     | 18,233.41     |
| 应付交易费用  | -            | - | - | 29,782.20     | 29,782.20     |
| 其他负债    | -            | - | - | 150,071.62    | 150,071.62    |
| 负债总计    | -            | - | - | 390,468.38    | 390,468.38    |
| 利率敏感度缺口 | 4,697,538.13 | - | - | 79,114,942.92 | 83,812,481.05 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年6月30日 |               | 上年度末<br>2018年12月31日 |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 112,194,322.51    | 94.72         | 79,202,499.00       | 94.50         |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                 | -             | -                   | -             |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                 | -             | -                   | -             |
| 其他            | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计            | 112,194,322.51    | 94.72         | 79,202,499.00       | 94.50         |

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设             | 除中证 800 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----------------|-------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析             | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|                |                         | 本期末（2019年6月30日）             | 上年度末（2018年12月31日） |
|                | 中证 800 指数上升 5%          | 5,298,048.12                | 4,143,664.05      |
| 中证 800 指数下降 5% | -5,298,048.12           | -4,143,664.05               |                   |

## 6.4.14 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              | 112,194,322.51 | 93.75         |
|    | 其中：股票             | 112,194,322.51 | 93.75         |
| 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      | 7,347,309.08   | 6.14          |
| 7  | 其他各项资产            | 132,686.72     | 0.11          |
| 8  | 合计                | 119,674,318.31 | 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         | 22,084,438.00 | 18.64         |
| B  | 采矿业              | 11,563,291.65 | 9.76          |
| C  | 制造业              | 24,691,532.16 | 20.84         |
| 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  | 39,603.76     | 0.03          |
| J  | 金融业              | 9,488,556.94  | 8.01          |
| K  | 房地产业             | 44,326,900.00 | 37.42         |
| 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               | -             | -             |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -              | -     |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 112,194,322.51 | 94.72 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600872 | 中炬高新 | 279,500   | 11,970,985.00 | 10.11        |
| 2  | 600340 | 华夏幸福 | 361,000   | 11,757,770.00 | 9.93         |
| 3  | 002714 | 牧原股份 | 197,600   | 11,616,904.00 | 9.81         |
| 4  | 601225 | 陕西煤业 | 1,243,300 | 11,488,092.00 | 9.70         |
| 5  | 000961 | 中南建设 | 1,317,100 | 11,406,086.00 | 9.63         |
| 6  | 300498 | 温氏股份 | 291,900   | 10,467,534.00 | 8.84         |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 106,700   | 9,454,687.00  | 7.98         |
| 8  | 000876 | 新希望  | 489,100   | 8,495,667.00  | 7.17         |
| 9  | 000002 | 万科A  | 280,200   | 7,792,362.00  | 6.58         |
| 10 | 601155 | 新城控股 | 179,800   | 7,157,838.00  | 6.04         |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 486,900   | 6,212,844.00  | 5.24         |
| 12 | 000333 | 美的集团 | 78,382    | 4,064,890.52  | 3.43         |
| 13 | 300782 | 卓胜微  | 743       | 80,927.56     | 0.07         |
| 14 | 600968 | 海油发展 | 21,183    | 75,199.65     | 0.06         |
| 15 | 601698 | 中国卫通 | 10,103    | 39,603.76     | 0.03         |
| 16 | 601236 | 红塔证券 | 9,789     | 33,869.94     | 0.03         |
| 17 | 300594 | 朗进科技 | 721       | 31,803.31     | 0.03         |
| 18 | 603867 | 新化股份 | 1,045     | 26,971.45     | 0.02         |
| 19 | 603863 | 松炆资源 | 879       | 20,287.32     | 0.02         |

注：报告期末受市场波动及基金规模变动等影响，本基金持有的中炬高新占基金资产净值比例被动超过 10%。本基金管理人将严格按照法律法规及基金合同的相关规定及时进行调整。

### 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  | 300498 | 温氏股份 | 10,316,091.66 | 12.31          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 2  | 000961 | 中南建设 | 10,178,744.00 | 12.14 |
| 3  | 600340 | 华夏幸福 | 9,024,602.22  | 10.77 |
| 4  | 000876 | 新希望  | 7,960,921.80  | 9.50  |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 4,838,497.00  | 5.77  |
| 6  | 000002 | 万科A  | 4,789,684.70  | 5.71  |
| 7  | 601225 | 陕西煤业 | 4,730,609.53  | 5.64  |
| 8  | 600872 | 中炬高新 | 4,472,130.17  | 5.34  |
| 9  | 601155 | 新城控股 | 4,236,452.00  | 5.05  |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 3,623,877.00  | 4.32  |
| 11 | 002714 | 牧原股份 | 2,313,307.80  | 2.76  |
| 12 | 600989 | 宝丰能源 | 270,838.72    | 0.32  |
| 13 | 600519 | 贵州茅台 | 181,640.00    | 0.22  |
| 14 | 002955 | 鸿合科技 | 58,070.28     | 0.07  |
| 15 | 600968 | 海油发展 | 43,213.32     | 0.05  |
| 16 | 300770 | 新媒股份 | 41,161.46     | 0.05  |
| 17 | 603967 | 中创物流 | 37,135.68     | 0.04  |
| 18 | 300765 | 新诺威  | 34,551.64     | 0.04  |
| 19 | 300771 | 智莱科技 | 34,050.24     | 0.04  |
| 20 | 601236 | 红塔证券 | 33,869.94     | 0.04  |

注：1、买入主要指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  | 600519 | 贵州茅台 | 12,630,803.29 | 15.07          |
| 2  | 600887 | 伊利股份 | 8,739,933.34  | 10.43          |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 8,344,471.71  | 9.96           |
| 4  | 002714 | 牧原股份 | 7,379,346.00  | 8.80           |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 6,048,080.00  | 7.22           |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 5,865,309.40  | 7.00           |
| 7  | 000002 | 万科A  | 5,461,890.40  | 6.52           |
| 8  | 600872 | 中炬高新 | 5,063,452.00  | 6.04           |
| 9  | 600048 | 保利地产 | 3,841,478.25  | 4.58           |
| 10 | 601225 | 陕西煤业 | 2,682,656.00  | 3.20           |
| 11 | 300498 | 温氏股份 | 2,302,087.00  | 2.75           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 601155 | 新城控股 | 1,773,523.77 | 2.12 |
| 13 | 600340 | 华夏幸福 | 1,725,701.88 | 2.06 |
| 14 | 000961 | 中南建设 | 744,408.00   | 0.89 |
| 15 | 600989 | 宝丰能源 | 371,034.24   | 0.44 |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 172,112.00   | 0.21 |
| 17 | 300762 | 上海瀚讯 | 120,812.35   | 0.14 |
| 18 | 002955 | 鸿合科技 | 83,100.00    | 0.10 |
| 19 | 300766 | 每日互动 | 82,913.50    | 0.10 |
| 20 | 300770 | 新媒股份 | 81,300.72    | 0.10 |

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 | 67,753,490.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 74,785,133.13 |

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所有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。

### 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。

## 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中炬高新、中南建设外未受到公开谴责、处罚。

2019 年 4 月 22 日，因未及时披露关联交易信息，中炬高新技术实业股份有限公司收到上海证券交易所出具的《关于对中炬高新技术实业股份有限公司的监管函》，具体情况如下：2018 年 12 月 17 日，公司与关联方朗天慧德签署了《广东厨邦食品有限公司股权转让协议》（以下简称《协议》），约定公司以 3.4 亿元收购持有的厨邦公司剩余 20% 股权。上述《协议》经双方当事人签字盖章，已依法成立。同时，《协议》约定待公司董事会批准后生效。本次交易构成关联交易，交易金额占公司最近一期经审计净资产的 10.82%，达到股东大会的审议标准。公司收购少数股东股权，达到了关联交易的披露标准，是对投资者决策具有重要影响的信息。根据《上海证券交易所股票上市规则》的要求，上市公司应当在董事会形成决议或有关各方签署协议的孰早时点，及时披露相关重大事项。公司理应在签署相关《协议》时，及时对外披露收购子公司股权的关联交易事项，并按规定履行相应的内部决策程序。但公司并未就上述关联交易事项及时履行信息披露义务，也未及时召开董事会、股东大会进行审议，直至 2019 年 3 月 5 日才召开董事会、3 月 20 日才召开股东大会审议批准上述收购子公司股权的《协议》，并进行相应信息披露。公司未及时披露关联交易事项，损害了投资者的知情权。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 2.1 条、第 2.3 条、第 7.3 条、第 10.2.5 条等相关规定，上海证券交易所决定对中炬高新技术实业（集团）股份有限公司予以监管关注；同时要求公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定，规范运作，认真履行信息披露义务；董事、监事、高级

管理人员应当认真履行忠实、勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。本基金注意到，以上事件是中炬高新公司在信息披露上的瑕疵，事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注中炬高新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 7 月 2 日，江苏中南建设集团股份有限公司（以下简称“中南建设”）收到深圳证券交易所出具的《关于对江苏中南建设集团股份有限公司的监管函》，具体情况如下：公司于 2018 年 4 月 27 日披露的 2018 年第一季度报告显示，公司实现归属于上市公司股东的净利润为 37,950.89 万元，同比增长 205.57%，但公司未及时履行业绩预告披露义务。

2018 年 8 月 23 日，中南建设收到江苏证监局出具的《关于对江苏中南建设集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，具体内容如下：公司于 2017 年 11 月 11 日与深圳市和润达投资有限公司（以下简称“深圳和润达”）签署协议，将公司所持中南（深圳）房地产开发有限公司（以下简称“深圳中南”）47%的股权转让给深圳和润达。该笔股权转让中，公司获得股权转让收益 37,726 万元，持有的剩余 18%深圳中南股权按照公允价值计量产生投资收益 12,374 万元，共计实现投资收益 50,100 万元，扣除所得税影响实现净利润 37,357 万元，占公司 2016 年经审计的合并报表归属于母公司的净利润的 91.62%，公司未履行临时信息披露义务。上述行为违反《上市公司信息披露管理办法》（中国证监会令第 40 号）第二条、第三十条的规定，鉴于你公司对该事项在 2017 年年报中进行了披露，并于 2018 年 6 月 7 日进行补充披露，现根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，决定对公司采取出具警示函的监管措施。2019 年 3 月 29 日，由于上述事项，中南建设收到深圳证券交易所出具的《关于对江苏中南建设集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》，对江苏中南建设集团股份有限公司给予通报批评的处分。

本基金注意到，以上中南建设相关事件均是在信息披露上的问题，事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注中南建设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。

## 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   | 25,991.08 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息  | 1,444.94   |
| 5 | 应收申购款 | 105,250.70 |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 132,686.72 |

#### 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<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 |
| 5,793        | 15,986.65     | 57,695.60 | 0.06%      | 92,552,945.62 | 99.94%     |

### 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<br>持有本基金 | 6,347.17   | 0.0069%  |

### 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<br>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（2015年8月25日）基金份额总额 | 683,476,202.80 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 94,333,421.02  |
| 本报告期基金总申购份额               | 60,556,306.17  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 62,279,085.97  |
| 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              | 92,610,641.22  |

## § 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无重大人事变动。

### 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 |    |
| 国泰君安   | 1      | 63,587,306.42 | 44.95%       | 59,217.98 | 45.49%     | -  |
| 广发证券   | 1      | 46,902,783.65 | 33.16%       | 42,742.32 | 32.83%     | -  |
| 西藏东财证券 | 2      | 29,314,979.58 | 20.72%       | 26,714.48 | 20.52%     | -  |
| 浙商证券   | 2      | 1,646,621.36  | 1.16%        | 1,500.58  | 1.15%      | -  |
| 中泰证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券   | 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) 租用交易单元情况

新租海通证券上海交易单元一个。

(2) 退租交易单元情况

退租浙商证券上海、深圳交易单元各一个。

### 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

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                   | 法定披露日期     |
|----|---|--------------------------|------------|
| 1  | 宝盈基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年1月30日 |
| 2  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年3月5日  |
| 3  | 宝盈基金管理有限公司关于新增东海证券为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年3月18日 |
| 4  | 宝盈基金管理有限公司关于新增万联证券为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年3月18日 |
| 5  | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                               | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年3月20日 |
| 6  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年4月2日  |
| 7  | 宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要                          | 上海证券报                    | 2019年4月10日 |
| 8  | 宝盈基金管理有限公司关于新增东北证券为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年5月13日 |
| 9  | 宝盈基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年5月28日 |
| 10 | 宝盈基金管理有限公司关于增加中信证券（山东）有限责任公司                          | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019年6月20日 |

|    |   |                          |                 |
|----|---|--------------------------|-----------------|
|    | 为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告                         |                          |                 |
| 11 | 宝盈基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019 年 6 月 20 日 |
| 12 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告                    | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019 年 6 月 22 日 |
| 13 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告          | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2019 年 6 月 22 日 |

## § 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

### 12.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日