

宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈盈泰纯债债券	
基金主代码	005846	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 20 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	719,916,639.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈盈泰纯债债券 A	宝盈盈泰纯债债券 C
下属分级基金的交易代码:	005846	006572
报告期末下属分级基金的份额总额	537,239,564.32 份	182,677,075.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、债券投资策略 本基金以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点，结合估值研究、投资者行为研究，自上而下确定组合整体杠杆率以及货币类、利率类、信用类的债券配置比例。同时，本基金注重微观层面的投资研究及策略，尤其是

	<p>在信用债券领域，具体投资标的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。本基金采用的投资策略主要包括债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略、流动性管理策略。</p> <p>(1) 债券资产配置策略。组合杠杆率及货币类、利率类、信用类债券的配置比例决策主要参考以下几个方面的研究：</p> <p>1) 宏观经济变量（包括但不限于宏观经济增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业周期等）、流动性条件、行业基本面等研究；</p> <p>2) 利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究；</p> <p>3) 宏观流动性环境及货币市场流动性研究；</p> <p>4) 大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。</p> <p>(2) 行业配置策略。基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法，并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究，本基金以分散化配置模式为基础，实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异，在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上，合理地决定不同行业的配置比例。</p> <p>(3) 公司配置策略。基于公司价值研究的重要性，本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况，在充分考虑组合流动性特征的前提下，结合行业周期研究，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，以分散化配置模式为基础策略。</p> <p>(4) 流动性管理策略。本策略侧重对组合可质押券的管理。信用债的质押率水平与其基本面存在一定的相关关系。本基金将在基金合同约定的组合杠杆率以及既定债券资产配置策略下的杠杆率范围内，充分考虑发行人基本面的当前和未来变化的可能性及趋势，合理配置于不同发行主体所发行的债券。</p> <p>2、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析、公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>3、中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合整体风险的目的。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

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		交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨凯	陆志俊
	联系电话	0755-83276688	95559
	电子邮箱	yangk@byfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	400-8888-300	95559	
传真	0755-83515599	021-62701216	

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	宝盈盈泰纯债债券 A	宝盈盈泰纯债债券 C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	10,404,852.11	2,138,568.26
本期利润	12,155,979.21	2,053,027.50
加权平均基金份额本期利润	0.0353	0.0255
本期基金份额净值增长率	3.68%	3.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0618	0.0589
期末基金资产净值	589,333,092.25	199,872,530.91
期末基金份额净值	1.0970	1.0941

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金于 2018 年 12 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈盈泰纯债债券 C”。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈盈泰纯债债券 A

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.34%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.18%	-0.01%
过去三个月	1.37%	0.03%	0.61%	0.06%	0.76%	-0.03%
过去六个月	3.68%	0.04%	1.93%	0.06%	1.75%	-0.02%
过去一年	9.77%	0.06%	5.96%	0.06%	3.81%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.70%	0.06%	6.43%	0.06%	3.27%	0.00%

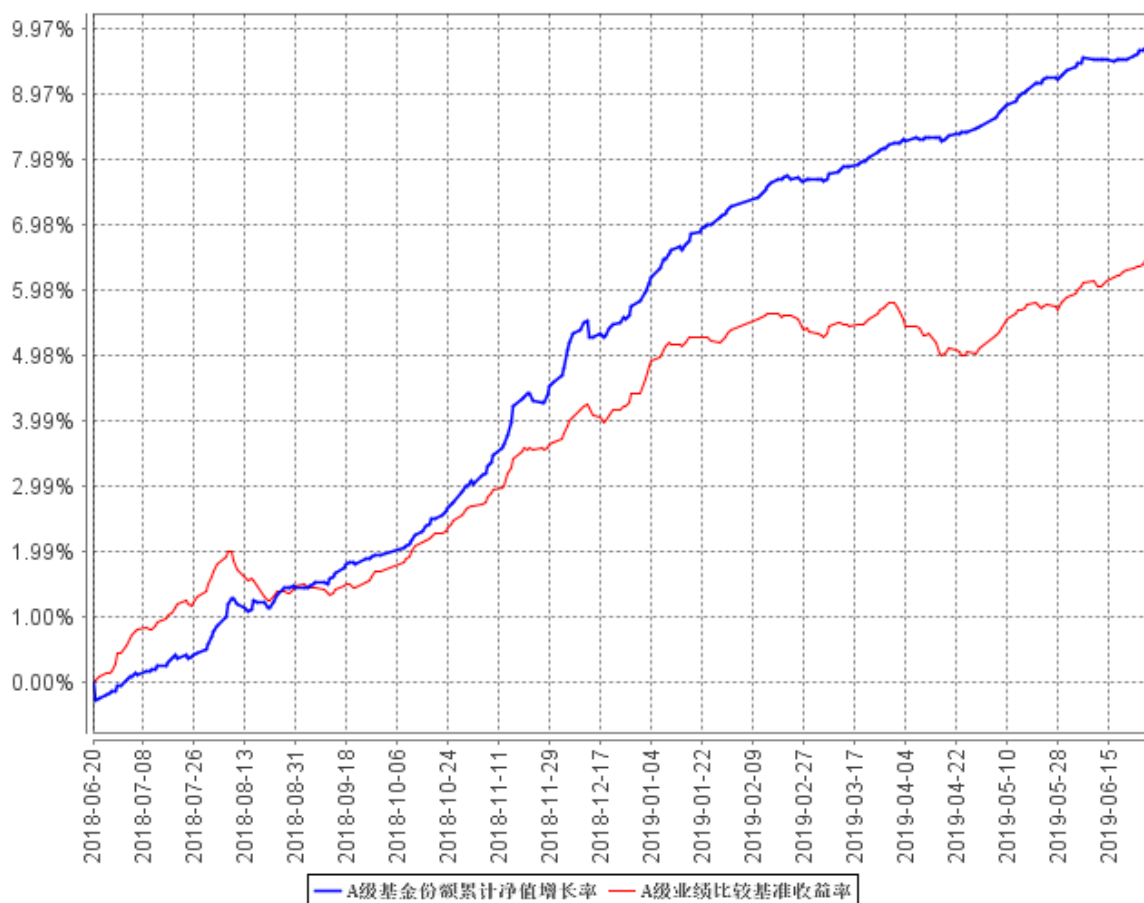
宝盈盈泰纯债债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.28%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.24%	-0.01%
过去三个月	1.24%	0.03%	0.61%	0.06%	0.63%	-0.03%
过去六个月	3.40%	0.04%	1.93%	0.06%	1.47%	-0.02%
自 2018 年 12 月 24 日起至今	3.73%	0.04%	2.19%	0.06%	1.54%	-0.02%

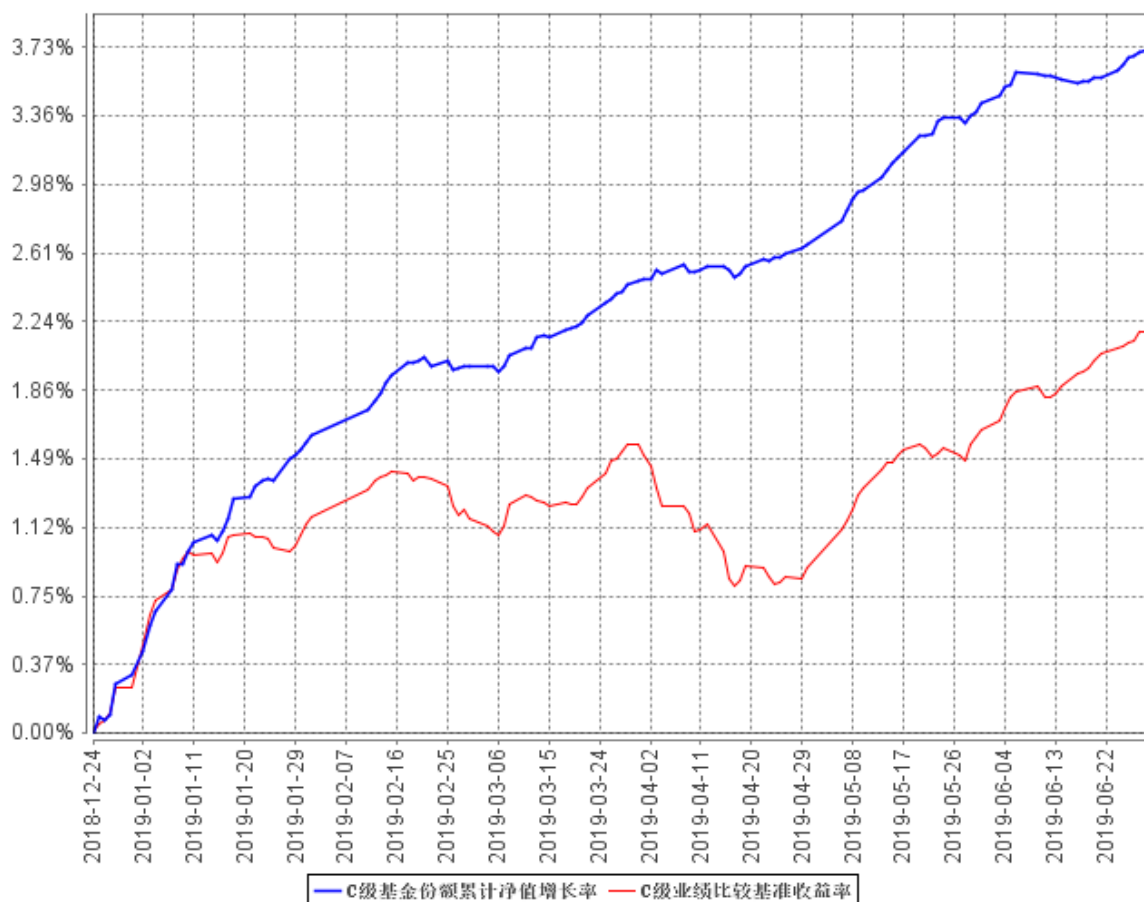
注：1、本基金于 2018 年 12 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈盈泰纯债债券 C”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§ 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		
高宇	本基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金经理；固定收益部副总经理	2018 年 6 月 20 日	-	11 年	高宇先生，厦门大学投资学硕士。2008 年 6 月至 2009 年 8 月任职于第一创业证券资产管理部，担任研究员；2009 年 8 月至 2010 年 10 月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师；2010 年 10 月至 2016 年 6 月任职于博时基金，先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理等职位；2016 年 7 月至 2017 年 8 月任职于天风证券，担任机构业务总部总经理助理。2017 年 8 月加入宝盈基金管理

					有限公司固定收益部，历任宝盈货币市场证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、高宇为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

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，国内经济在消费、出口、投资等方面仍面临着下行的压力，经济的下行趋势比较确定，政策调整成为当前阶段驱动国内资产价格走势的主要原因。股票和转债等风险资产经历了一轮快速的上涨下跌，目前没有观察到明确的盈利驱动，风险偏好的转变是短期影响价格的主要因素；债券的方向较为确定，但空间取决于是否有更积极的政策。

报告期内，本组合增加了对长端利率债的配置比例，后续将重点配置有足够信用利差的中短

期信用债、龙头房企债等资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈盈泰纯债债券 A 基金份额净值为 1.0970 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.68%;截至本报告期末宝盈盈泰纯债债券 C 基金份额净值为 1.0941 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.40%;同期业绩比较基准收益率为 1.93%。

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 下半年,我们认为经济基本面的下行趋势比较确定,通胀略低于年初预期,且在需求回落的背景下压力不大。目前来看中短端信用债的空间比较确定,利差压缩是全年主线,长端利率债的下行空间取决于货币政策价格工具的放松。

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

2019 年度，基金托管人在宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2019 年度，宝盈基金管理有限公司在宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2019 年度，由宝盈基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7,600,774.19	7,501,089.68
结算备付金	2,451,985.95	175,018.75
存出保证金	14,639.53	32,229.76
交易性金融资产	1,007,386,491.50	263,599,778.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,007,386,491.50	263,599,778.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	19,711,411.16	5,073,479.94
应收股利	-	-
应收申购款	4,437,060.53	1,137,613.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,041,602,362.86	277,519,209.19
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	244,949,495.57	53,939,599.09
应付证券清算款	4,031,056.16	-
应付赎回款	2,722,853.55	798,960.22
应付管理人报酬	261,994.59	72,021.06
应付托管费	65,498.65	18,005.25
应付销售服务费	93,650.72	131.56
应付交易费用	25,783.73	12,427.81

应交税费	116,218.26	25,107.61
应付利息	44,190.47	52,074.05
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	85,998.00	50,399.84
负债合计	252,396,739.70	54,968,726.49
所有者权益：		
实收基金	719,916,639.84	210,334,138.32
未分配利润	69,288,983.32	12,216,344.38
所有者权益合计	789,205,623.16	222,550,482.70
负债和所有者权益总计	1,041,602,362.86	277,519,209.19

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，宝盈盈泰纯债债券 A 基金份额净值 1.0970 元，基金份额总额 537,239,564.32 份；宝盈盈泰纯债债券 C 基金份额净值 1.0941 元，基金份额总额 182,677,075.52 份。宝盈盈泰纯债债券份额总额合计为 719,916,639.84 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 20 日(基金合同 生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	17,083,906.54	-76,425.75
1.利息收入	12,796,983.24	318,274.29
其中：存款利息收入	45,647.52	73,776.86
债券利息收入	12,735,518.19	104,587.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,817.53	139,910.13
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,474,884.69	242.97
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,474,884.69	242.97
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,665,586.34	-394,943.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	146,452.27	-
减：二、费用	2,874,899.83	69,530.38
1. 管理人报酬	906,775.55	28,580.03
2. 托管费	226,693.85	7,145.02
3. 销售服务费	212,878.40	-
4. 交易费用	18,888.42	329.47
5. 利息支出	1,361,773.70	21,917.82
其中：卖出回购金融资产支出	1,361,773.70	21,917.82
6. 税金及附加	43,679.64	276.00
7. 其他费用	104,210.27	11,282.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	14,209,006.71	-145,956.13
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	14,209,006.71	-145,956.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金

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）	210,334,138.32	12,216,344.38	222,550,482.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,209,006.71	14,209,006.71
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）	509,582,501.52	42,863,632.23	552,446,133.75
其中：1.基金申购款	906,087,730.49	75,261,305.18	981,349,035.67
2.基金赎回款	-396,505,228.97	-32,397,672.95	-428,902,901.92
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）	719,916,639.84	69,288,983.32	789,205,623.16

项目	上年度可比期间 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)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)	261,208,701.44	-	261,208,701.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-145,956.13	-145,956.13
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	261,208,701.44	-145,956.13	261,062,745.31

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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

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

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	906,775.55	28,580.03
其中：支付销售机构的客户维护费	215,717.68	1,856.05

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 0.40% 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×0.40%/当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

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 6 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	226,693.85	7,145.02

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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×0.10%/当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈盈泰纯债债券 A	宝盈盈泰纯债债券 C	合计
宝盈基金公司	-	15,388.90	15,388.90

交通银行	-	-	-
合计	-	15,388.90	15,388.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈盈泰纯债债券 A	宝盈盈泰纯债债券 C	合计
宝盈基金公司	-	-	-
交通银行	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	宝盈盈泰纯债债券 A	宝盈盈泰纯债债券 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 20 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	19,159,800.73	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,159,800.73	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.57%	-

本基金合同生效日为 2018 年 6 月 20 日，上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)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
交通银行	7,600,774.19	32,671.09	20,907,255.98	16,137.96

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金不参与股票资产投资。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金不参与股票资产投资。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 122,949,495.57 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011901196	19 农垦 SCP004	2019 年 7 月 4 日	99.99	300,000	29,997,000.00
041900057	19 冀中能源 CP003	2019 年 7 月 4 日	99.98	200,000	19,996,000.00
041900163	19 冀中能源 CP005	2019 年 7 月 4 日	100.01	200,000	20,002,000.00
101900716	19 中电投	2019 年 7 月	100.33	200,000	20,066,000.00

	MTN008B	4 日			
101900722	19 古井 MTN001	2019 年 7 月 4 日	100.16	200,000	20,032,000.00
101900720	19 宁经开 MTN001	2019 年 7 月 3 日	101.14	255,000	25,790,700.00
合计				1,355,000	135,883,700.00

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 122,000,000.00 元。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,007,386,491.50	96.72
	其中：债券	1,007,386,491.50	96.72
	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	10,052,760.14	0.97
7	其他各项资产	24,163,111.22	2.32
8	合计	1,041,602,362.86	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金不参与股票资产投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金不参与股票资产投资。

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

本基金不参与股票资产投资。

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

本基金不参与股票资产投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不参与股票资产投资。

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	31,890,400.00	4.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,983,000.00	1.26
	其中：政策性金融债	9,983,000.00	1.26
4	企业债券	370,534,091.50	46.95
5	企业短期融资券	301,065,000.00	38.15
6	中期票据	293,914,000.00	37.24
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,007,386,491.50	127.65

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	155406	19 恒大 01	498,160	50,314,160.00	6.38
2	101800861	18 淮安开发 MTN004	400,000	41,084,000.00	5.21
3	136101	15 合景 01	400,000	40,652,000.00	5.15
4	011900947	19 南山集 SCP002	400,000	40,084,000.00	5.08
5	112874	19 物美 01	400,000	39,960,000.00	5.06

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合整体风险的目的。

7.10.2 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投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	14,639.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,711,411.16
5	应收申购款	4,437,060.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,163,111.22

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不参与股票资产投资。

7.11.6 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝盈盈泰纯债债券 A	6,366	84,392.01	299,363,135.93	55.72%	237,876,428.39	44.28%
宝盈盈泰纯债债券 C	5,128	35,623.45	734,889.00	0.40%	181,942,186.52	99.60%
合计	11,494	62,634.13	300,098,024.93	41.69%	419,818,614.91	58.31%

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

②户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝盈盈泰纯债债券 A	541,749.13	0.1008%
	宝盈盈泰纯债债券 C	1,902,810.68	1.0416%
	合计	2,444,559.81	0.3396%

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

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	宝盈盈泰纯债债券 A	0
	宝盈盈泰纯债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	宝盈盈泰纯债债券 A	10~50

开放式基金	宝盈盈泰纯债债券 C	50~100
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈盈泰纯债债券 A	宝盈盈泰纯债债券 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 20 日）基金份额总额	261,208,701.44	-
本报告期初基金份额总额	208,119,702.77	2,214,435.55
本报告期基金总申购份额	572,675,273.18	333,412,457.31
减：本报告期基金总赎回份额	243,555,411.63	152,949,817.34
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	537,239,564.32	182,677,075.52

§ 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	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(I) 租用交易单元情况

本报告期内未新租交易单元。

(II) 退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	288,994,207.74	100.00%	1,875,300,000.00	100.00%	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

宝盈基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日