

宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	11
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	11
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	12
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
§ 5 托管人报告	12
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
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	38
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	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38

§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
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
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
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	41
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈新价值混合	
基金主代码	000574	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 4 月 10 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	352,989,201.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C
下属分级基金的交易代码:	000574	007574
报告期末下属分级基金的份额总额	350,355,270.97 份	2,633,930.83 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以超越业绩比较基准为目标，在严格控制下行风险的基础上进行有效的资产配置与投资标的精选，力争实现资产的稳定增值。
投资策略	本基金将实施积极主动的投资策略，运用多种方法进行资产配置。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四个部分组成。 （一）大类资产配置策略 本基金大类资产配置的策略目标是一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。 （二）股票投资策略 本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式来构建备选股票库。 （三）固定收益类资产投资策略 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、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略，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。 （四）权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	张磊	张燕
	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518034	518040
法定代表人		马永红	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金中期报告备置地点	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

基金级别	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	187,190,978.47	2,064,837.57
本期利润	93,201,651.54	-254,735.74
加权平均基金份额本期利润	0.2148	-0.0543
本期加权平均净值利润率	13.05%	-3.31%
本期基金份额净值增长率	16.86%	16.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	228,373,926.53	1,689,387.79
期末可供分配基金份额利润	0.6518	0.6414
期末基金资产净值	657,907,053.74	4,896,981.75
期末基金份额净值	1.878	1.859
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	182.49%	24.10%

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

宝盈新价值混合 A

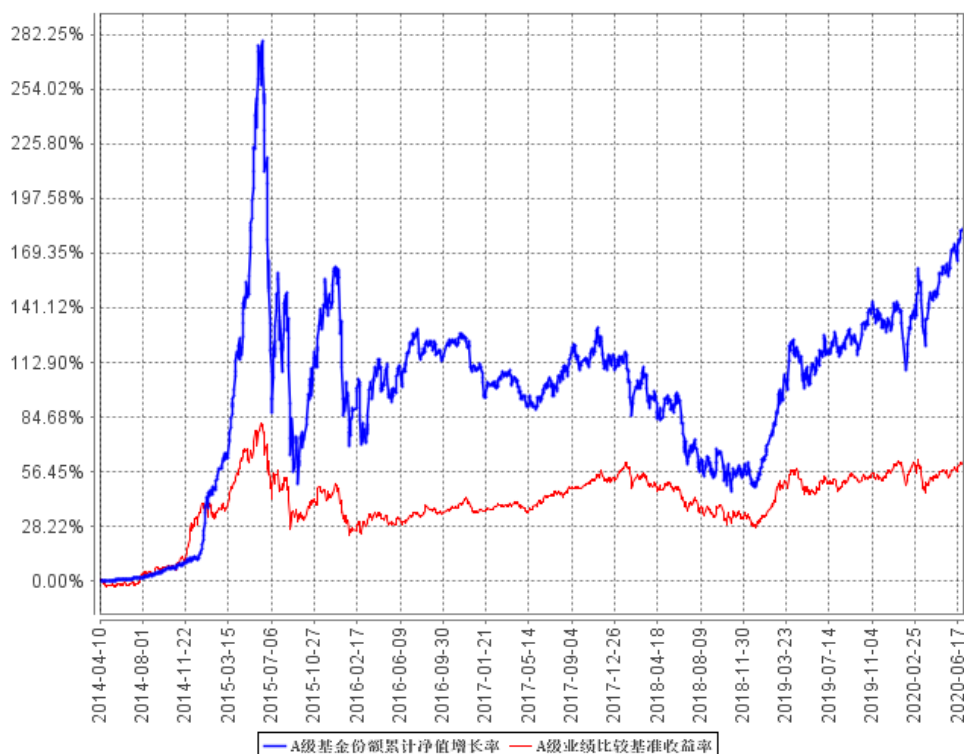
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.77%	0.88%	4.60%	0.58%	2.17%	0.30%
过去三个月	16.94%	0.88%	7.91%	0.58%	9.03%	0.30%
过去六个月	16.86%	1.55%	1.68%	0.98%	15.18%	0.57%
过去一年	29.25%	1.33%	6.82%	0.79%	22.43%	0.54%
过去三年	39.63%	1.43%	12.24%	0.81%	27.39%	0.62%
自基金合同生效起至今	182.49%	1.87%	61.72%	0.98%	120.77%	0.89%

宝盈新价值混合 C

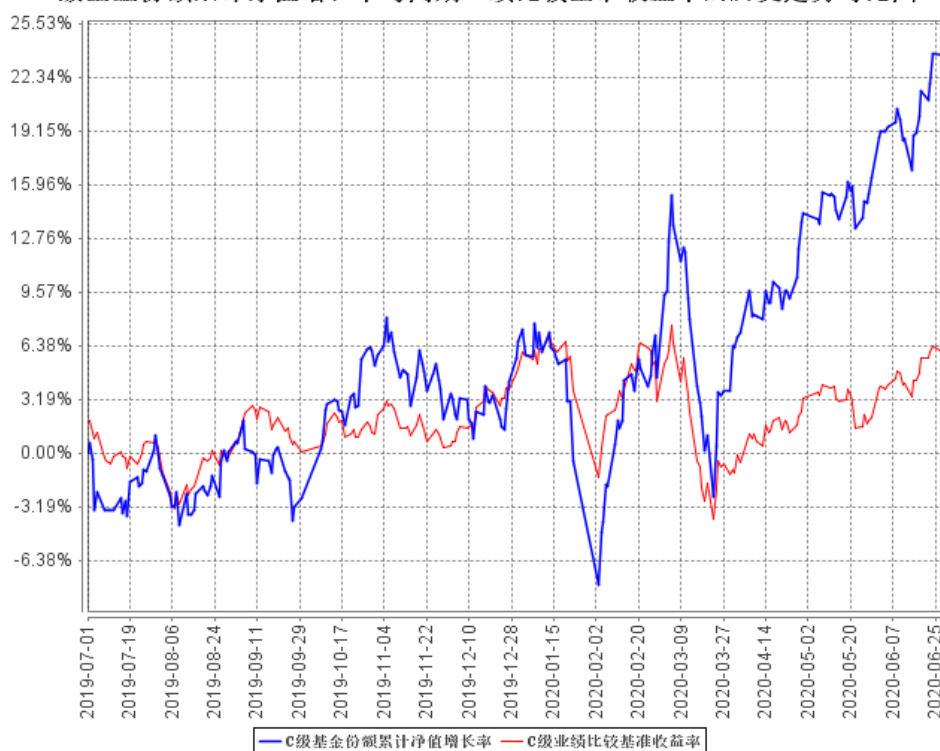
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.66%	0.89%	4.60%	0.58%	2.06%	0.31%
过去三个月	16.62%	0.88%	7.91%	0.58%	8.71%	0.30%
过去六个月	16.41%	1.56%	1.68%	0.98%	14.73%	0.58%
自基金合同生效起至今	24.10%	1.32%	6.82%	0.79%	17.28%	0.53%

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：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称为“宝盈新价值混合 C”。

§ 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、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈盈顺纯债债券、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈辉纯债三十九只基金，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、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、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、宝盈品牌消费	2017 年 12 月 15 日	-	12 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，先后担任研究员、研究部副总监

	股票型证券投资基金、宝盈龙头优选股票型证券投资基金基金经理；权益投资部总经理				理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
杨思亮	本基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 4 月 9 日	-	9 年	杨思亮先生，中央财经大学国际金融硕士。2011 年 6 月至 2014 年 4 月在大成基金管理有限公司研究部担任研究员；2014 年 4 月至 2015 年 4 月在大成创新资本管理有限公司专户投资部担任投资经理助理；2015 年 4 月加入宝盈基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、专户投资部投资经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
侯嘉敏	本基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2019 年 7 月 30 日	-	5 年	侯嘉敏先生，美国南加州大学金融工程硕士，具有 4 年证券从业经历。2015 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理均非首任基金经理，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 2020 年 6 月 30 日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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

新冠疫情的爆发，对投资而言，无异于一场严格的风控测试，也让我们对组合风险管理有了更为深刻的认知。当我们真正从研究生意的角度出发去看待权益投资时，我们不再只关注标的的盈利状况，更开始关注生意的本质，关注标的在不同情境下的发展状况；我们对价值投资的理解，也从之前各类标的的低买高卖，转向寻找符合时代发展趋势、商业模式易实现价值积累、企业文化积极进取的标的，期望以合理价格买入，长期持有，伴随企业共同成长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈新价值混合 A 基金份额净值为 1.878 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.86%；截至本报告期末宝盈新价值混合 C 基金份额净值为 1.859 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.41%；同期业绩比较基准收益率为 1.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球化的发展模式遭遇挑战，中国经济发展模式也面临转型，叠加新冠疫情的爆发，使得各国推出了宽松的货币政策及积极的财政政策应对风险；在诸多不确定性面前，资本市场结构持续分化，不过，资本市场的快变量与实体经济的慢变量之间能否自洽，风险与收益如何平衡，仍是我们后续持续关注焦点。

我们在上半年的疫情中对投资有了新的理解，后续对投资组合的构建将会建立在公司层面上，建立在对时代趋势、商业模式、企业文化等层面的理解与学习上，放弃对宏观背景、行业轮动、风格切换等的关注，期望以合理价格买入优质标的，长期持有，积累价值。

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（协管）领导、督察长及研究部、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、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	43,405,494.06	57,556,935.03
结算备付金		784,865.95	-
存出保证金		312,240.18	123,792.79
交易性金融资产	6.4.7.2	628,461,018.45	850,219,320.62
其中：股票投资		628,461,018.45	850,219,320.62
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,332.15	11,373.44
应收股利		-	-
应收申购款		693,239.18	364,082.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		673,661,189.97	908,275,504.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
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		4,304.83	469,036.06
应付赎回款		8,734,269.44	8,564,731.85
应付管理人报酬		825,031.24	1,138,060.22
应付托管费		137,505.23	189,676.68
应付销售服务费		3,764.52	2,719.58
应付交易费用	6.4.7.7	931,481.40	234,519.74
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	220,797.82	205,199.07
负债合计		10,857,154.48	10,803,943.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	352,989,201.80	558,612,060.89
未分配利润	6.4.7.10	309,814,833.69	338,859,500.28
所有者权益合计		662,804,035.49	897,471,561.17
负债和所有者权益总计		673,661,189.97	908,275,504.37

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，宝盈新价值混合 A 基金份额净值 1.878 元，基金份额总额 350,355,270.97 份；宝盈新价值混合 C 基金份额净值 1.859 元，基金份额总额 2,633,930.83 份。宝盈新价值混合份额总额合计为 352,989,201.80 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		101,728,093.10	335,983,364.95
1. 利息收入		148,795.19	183,761.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	148,795.19	183,761.93
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		197,053,497.30	51,556,896.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	190,486,087.94	39,055,875.80
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	6,567,409.36	12,501,020.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-96,308,900.24	283,961,631.25
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	834,700.85	281,075.60
减：二、费用		8,781,177.30	8,934,075.48

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,402,513.42	6,833,957.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	900,418.92	1,138,992.90
3. 销售服务费		29,905.68	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,326,640.63	858,537.45
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	121,698.65	102,587.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		92,946,915.80	327,049,289.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,946,915.80	327,049,289.47

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	558,612,060.89	338,859,500.28	897,471,561.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	92,946,915.80	92,946,915.80
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）	-205,622,859.09	-121,991,582.39	-327,614,441.48
其中：1. 基金申购款	97,153,615.00	65,157,224.35	162,310,839.35
2. 基金赎回款	-302,776,474.09	-187,148,806.74	-489,925,280.83
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）	352,989,201.80	309,814,833.69	662,804,035.49

项目	上年度可比期间 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)	731,862,307.19	1,132,711.09	732,995,018.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	327,049,289.47	327,049,289.47
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)	-45,911,717.72	-17,343,419.13	-63,255,136.85
其中：1. 基金申购款	67,257,900.26	23,328,738.58	90,586,638.84
2. 基金赎回款	-113,169,617.98	-40,672,157.71	-153,841,775.69
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)	685,950,589.47	310,838,581.43	996,789,170.90

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	_____ 张献锦	_____ 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

宝盈新价值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”)证监基金字[2014]213 号《关于核准宝盈新价值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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 433,819,339.69 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道验字(2014)第 071 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 4 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 433,920,136.81 份基金份额,其中认购资金利息折合

100,797.12 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据基金管理人宝盈基金管理有限公司 2019 年 6 月 28 日《宝盈基金管理有限公司关于宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同部分条款的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2019 年 7 月 1 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为宝盈新价值混合 A(原基金份额自动转入宝盈新价值混合 A)；在投资者申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为宝盈新价值混合 C。宝盈新价值混合 A 和宝盈新价值混合 C 分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新价值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核准上市的股票)、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、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。基金的投资组合为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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<年度报告和中期报告>》、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》、《宝盈新价值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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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**

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	43,405,494.06
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：	43,405,494.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	533,436,005.93	628,461,018.45	95,025,012.52
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
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	533,436,005.93	628,461,018.45	95,025,012.52
----	----------------	----------------	---------------

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,838.45
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	353.20
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	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	140.50
合计	4,332.15

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	931,481.40
银行间市场应付交易费用	—
合计	931,481.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付赎回费	16,371.68
应付证券出借违约金	-
预提费用	204,426.14
合计	220,797.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈新价值混合 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	556,215,268.82	556,215,268.82
本期申购	77,548,624.43	77,548,624.43
本期赎回（以“-”号填列）	-283,408,622.28	-283,408,622.28
本期末	350,355,270.97	350,355,270.97

金额单位：人民币元

宝盈新价值混合 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,396,792.07	2,396,792.07
本期申购	19,604,990.57	19,604,990.57
本期赎回（以“-”号填列）	-19,367,851.81	-19,367,851.81
本期末	2,633,930.83	2,633,930.83

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈新价值混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	120,364,119.16	217,065,160.16	337,429,279.32
本期利润	187,190,978.47	-93,989,326.93	93,201,651.54
本期基金份额交易产生的变动数	-79,181,171.10	-43,897,976.99	-123,079,148.09
其中：基金申购款	29,625,943.59	22,484,285.74	52,110,229.33
基金赎回款	-108,807,114.69	-66,382,262.73	-175,189,377.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	228,373,926.53	79,177,856.24	307,551,782.77

单位：人民币元

宝盈新价值混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	516,917.91	913,303.05	1,430,220.96
本期利润	2,064,837.57	-2,319,573.31	-254,735.74
本期基金份额交易产生的变动数	-892,367.69	1,979,933.39	1,087,565.70
其中：基金申购款	7,111,532.45	5,935,462.57	13,046,995.02
基金赎回款	-8,003,900.14	-3,955,529.18	-11,959,429.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,689,387.79	573,663.13	2,263,050.92

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	140,855.66
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	6,574.65
其他	1,364.88
合计	148,795.19

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	864,809,964.71
减：卖出股票成本总额	674,323,876.77
买卖股票差价收入	190,486,087.94

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,567,409.36
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,567,409.36

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-96,308,900.24
——股票投资	-96,308,900.24
——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 增值税	-
合计	-96,308,900.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	577,295.65
基金转换费收入	257,405.20
合计	834,700.85

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	2,326,640.63
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,326,640.63

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	7,672.51
债券帐户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	121,698.65

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无需要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（以下简称“宝盈基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,402,513.42	6,833,957.45
其中：支付销售机构的客户维护费	2,365,102.68	3,121,330.96

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 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	900,418.92	1,138,992.90

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

6.4.10.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C	合计
宝盈基金公司	-	1,179.54	1,179.54
合计	-	1,179.54	1,179.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C	合计
宝盈基金公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日宝盈新价值混合 C 的基金资产净值 0.80% 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 = 前一日宝盈新价值混合 C 的基金资产净值 × 0.80% / 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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C
报告期初持有的基金份额	5,658,743.63	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,658,743.63	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.62%	-
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C
报告期初持有的基金份额	5,658,743.63	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	5,658,743.63	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.82%	—

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
招商银行	43,405,494.06	140,855.66	58,099,790.69	179,535.87

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	—
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	—
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2021 年 1 月 4 日	科创板新股锁定期	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	—
688600	皖仪科技	2020 年 6 月	2020 年 7 月	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	—

		月 23 日	月 3 日	市						
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688266	泽璟制药	2020 年 1 月 16 日	2020 年 7 月 23 日	科创板新股锁定期	33.76	81.66	42,647	1,439,762.72	3,482,554.02	-
688588	凌志软件	2020 年 4 月 28 日	2020 年 11 月 11 日	科创板新股锁定期	11.49	33.33	17,277	198,512.73	575,842.41	-
688516	奥特维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	科创板新股锁定期	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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人招商银行，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 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2019 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 2020 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公司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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	43,405,494.06	-	-	-	43,405,494.06

结算备付金	784,865.95	-	-	-	784,865.95
存出保证金	312,240.18	-	-	-	312,240.18
交易性金融资产	-	-	-	628,461,018.45	628,461,018.45
应收利息	-	-	-	4,332.15	4,332.15
应收申购款	-	-	-	693,239.18	693,239.18
资产总计	44,502,600.19	-	-	629,158,589.78	673,661,189.97
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,304.83	4,304.83
应付赎回款	-	-	-	8,734,269.44	8,734,269.44
应付管理人报酬	-	-	-	825,031.24	825,031.24
应付托管费	-	-	-	137,505.23	137,505.23
应付销售服务费	-	-	-	3,764.52	3,764.52
应付交易费用	-	-	-	931,481.40	931,481.40
其他负债	-	-	-	220,797.82	220,797.82
负债总计	-	-	-	10,857,154.48	10,857,154.48
利率敏感度缺口	44,502,600.19	-	-	618,301,435.30	662,804,035.49
上年度末 2019 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	57,556,935.03	-	-	-	57,556,935.03
存出保证金	123,792.79	-	-	-	123,792.79
交易性金融资产	-	-	-	850,219,320.62	850,219,320.62
应收利息	-	-	-	11,373.44	11,373.44
应收申购款	-	-	-	364,082.49	364,082.49
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	57,680,727.82	-	-	850,594,776.55	908,275,504.37
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	469,036.06	469,036.06
应付赎回款	-	-	-	8,564,731.85	8,564,731.85
应付管理人报酬	-	-	-	1,138,060.22	1,138,060.22
应付托管费	-	-	-	189,676.68	189,676.68
应付销售服务费	-	-	-	2,719.58	2,719.58
应付交易费用	-	-	-	234,519.74	234,519.74
其他负债	-	-	-	205,199.07	205,199.07
负债总计	-	-	-	10,803,943.20	10,803,943.20
利率敏感度缺口	57,680,727.82	-	-	839,790,833.35	897,471,561.17

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。

6.4.13.4.2 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%，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。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	628,461,018.45	94.82	850,219,320.62	94.73
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	628,461,018.45	94.82	850,219,320.62	94.73

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	27,678,419.38	32,192,909.06
	沪深 300 指数下降 5%	-27,678,419.38	-32,192,909.06

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	628,461,018.45	93.29
	其中：股票	628,461,018.45	93.29
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	44,190,360.01	6.56
8	其他各项资产	1,009,811.51	0.15
9	合计	673,661,189.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	86,243,000.00	13.01
C	制造业	318,040,783.83	47.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	938,065.18	0.14
J	金融业	98,118,000.00	14.80

K	房地产业	66,950,000.00	10.10
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	58,158,403.12	8.77
S	综合	-	-
	合计	628,461,018.45	94.82

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	600519	贵州茅台	43,500	63,635,280.00	9.60
2	601225	陕西煤业	8,300,000	59,843,000.00	9.03
3	601128	常熟银行	7,000,000	52,570,000.00	7.93
4	601012	隆基股份	1,200,000	48,876,000.00	7.37
5	000858	五粮液	280,000	47,913,600.00	7.23
6	600690	海尔智家	2,400,081	42,481,433.70	6.41
7	000002	万科 A	1,600,000	41,824,000.00	6.31
8	000423	东阿阿胶	1,000,000	35,810,000.00	5.40
9	002078	太阳纸业	3,500,000	33,320,000.00	5.03
10	300788	中信出版	680,072	32,772,669.68	4.94
11	601899	紫金矿业	6,000,000	26,400,000.00	3.98
12	002142	宁波银行	1,000,000	26,270,000.00	3.96
13	603096	新经典	430,048	25,385,733.44	3.83
14	600048	保利地产	1,700,000	25,126,000.00	3.79
15	600066	宇通客车	2,000,000	24,400,000.00	3.68
16	601318	中国平安	270,000	19,278,000.00	2.91
17	000651	格力电器	300,000	16,971,000.00	2.56
18	688266	泽璟制药	42,647	3,482,554.02	0.53
19	688588	凌志软件	17,277	575,842.41	0.09
20	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.06
21	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.04
22	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.02
23	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
24	688078	龙软科技	2,811	115,813.20	0.02

25	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
26	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
27	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
28	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
29	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
30	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
31	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
32	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
33	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
34	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
35	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
36	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
37	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
38	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	000596	古井贡酒	53,589,494.95	5.97
2	601128	常熟银行	47,740,523.44	5.32
3	002078	太阳纸业	40,348,347.54	4.50
4	600690	海尔智家	37,850,419.36	4.22
5	000858	五粮液	35,144,454.29	3.92
6	601012	隆基股份	32,481,406.00	3.62
7	000423	东阿阿胶	31,423,199.25	3.50
8	300788	中信出版	31,395,826.39	3.50
9	601166	兴业银行	28,554,482.00	3.18
10	002142	宁波银行	28,477,670.12	3.17
11	600066	宇通客车	26,001,328.75	2.90
12	601899	紫金矿业	24,395,204.00	2.72
13	603096	新经典	23,028,580.95	2.57
14	000002	万科 A	17,057,730.00	1.90
15	000651	格力电器	16,323,854.00	1.82
16	601098	中南传媒	12,714,637.00	1.42
17	603686	龙马环卫	7,942,556.00	0.88

18	002714	牧原股份	7,699,816.00	0.86
19	600966	博汇纸业	6,969,580.14	0.78
20	000001	平安银行	6,735,935.00	0.75

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000876	新希望	125,079,830.95	13.94
2	002714	牧原股份	117,786,456.02	13.12
3	600872	中炬高新	99,630,095.02	11.10
4	000961	中南建设	70,457,405.74	7.85
5	000596	古井贡酒	60,474,599.74	6.74
6	300498	温氏股份	52,605,058.96	5.86
7	600340	华夏幸福	43,905,424.41	4.89
8	000333	美的集团	39,664,253.36	4.42
9	600519	贵州茅台	35,451,799.11	3.95
10	601318	中国平安	32,432,489.41	3.61
11	601166	兴业银行	28,639,621.00	3.19
12	001979	招商蛇口	27,832,313.13	3.10
13	601098	中南传媒	12,771,307.44	1.42
14	601225	陕西煤业	12,303,232.00	1.37
15	603686	龙马环卫	11,161,744.40	1.24
16	600048	保利地产	9,751,590.73	1.09
17	600966	博汇纸业	9,498,407.00	1.06
18	002078	太阳纸业	8,614,196.00	0.96
19	000001	平安银行	6,612,161.00	0.74
20	000002	万科 A	5,812,351.60	0.65

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	548,874,474.84
卖出股票收入（成交）总额	864,809,964.71

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

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	312,240.18
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	4,332.15
5	应收申购款	693,239.18
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,009,811.51

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股票。

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

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
宝盈新价值混合 A	19,359	18,097.80	18,418,445.68	5.26%	331,936,825.29	94.74%
宝盈新价值混合 C	1,313	2,006.04	—	—	2,633,930.83	100.00%
合计	20,672	17,075.72	18,418,445.68	5.22%	334,570,756.12	94.78%

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	宝盈新价值混合 A	2,867.80	0.0008%
	宝盈新价值混合 C	64.90	0.0025%
	合计	2,932.70	0.0008%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈新价值混合 A	0
	宝盈新价值混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈新价值混合 A	0
	宝盈新价值混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈新价值混合 A	宝盈新价值混合 C
基金合同生效日（2014 年 4 月 10 日）基金份额总额	433,920,136.81	—
本报告期期初基金份额总额	556,215,268.82	2,396,792.07
本报告期基金总申购份额	77,548,624.43	19,604,990.57
减：本报告期基金总赎回份额	283,408,622.28	19,367,851.81
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	350,355,270.97	2,633,930.83

§ 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

报告期内基金管理人、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	
海通证券	2	730,997,786.77	52.20%	666,177.63	52.20%	—
中信证券	1	346,860,910.27	24.77%	316,094.71	24.77%	—
申万宏源证券	2	193,537,638.09	13.82%	176,369.72	13.82%	—
方正证券	2	105,394,500.45	7.53%	96,049.39	7.53%	—
光大证券	2	23,501,974.20	1.68%	21,417.65	1.68%	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
东方财富证券	2	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中银国际证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	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，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：

(1) 租用交易单元情况

本基金本报告期内无租用交易单元情况。

(2) 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

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新增中国人寿保险股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 24 日
2	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2020 年第 2 次)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 22 日
3	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书 (2020 年第 2 次)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 22 日
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 17 日
5	宝盈基金管理有限公司关于旗下七只基金 (C 类) 新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 11 日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 3 日
7	宝盈基金管理有限公司关于增加安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	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 30 日
8	宝盈基金管理有限公司关于增加国元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	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 29 日
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券华南股份有限公司相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日

10	宝盈基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 24 日
11	宝盈基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华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	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
12	宝盈基金管理有限公司旗下 34 只基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 4 月 22 日
13	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
14	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 11 日
15	宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 4 月 11 日
16	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2020 年第 1 次)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 10 日
17	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书 (2020 年第 1 次)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 10 日
18	宝盈基金管理有限公司关于新增泛华普益基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 10 日
19	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 9 日
20	宝盈基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 31 日
21	宝盈基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 25 日
22	宝盈基金管理有限公司关于新增大连网金基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2020 年 3 月 24 日

	关费率优惠活动的公告	网站	
23	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 17 日
24	宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 1 月 17 日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 8 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

本基金本报告期内不存在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新价值灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

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 楼

基金托管人办公地址：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别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

2020 年 8 月 31 日