

# 宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资 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.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
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.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
<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>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</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 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金
基金简称	宝盈国家安全沪港深股票
基金主代码	001877
交易代码	001877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 20 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	79,207,325.02 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
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，并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服务；（3）信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。</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	沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率

	×20%。
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。</p> <p>本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p>

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨凯	王永民
	联系电话	0755-83276688	010-66594896
	电子邮箱	yangk@byfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95566
传真		0755-83515599	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		518034	100818
法定代表人		李文众	刘连舸

### 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	基金管理人办公场所、基金托管人住所

### 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	7,135,512.26
本期利润	12,560,869.54
加权平均基金份额本期利润	0.1502
本期加权平均净值利润率	18.87%
本期基金份额净值增长率	20.18%
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	-14,122,173.18
期末可供分配基金份额利润	-0.1783
期末基金资产净值	65,085,151.84
期末基金份额净值	0.822
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	-17.80%

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。

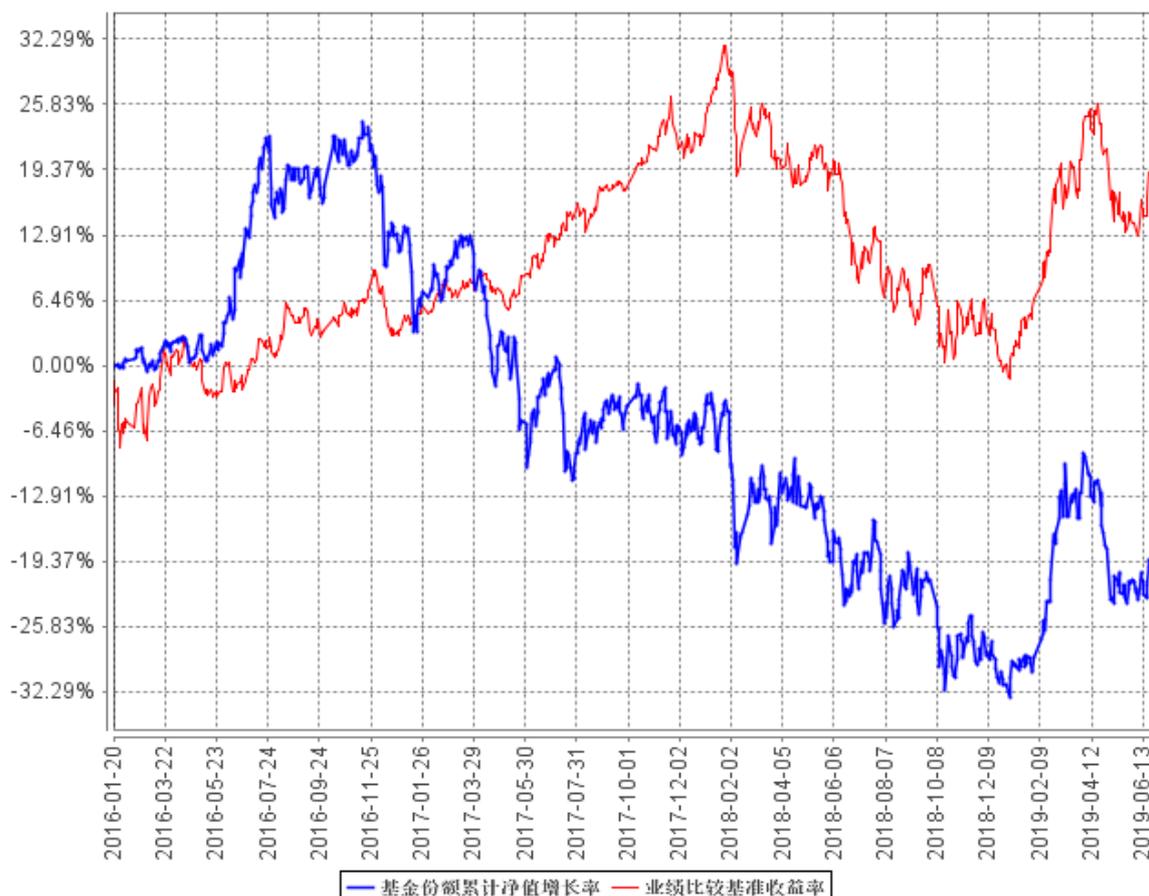
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	4.31%	1.13%	4.36%	0.87%	-0.05%	0.26%
过去三个月	-5.84%	1.56%	-1.11%	1.10%	-4.73%	0.46%
过去六个月	20.18%	1.64%	18.89%	1.12%	1.29%	0.52%
过去一年	2.11%	1.67%	6.14%	1.14%	-4.03%	0.53%
过去三年	-27.32%	1.46%	19.70%	0.83%	-47.02%	0.63%
自基金合同生效起至今	-17.80%	1.39%	19.08%	0.87%	-36.88%	0.52%

### 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		
曹潜	本基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金基金经理	2018 年 2 月 13 日	-	4 年	曹潜先生，北京大学管理学硕士、香港大学金融学硕士。2013 年 7 月至 2014 年 9 月任职于五矿资本控股有限公司；2014 年 10 月至 2018 年 1 月在五矿资本（香港）有限公司证券投资部担任股票研究员。2018 年 2 月加入宝盈基金管理有限公司权益投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
王尚博	本基金基金经理助理	2019 年 1 月 18 日	-	7 年	王尚博先生，经济学硕士。曾在诺安基金任交易员，2015 年 3 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任交易员、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

2019 年上半年市场先扬后抑，在经过一季度较大涨幅后二季度有一定回调，但截止 6 月 30 日仍然保持一定涨幅，其中上证综指、深证成指、沪深 300、中小板和创业板分别上涨 19.45%、26.78%、27.07%、20.75% 和 20.87%。

本基金管理人认为一季度市场的大幅上涨主要是贸易战缓和叠加减税政策刺激带来的估值修复性反弹，而到了二季度贸易战再次恶化造成了市场的调整。在此背景下，本基金管理人主要投资了具备核心技术，未来在实现自主可控和进口替代方面有着巨大发展前景的行业和公司，主要为：1、军工行业中已实现百分之百自给自足且可以向民用方向拓展的元器件公司；2、计算机行业中在云计算、办公、金融等方向可以替代国外产品的核心软件服务商；3、5G 通讯行业中可以逐步替代国外企业的零部件供应商；4、半导体行业中的核心国产设备制造商。

#### 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 0.822 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.18%，业绩比较基准收益率为 18.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，本基金管理人维持年初的判断，认为全年市场为 N 型走势。宏观方面，经济磨底仍需要一个漫长的过程，贸易战问题很难一次性解决，大概率会反复，而其对经济的滞后影响会逐渐体现，因此判断二季度市场的调整还没结束，三季度将会继续震荡下行，如果调整幅度较大将会是很好的买入机会，四季度有望企稳反弹。行业上，本基金管理人认为无论贸易战接下来如何演绎，具备真正完全自主可控能力的硬科技公司都会有巨大的发展空间，军工、半导体、计算机、5G 通讯行业未来 3-5 年都将维持较高的行业景气度，7 月底科创板的开通也会让市场更加聚焦这些科技行业的核心公司，未来估值和业绩有望双击。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,501,353.50	10,127,740.50
结算备付金		149,720.18	161,057.49
存出保证金		40,466.10	34,605.35
交易性金融资产	6.4.7.2	58,615,075.05	52,735,568.70
其中：股票投资		58,614,962.13	52,665,533.70
基金投资		-	-
债券投资		112.92	70,035.00
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		1,004,484.97	-

应收利息	6.4.7.5	1,529.35	6,191.05
应收股利		55,008.18	-
应收申购款		23,660.07	13,376.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		66,391,297.40	63,078,539.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 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		765,065.79	1,289,977.77
应付赎回款		125,148.73	56,921.40
应付管理人报酬		77,558.57	80,429.99
应付托管费		12,926.43	13,404.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	157,210.65	140,227.38
应交税费		0.80	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	168,234.59	150,073.51
负债合计		1,306,145.56	1,731,035.03
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	79,207,325.02	89,631,855.43
未分配利润	6.4.7.10	-14,122,173.18	-28,284,350.87
所有者权益合计		65,085,151.84	61,347,504.56
负债和所有者权益总计		66,391,297.40	63,078,539.59

注：报告截止 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.822 元，基金份额总额 79,207,325.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

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 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>		13,727,738.40	-11,161,764.95
1.利息收入		39,167.28	40,984.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,509.70	38,957.09

债券利息收入		4,657.58	2,027.20
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）		8,234,417.06	-8,755,346.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,972,109.10	-9,036,613.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,775.57	-
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	259,532.39	281,267.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,425,357.28	-2,512,741.37
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	28,796.78	65,338.17
<b>减：二、费用</b>		1,166,868.86	1,604,016.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	493,224.93	639,175.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	82,204.14	106,529.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	518,579.12	675,205.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.32	-
7. 其他费用	6.4.7.20	72,860.35	183,105.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,560,869.54	-12,765,780.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12,560,869.54	-12,765,780.98

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

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）	89,631,855.43	-28,284,350.87	61,347,504.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,560,869.54	12,560,869.54

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)	-10,424,530.41	1,601,308.15	-8,823,222.26
其中：1.基金申购款	8,391,952.24	-1,487,464.54	6,904,487.70
2.基金赎回款	-18,816,482.65	3,088,772.69	-15,727,709.96
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)	79,207,325.02	-14,122,173.18	65,085,151.84
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)	107,082,961.82	-6,516,332.90	100,566,628.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,765,780.98	-12,765,780.98
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)	-11,322,051.25	635,842.99	-10,686,208.26
其中：1.基金申购款	21,653,451.21	-2,885,423.90	18,768,027.31
2.基金赎回款	-32,975,502.46	3,521,266.89	-29,454,235.57
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)	95,760,910.57	-18,646,270.89	77,114,639.68

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

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)监许可[2015]1995号《关于准予宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的批复》,由宝盈基金管理有限公司根据经批准的《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》和《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金招募说明书》向社会公开募集。募集期结束经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并出具普华永道中天验字(2016)第075号验资报告。经向中国证监会备案,《宝盈国家安全战略沪港深股票

型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 20 日正式生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2015 年 12 月 21 日至 2016 年 1 月 15 日止，首次发售募集有效认购金额为人民币 291,375,943.50 元，折合 291,375,943.50 份基金份额；有效资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 72,793.80 元，折合 72,793.80 份基金份额；以上收到的资金共计人民币 291,448,737.30 元，折合 291,448,737.30 份基金份额。本基金管理人为宝盈基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括：本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、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，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：股票(包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票)投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。

#### 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》、《宝盈国家安全战略沪港深股票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和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

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	6,501,353.50
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:	6,501,353.50
-----	--------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	56,644,585.72	58,614,962.13	1,970,376.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	100.00	112.92
	银行间市场	-	-
	合计	100.00	112.92
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	56,644,685.72	58,615,075.05	1,970,389.33

#### 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 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,414.96
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	92.86
应收债券利息	0.10
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	3.15
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.28

合计	1,529.35
----	----------

#### 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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	157,210.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	157,210.65

#### 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	119.75
预提费用	168,114.84
合计	168,234.59

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	89,631,855.43	89,631,855.43
本期申购	8,391,952.24	8,391,952.24
本期赎回(以“-”号填列)	-18,816,482.65	-18,816,482.65
本期末	79,207,325.02	79,207,325.02

#### 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	-21,615,843.38	-6,668,507.49	-28,284,350.87
本期利润	7,135,512.26	5,425,357.28	12,560,869.54
本期基金份额交易产生的变动数	2,096,389.89	-495,081.74	1,601,308.15
其中：基金申购款	-1,628,122.60	140,658.06	-1,487,464.54
基金赎回款	3,724,512.49	-635,739.80	3,088,772.69
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-12,383,941.23	-1,738,231.95	-14,122,173.18
-----	----------------	---------------	----------------

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	30,601.39
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	3,475.95
其他	432.36
合计	34,509.70

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	171,141,098.17
减：卖出股票成本总额	163,168,989.07
买卖股票差价收入	7,972,109.10

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,206,262.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,161,518.00
减：应收利息总额	41,969.01
买卖债券差价收入	2,775.57

**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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	259,532.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	259,532.39

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	5,425,357.28
——股票投资	5,419,761.36
——债券投资	5,595.92
——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增值税	-
合计	5,425,357.28

#### 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	28,043.94
基金转换费收入	752.84
合计	28,796.78

#### 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	518,579.12
银行间市场交易费用	-
合计	518,579.12

### 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	4,745.51
合计	72,860.35

### 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，本基金无须披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须披露的资产负债表日后事项。

### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	493,224.93	639,175.70

其中：支付销售机构的客户维护费	250,573.52	323,617.90
-----------------	------------	------------

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理报酬=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	82,204.14	106,529.25

注：支付基金托管人中国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。

#### 6.4.10.3 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固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
中国银行	6,501,353.50	30,601.39	13,220,595.24	32,549.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 (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**

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，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(包括港股通标的股票)、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同责任，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，本基金持有债券投资占基金资产净值比例为 0.00% (2018 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)

##### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	112.92	-
未评级	-	-
合计	112.92	-

##### 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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	6,501,353.50	-	-	-	6,501,353.50
结算备付金	149,720.18	-	-	-	149,720.18
存出保证金	40,466.10	-	-	-	40,466.10
交易性金融资产	112.92	-	-	-58,614,962.13	58,615,075.05
应收证券清算款	-	-	-	1,004,484.97	1,004,484.97
应收利息	-	-	-	1,529.35	1,529.35
应收股利	-	-	-	55,008.18	55,008.18
应收申购款	-	-	-	23,660.07	23,660.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,691,652.70	-	-	-59,699,644.70	66,391,297.40
负债					

应付证券清算款	-	-	-	765,065.79	765,065.79
应付赎回款	-	-	-	125,148.73	125,148.73
应付管理人报酬	-	-	-	77,558.57	77,558.57
应付托管费	-	-	-	12,926.43	12,926.43
应付交易费用	-	-	-	157,210.65	157,210.65
应交税费	-	-	-	0.80	0.80
其他负债	-	-	-	168,234.59	168,234.59
负债总计	-	-	-	1,306,145.56	1,306,145.56
利率敏感度缺口	6,691,652.70	-	-	-58,393,499.14	65,085,151.84
上年度末 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	10,127,740.50	-	-	-	10,127,740.50
结算备付金	161,057.49	-	-	-	161,057.49
存出保证金	34,605.35	-	-	-	34,605.35
交易性金融资产	70,035.00	-	-	-52,665,533.70	52,735,568.70
应收利息	-	-	-	6,191.05	6,191.05
应收申购款	-	-	-	13,376.50	13,376.50
资产总计	10,393,438.34	-	-	-52,685,101.25	63,078,539.59
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,289,977.77	1,289,977.77
应付赎回款	-	-	-	56,921.40	56,921.40
应付管理人报酬	-	-	-	80,429.99	80,429.99
应付托管费	-	-	-	13,404.98	13,404.98
应付交易费用	-	-	-	140,227.38	140,227.38
其他负债	-	-	-	150,073.51	150,073.51
负债总计	-	-	-	1,731,035.03	1,731,035.03
利率敏感度缺口	10,393,438.34	-	-	-50,954,066.22	61,347,504.56

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2018 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.11%)，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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,837,172.43	-	7,837,172.43
资产合计	-	7,837,172.43	-	7,837,172.43
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,837,172.43	-	7,837,172.43
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,304,700.50	-	4,304,700.50
资产合计	-	4,304,700.50	-	4,304,700.50
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,304,700.50	-	4,304,700.50

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币升值 5%	391,858.62	215,235.03

	所有外币相对人民币贬值 5%	-391, 858. 62	-215, 235. 03
--	----------------	---------------	---------------

#### 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，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例；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（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票）投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 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	58,614,962.13	90.06	52,665,533.70	85.85
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	58,614,962.13	90.06	52,665,533.70	85.85

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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）
	沪深 300 指数上升 5%	3,044,473.77	2,882,057.32
沪深 300 指数下降 5%	-3,044,473.77	-2,882,057.32	

#### 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	58,614,962.13	88.29
	其中：股票	58,614,962.13	88.29
2	固定收益投资	112.92	0.00
	其中：债券	112.92	0.00
	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	6,651,073.68	10.02
7	其他各项资产	1,125,148.67	1.69
8	合计	66,391,297.40	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,837,172.43 元，占净值比为 12.04%。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,992,246.55	3.06
C	制造业	31,579,777.20	48.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	392.85	0.00
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	12,985,419.16	19.95
J	金融业	4,219,953.94	6.48
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	50,777,789.70	78.02

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	2,367,165.06	3.64
H 信息技术	5,470,007.37	8.40
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	7,837,172.43	12.04

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

### 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	00700	腾讯控股	9,200	2,853,546.67	4.38
2	002463	沪电股份	204,900	2,790,738.00	4.29
3	600967	内蒙一机	239,500	2,682,400.00	4.12

4	03888	金山软件	176,000	2,616,460.70	4.02
5	600760	中航沈飞	85,300	2,476,259.00	3.80
6	600588	用友网络	89,410	2,403,340.80	3.69
7	00586	海螺创业	97,500	2,367,165.06	3.64
8	600150	中国船舶	100,100	2,362,360.00	3.63
9	300014	亿纬锂能	74,600	2,272,316.00	3.49
10	600990	四创电子	48,611	2,261,383.72	3.47
11	600570	恒生电子	33,180	2,261,217.00	3.47
12	000333	美的集团	41,600	2,157,376.00	3.31
13	002179	中航光电	63,920	2,138,763.20	3.29
14	002371	北方华创	30,800	2,132,900.00	3.28
15	600030	中信证券	89,100	2,121,471.00	3.26
16	000063	中兴通讯	65,100	2,117,703.00	3.25
17	002368	太极股份	69,300	2,099,790.00	3.23
18	002405	四维图新	129,900	2,091,390.00	3.21
19	000651	格力电器	37,900	2,084,500.00	3.20
20	601318	中国平安	23,300	2,064,613.00	3.17
21	300033	同花顺	20,900	2,055,724.00	3.16
22	603383	顶点软件	23,700	2,045,310.00	3.14
23	601225	陕西煤业	211,300	1,952,412.00	3.00
24	000547	航天发展	198,200	1,894,792.00	2.91
25	000876	新希望	96,400	1,674,468.00	2.57
26	000733	振华科技	91,300	1,504,624.00	2.31
27	300241	瑞丰光电	155,600	924,264.00	1.42
28	300782	卓胜微	396	43,132.32	0.07
29	600968	海油发展	11,221	39,834.55	0.06
30	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.05
31	601698	中国卫通	7,308	28,647.36	0.04
32	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.04
33	300594	朗进科技	541	23,863.51	0.04
34	603863	松炆资源	475	10,963.00	0.02
35	000065	北方国际	45	392.85	0.00

## 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	300033	同花顺	5,804,171.43	9.46

2	002405	四维图新	5,579,929.61	9.10
3	600990	四创电子	5,350,941.62	8.72
4	600967	内蒙一机	5,066,904.00	8.26
5	600030	中信证券	4,291,197.00	6.99
6	300113	顺网科技	4,259,593.90	6.94
7	300424	航新科技	4,177,475.03	6.81
8	002368	太极股份	3,735,870.00	6.09
9	601318	中国平安	3,711,483.00	6.05
10	002402	和而泰	3,613,077.15	5.89
11	03888	金山软件	3,583,268.42	5.84
12	002935	天奥电子	3,465,695.00	5.65
13	02357	中航科工	3,438,227.01	5.60
14	300059	东方财富	3,227,487.77	5.26
15	600760	中航沈飞	3,111,805.00	5.07
16	000547	航天发展	3,104,752.00	5.06
17	002463	沪电股份	3,069,428.00	5.00
18	00700	腾讯控股	3,010,595.91	4.91
19	002179	中航光电	3,008,909.14	4.90
20	000002	万科A	2,814,964.00	4.59
21	002230	科大讯飞	2,797,218.00	4.56
22	002025	航天电器	2,644,843.00	4.31
23	601398	工商银行	2,601,596.00	4.24
24	603960	克来机电	2,517,379.55	4.10
25	00586	海螺创业	2,479,366.40	4.04
26	002624	完美世界	2,417,649.66	3.94
27	02238	广汽集团	2,379,285.96	3.88
28	300241	瑞丰光电	2,367,985.02	3.86
29	603383	顶点软件	2,329,977.00	3.80
30	600570	恒生电子	2,293,085.00	3.74
31	000733	振华科技	2,213,295.00	3.61
32	000063	中兴通讯	2,152,694.00	3.51
33	000333	美的集团	2,139,571.13	3.49
34	600456	宝钛股份	2,130,950.00	3.47
35	002371	北方华创	2,117,868.44	3.45
36	300014	亿纬锂能	2,080,231.00	3.39
37	000876	新希望	2,047,247.00	3.34

38	000858	五粮液	1,970,424.44	3.21
39	600150	中国船舶	1,944,603.00	3.17
40	600011	华能国际	1,934,935.00	3.15
41	601989	中国重工	1,888,065.00	3.08
42	600900	长江电力	1,855,413.00	3.02
43	601225	陕西煤业	1,855,294.00	3.02
44	000651	格力电器	1,854,751.38	3.02
45	600728	佳都科技	1,700,524.00	2.77
46	300166	东方国信	1,589,271.50	2.59
47	300474	景嘉微	1,492,529.00	2.43
48	000100	TCL 集团	1,454,314.00	2.37
49	603200	上海洗霸	1,449,446.00	2.36
50	300420	五洋停车	1,411,340.00	2.30
51	002352	顺丰控股	1,304,906.00	2.13
52	002465	海格通信	1,294,067.00	2.11
53	601939	建设银行	1,229,240.00	2.00

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”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。

#### 7.4.2 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	02357	中航科工	6,390,823.99	10.42
2	600038	中直股份	6,001,558.20	9.78
3	300424	航新科技	5,746,124.25	9.37
4	002414	高德红外	4,501,572.00	7.34
5	002463	沪电股份	4,257,250.77	6.94
6	600011	华能国际	4,180,466.90	6.81
7	300033	同花顺	4,040,318.00	6.59
8	002402	和而泰	3,978,985.80	6.49
9	300567	精测电子	3,953,345.00	6.44
10	002935	天奥电子	3,490,635.56	5.69
11	600760	中航沈飞	3,443,793.02	5.61
12	300113	顺网科技	3,408,442.50	5.56
13	002230	科大讯飞	3,184,447.00	5.19
14	300059	东方财富	3,149,743.00	5.13

15	600990	四创电子	3,053,627.20	4.98
16	002179	中航光电	3,003,310.13	4.90
17	601888	中国国旅	2,999,992.00	4.89
18	002405	四维图新	2,939,558.00	4.79
19	600967	内蒙一机	2,858,087.00	4.66
20	600498	烽火通信	2,835,825.94	4.62
21	600271	航天信息	2,765,215.00	4.51
22	002025	航天电器	2,714,489.00	4.42
23	601398	工商银行	2,638,221.00	4.30
24	000002	万 科 A	2,636,802.00	4.30
25	000063	中兴通讯	2,594,326.20	4.23
26	002624	完美世界	2,394,665.54	3.90
27	603960	克来机电	2,228,784.80	3.63
28	000858	五粮液	2,189,031.68	3.57
29	300253	卫宁健康	2,182,100.00	3.56
30	300550	和仁科技	2,132,012.00	3.48
31	601318	中国平安	2,110,659.00	3.44
32	600030	中信证券	2,105,710.00	3.43
33	002013	中航机电	2,095,471.00	3.42
34	601989	中国重工	2,069,522.00	3.37
35	600728	佳都科技	2,028,594.00	3.31
36	600588	用友网络	1,993,417.00	3.25
37	600456	宝钛股份	1,971,293.65	3.21
38	600900	长江电力	1,957,411.00	3.19
39	002368	太极股份	1,948,796.69	3.18
40	601012	隆基股份	1,943,768.75	3.17
41	603337	杰克股份	1,828,227.00	2.98
42	02238	广汽集团	1,779,315.45	2.90
43	300166	东方国信	1,622,472.00	2.64
44	300365	恒华科技	1,605,871.00	2.62
45	00586	海螺创业	1,599,429.39	2.61
46	300450	先导智能	1,525,672.00	2.49
47	002465	海格通信	1,495,896.00	2.44
48	603200	上海洗霸	1,495,309.00	2.44
49	603690	至纯科技	1,494,129.00	2.44
50	002371	北方华创	1,479,584.00	2.41
51	002352	顺丰控股	1,474,392.00	2.40
52	002511	中顺洁柔	1,420,002.00	2.31

53	300241	瑞丰光电	1,376,927.40	2.24
54	603019	中科曙光	1,365,624.00	2.23
55	300447	全信股份	1,323,206.00	2.16
56	300414	中光防雷	1,314,096.00	2.14
57	300578	会畅通讯	1,307,745.00	2.13
58	601939	建设银行	1,275,761.00	2.08
59	000100	TCL 集团	1,269,090.00	2.07
60	603508	思维列控	1,260,161.00	2.05

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	163,698,656.14
卖出股票收入（成交）总额	171,141,098.17

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）	112.92	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	112.92	0.00

### 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	123025	精测转债	1	112.92	0.00

### 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	40,466.10
2	应收证券清算款	1,004,484.97
3	应收股利	55,008.18

4	应收利息	1,529.35
5	应收申购款	23,660.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,125,148.67

#### 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
3,492	22,682.51	2,482,682.72	3.13%	76,724,642.30	96.87%

### 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	0.00	0.0000%

### 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(2016年1月20日)基金份额总额	291,448,737.30
本报告期期初基金份额总额	89,631,855.43
本报告期基金总申购份额	8,391,952.24

减:本报告期基金总赎回份额	18,816,482.65
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	79,207,325.02

## § 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：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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、基金托管人的托管业务部门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	
中泰证券	1	118,526,852.97	35.49%	108,015.07	35.82%	-
平安证券	1	94,303,121.26	28.23%	85,938.61	28.50%	-
天风证券	2	54,871,163.38	16.43%	50,004.20	16.58%	-
东兴证券	1	26,767,171.12	8.01%	24,392.59	8.09%	-
长城证券	1	25,228,971.42	7.55%	20,183.08	6.69%	-
兴业证券	1	14,315,158.84	4.29%	13,045.36	4.33%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	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，并能为本基金提供全面的信息服。
- (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、本基金本报告期新租西南证券深圳交易单元一个。

4、本基金本报告期末退租证券公司交易单元。

### 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

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
中泰证券	1,001,900.00	91.39%	-	-	-	-
平安证券	94,374.58	8.61%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

### 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 上海证券报 证券日报	2019年1月30日
2	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书摘要	上海证券报	2019年3月5日
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金	中国证券报 证券	2019年3月5日

	持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	时报 上海证券报 证券日报	
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 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 上海证券报 证券日报	2019 年 3 月 18 日
6	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 上海证券报 证券日报	2019 年 3 月 20 日
7	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 上海证券报 证券日报	2019 年 4 月 2 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 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 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 上海证券报 证券日报	2019 年 6 月 20 日
11	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 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 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 上海证券报 证券日报	2019 年 6 月 22 日
14	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行股份有限公司定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报 证券 时报 上海证券报	2019 年 6 月 28 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国家安全战略沪港深股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票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

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

### 12.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，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