

宝盈鸿盛债券型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 2 月 26 日（合同生效日）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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19

6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.11 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52

§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈鸿盛债券型证券投资基金	
基金简称	宝盈鸿盛债券	
基金主代码	008511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 26 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	864,985,153.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈鸿盛债券 A	宝盈鸿盛债券 C
下属分级基金的交易代码:	008511	008512
报告期末下属分级基金的份额总额	854,935,581.87 份	10,049,571.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险和保持基金资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期增值。
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各类债券资产配置比例。同时，本基金注重微观层面的投资研究及策略，尤其是在信用债券领域，具体投资标的的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。 本基金充分发挥基金管理人在信用债市场所积累的长期经验，灵活配置于产业类债券、地产类债券、城投类债券，利用自主开发的信用分析体系及数据、经验积累，结合行业研究、公司研究进行自下而上选券。 本基金采用的投资策略主要为（包括但不限于）：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。 （1）债券资产配置策略。组合杠杆率及各类债券资产配置比例决策侧重以下几个方面的研究（包括但不限于）： 1) 宏观经济变量（包括但不限于宏观增长及价格类数据、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； 2) 利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究； 3) 宏观流动性环境及货币市场流动性研究； 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。 （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。 （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。

（4）流动性管理策略。本策略侧重于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可质押券。

2、可转换债券（含可交换债券）投资策略

基于行业研究、公司研究、可转债估值模型分析，本基金在一、二级市场投资可转换债券（含可交换债券）。主要有以下几类策略（包括但不限于）：

（1）行业配置策略。本基金以宏观经济走势、经济周期特征和阶段性市场投资主题的研究为基础，综合考量宏观调控目标、产业结构调整因素等，精选具有良好成长潜力和受益于政策扶持具有优良成长环境的公司发行的可转换债券（含可交换债券）进行投资布局。同时，结合经济和市场阶段性特征，动态调整不同行业的可转换债券（含可交换债券）比例。

（2）个股精选策略。本基金将对所有可转换债券（含可交换债券）所对应的股票进行基本面分析，具体采用定量分析（如 P/E、P/B、PEG 等）和定性分析（公司治理结构、行业地位、竞争优势、创新能力等）相结合的方式，精选具有良好成长潜力且估值合理的标的。

（3）转股策略。在转股期内，当本基金所持可转换债券（含可交换债券）市场价格显著低于转换价值时，即转股溢价为负时，本基金将实现转股并卖出股票实现收益；当可转换债券（含可交换债券）流动性不足以满足投资组合的需要时，本基金将通过转股保障基金财产安全。

（4）条款博弈策略。可转债通常附有赎回、回售、转股价修正等条款，其中赎回条款目的是促使可转债投资者进行转股，回售条款和转股价修正条款是对可转债投资者的保护性条款。可转债的回售条款、赎回条款和转股价修正条款通常以条款博弈的方式参与到可转债的定价中，越临近触发这三种条款，其对可转债价格的影响越大，真正触发后博弈的结果，亦将影响可转债的价格。本基金将根据可转债上市公司当前经营状况和未来发展策略，以及公司的财务状况和融资需求，对可转债的赎回、回售、转股价修正等条款进行分析，把握投资机会。

3、资产支持证券投资策略

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、收益率利差分析和公司基本面分析、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，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

4、国债期货投资策略

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，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张磊	许俊
	联系电话	0755-83276688	010-66594319
	电子邮箱	zhangl@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		马永红	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

基金级别	宝盈鸿盛债券 A	宝盈鸿盛债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 2 月 26 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 2 月 26 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,125,269.49	105,399.68
本期利润	-2,226,169.19	-48,805.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0024	-0.0029
本期加权平均净值利润率	-0.24%	-0.29%
本期基金份额净值增长率	-0.29%	-0.43%
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	-2,495,882.36	-42,955.36
期末可供分配基金份额利润	-0.0029	-0.0043
期末基金资产净值	852,439,699.51	10,006,616.56
期末基金份额净值	0.9971	0.9957
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	-0.29%	-0.43%

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

宝盈鸿盛债券 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	-0.64%	0.11%	-0.77%	0.12%	0.13%	-0.01%
过去三个月	-0.28%	0.09%	-0.31%	0.11%	0.03%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-0.29%	0.08%	0.63%	0.11%	-0.92%	-0.03%

宝盈鸿盛债券 C

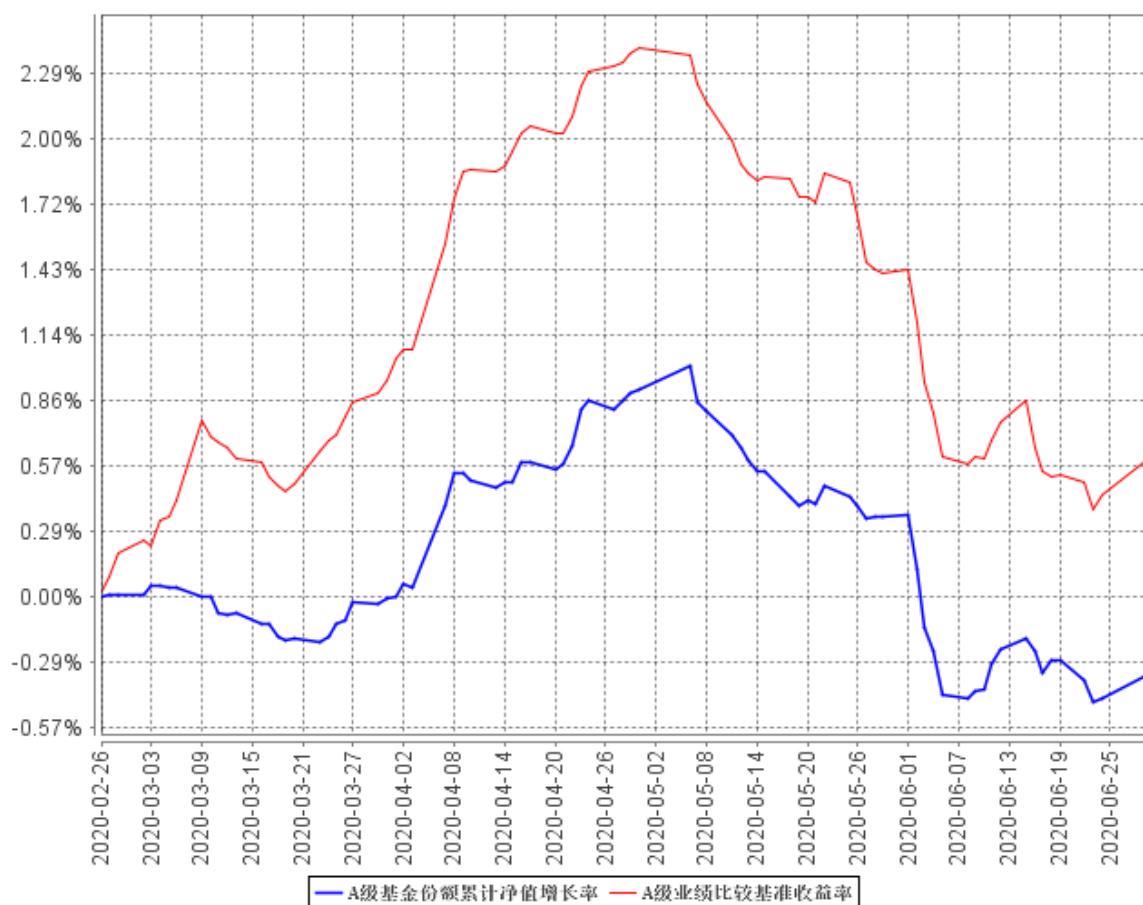
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.67%	0.11%	-0.77%	0.12%	0.10%	-0.01%
过去三个月	-0.39%	0.09%	-0.31%	0.11%	-0.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-0.43%	0.08%	0.63%	0.11%	-1.06%	-0.03%

注：1、本基金合同于 2020 年 2 月 26 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

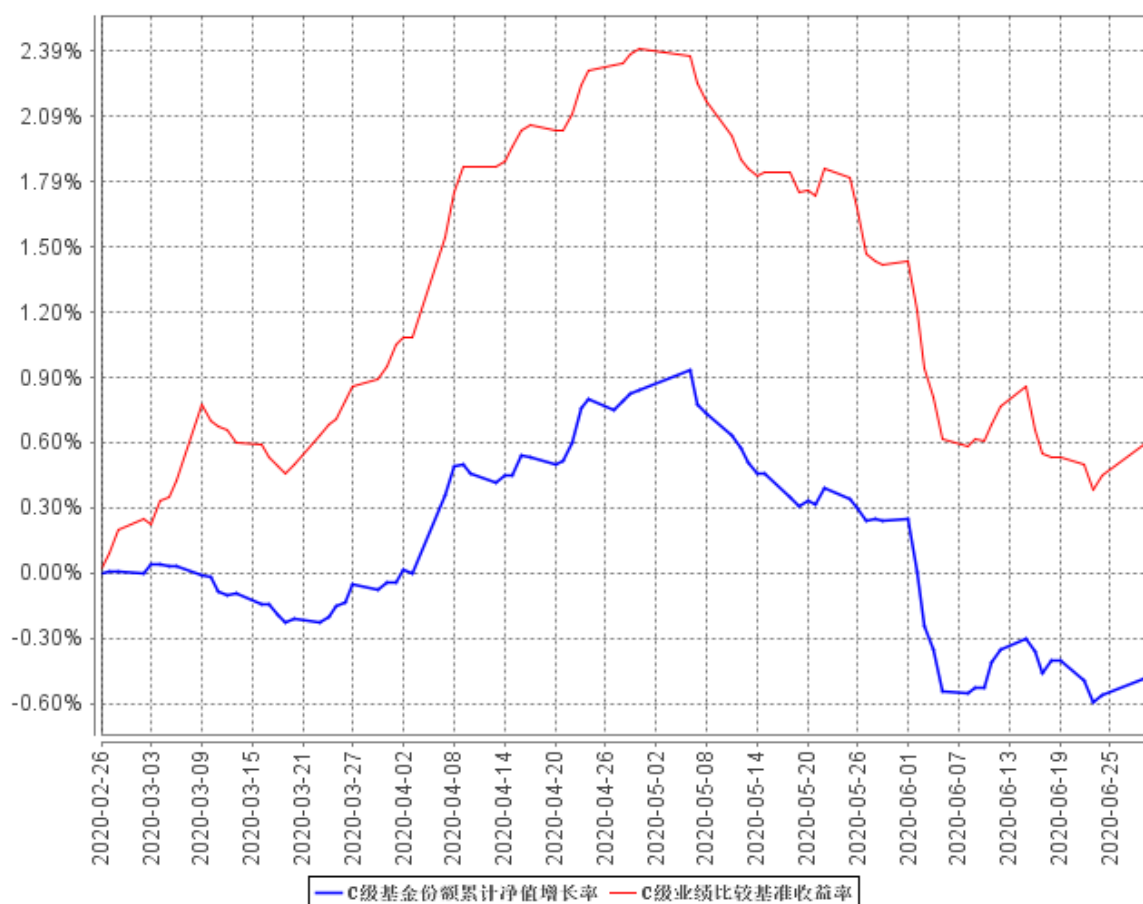
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

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、本基金合同于 2020 年 2 月 26 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、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、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		
邓栋	本基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈融源可转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、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券	2020年2月26日	-	10 年	邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008 年 3 月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自 2010 年 1 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

	投资基金、宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理；固定收益部总经理				
李宇昂	本基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金的基金经理	2020年3月13日	-	5 年	李宇昂先生，清华大学工学硕士。2015 年 7 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司固定收益部任研究员，从事宏观和信用债研究，2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任固定收益研究员、投资经理、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、邓栋为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、李宇昂非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期

内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金遵守基金合同约定，以中高等级中短期限信用债为主要底仓投资品种，并灵活参与转债投资和利率债的交易，合理安排久期和杠杆操作。报告期内债券市场大幅波动，1-4月债市大幅下行，但5月起信用债出现了较大幅度回调，几乎所有期限和等级债券均出现80-100bp的估值调整。组合3月底建仓后，4月下旬开始受到债市调整影响净值出现回撤，5月起随债市调整逐步降低组合的杠杆和久期，并适度增加转债仓位，以规避债市调整带来的组合净值回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈鸿盛债券 A 基金份额净值为 0.9971 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.29%；截至本报告期末宝盈鸿盛债券 C 基金份额净值为 0.9957 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.43%；同期业绩比较基准收益率为 0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年受疫情影响宏观经济触底回升。一季度经济受疫情影响触底，从 4 月起经济开始复苏，地产投资保持较高的景气度，制造业、消费等均逐步改善。上半年 CPI、PPI 均保持相对平稳水平。货币政策保持灵活偏松，央行公开市场降息、降低存款准备金利率和降准等多项政策并举，资金利率维持平稳偏低水平，4 月后资金利率一度降至历史最低水平附近。从市场表现看，上半年久期贡献最高，金融债指数强于中票，短融指数收益最低。股票市场结构性行情，盈利能力稳定的白酒、电子、养殖后周期、医药等行业仍有不错表现。

展望 2020 年下半年，我们认为主线是疫情后的经济复苏，权益的机会大于债券。目前国内经济复苏的方向已经基本确认，但幅度和持续时间有待继续观察，全球也逐渐步入复苏的过程中。国内货币政策从 4 月末开始已经明确转向，下半年基调可能是货币政策正常化。通胀压力不大，但 PPI 中枢预计有所抬升。下半年美国大选和中美的关系是重要的不确定因素，可能影响权益和债市的节奏。

目前来看，债券市场存在超跌反弹的机会，但短期内空间可能不大，中期需要等经济的下行

信号。信用债绝对收益不错，中等资质高静态中短债在 2020 年下半年仍能取得不错的稳定收益。2020 年信用事件依然高发，且机构情绪较为脆弱，低等级信用风险仍需保持警惕。转债在当前时点的估值中性，机会主要来自正股的带动和个券的深度挖掘。

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”）在对宝盈鸿盛债券型证券投资基金（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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：宝盈鸿盛债券型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	2,230,925.67
结算备付金		2,344,221.40
存出保证金		73,378.82
交易性金融资产	6.4.7.2	1,129,722,875.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,119,748,875.00
资产支持证券投资		9,974,000.00
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		7,998,027.44
应收利息	6.4.7.5	15,909,720.04
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,158,279,148.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		280,999,441.00
应付证券清算款		5,010,273.97
应付赎回款		9,022,083.18
应付管理人报酬		438,316.03
应付托管费		109,578.99
应付销售服务费		4,262.46
应付交易费用	6.4.7.7	19,764.60
应交税费		113,205.46

应付利息		75,945.32
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	39,961.29
负债合计		295,832,832.30
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	864,985,153.79
未分配利润	6.4.7.10	-2,538,837.72
所有者权益合计		862,446,316.07
负债和所有者权益总计		1,158,279,148.37

注：1、报告截止 2020 年 6 月 30 日，宝盈鸿盛债券 A 基金份额净值 0.9971 元，基金份额总额 854,935,581.87 份；宝盈鸿盛债券 C 基金份额净值 0.9957 元，基金份额总额 10,049,571.92 份；宝盈鸿盛债券份额总额合计为 864,985,153.79 份。

2、本基金合同于 2020 年 2 月 26 日生效，无上年度可比数据。

6.2 利润表

会计主体：宝盈鸿盛债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同 生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,343,195.66
1.利息收入		13,652,533.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	552,835.46
债券利息收入		12,100,003.08
资产支持证券利息收入		470,275.31
买入返售金融资产收入		529,420.03
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,837,723.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	42,076.07
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,967,138.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	87,338.09
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,505,644.07
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	34,029.69

减：二、费用		3,618,170.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,964,361.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	491,090.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,859.91
4. 交易费用	6.4.7.19	32,320.28
5. 利息支出		1,017,443.04
其中：卖出回购金融资产支出		1,017,443.04
6. 税金及附加		41,627.31
7. 其他费用	6.4.7.20	48,468.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,274,974.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,274,974.90

注：本基金合同于 2020 年 2 月 26 日生效，无上年度可比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈鸿盛债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)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）	989,851,895.92	-	989,851,895.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,274,974.90	-2,274,974.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-124,866,742.13	-263,862.82	-125,130,604.95
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-124,866,742.13	-263,862.82	-125,130,604.95
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）	864,985,153.79	-2,538,837.72	862,446,316.07

注：本基金合同于 2020 年 2 月 26 日生效，无上年度可比数据。

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：

<u>杨凯</u>	<u>张献锦</u>	<u>何瑜</u>
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

宝盈鸿盛债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 2438 号《关于准予宝盈鸿盛债券型证券投资基金注册的批复》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《宝盈鸿盛债券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 989,045,196.25 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0079 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《宝盈鸿盛债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 989,851,895.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 806,699.67 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈鸿盛债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、次级债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券等）、股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、国债期货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。本基金不直接从二级市场买入股票。本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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。本基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%。

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》、《宝盈鸿盛债券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 2 月 26 日(合同生效日)起至 2020 年 6 月 30 日止的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 26 日(合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过

大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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	2,230,925.67
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：	2,230,925.67

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		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	367,035,070.06	361,163,875.00	-5,871,195.06
	银行间市场	762,169,080.79	758,585,000.00	-3,584,080.79
	合计	1,129,204,150.85	1,119,748,875.00	-9,455,275.85
资产支持证券		10,024,368.22	9,974,000.00	-50,368.22
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,139,228,519.07	1,129,722,875.00	-9,505,644.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	1,869.07
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	1,054.90
应收债券利息	15,674,258.96
应收资产支持证券利息	232,504.11
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	33.00
合计	15,909,720.04

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	3,571.02
银行间市场应付交易费用	16,193.58
合计	19,764.60

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	3,380.97
应付证券出借违约金	-
预提费用	36,580.32
合计	39,961.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈鸿盛债券 A		
项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	971,291,220.34	971,291,220.34
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-116,355,638.47	-116,355,638.47
本期末	854,935,581.87	854,935,581.87

金额单位：人民币元

宝盈鸿盛债券 C		
项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	18,560,675.58	18,560,675.58
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-8,511,103.66	-8,511,103.66
本期末	10,049,571.92	10,049,571.92

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈鸿盛债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,125,269.49	-9,351,438.68	-2,226,169.19
本期基金份额交易产生的变动数	-680,921.74	411,208.57	-269,713.17
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-680,921.74	411,208.57	-269,713.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,444,347.75	-8,940,230.11	-2,495,882.36

单位：人民币元

宝盈鸿盛债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	105,399.68	-154,205.39	-48,805.71
本期基金份额交易产生的变动数	-43,381.41	49,231.76	5,850.35
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-43,381.41	49,231.76	5,850.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,018.27	-104,973.63	-42,955.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	211,973.05
定期存款利息收入	329,069.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,531.20

其他	261.77
合计	552,835.46

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月26日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
卖出股票成交总额	7,812,991.39
减：卖出股票成本总额	7,770,915.32
买卖股票差价收入	42,076.07

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月26日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	393,031,105.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	389,615,585.29
减：应收利息总额	6,382,658.58
买卖债券差价收入	-2,967,138.00

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月26日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	40,924,054.80
减：卖出资产支持证券成本总额	40,097,472.87
减：应收利息总额	739,243.84
资产支持证券投资收益	87,338.09

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

无。

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 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-9,505,644.07
——股票投资	-
——债券投资	-9,455,275.85
——资产支持证券投资	-50,368.22
——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	-9,505,644.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	34,029.69
合计	34,029.69

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	18,545.28
银行间市场交易费用	13,775.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	32,320.28
----	-----------

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	36,580.32
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行汇划费用	11,488.03
合计	48,468.35

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司(“宝盈基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,964,361.35
其中：支付销售机构的客户维护费	1,469,973.93

注：1、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 0.60% 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×0.60%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2020 年 2 月 26 日，无上年度可比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	491,090.32

注：1、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 0.15% 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×0.15%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2020 年 2 月 26 日，无上年度可比数据。

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 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈鸿盛债券 A	宝盈鸿盛债券 C	合计
宝盈基金公司	-	358.26	358.26
中国银行	-	20,397.35	20,397.35
合计	-	20,755.61	20,755.61

注：1、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 0.40% 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 × 0.40% / 当年天数。

2、本基金合同生效日为 2020 年 2 月 26 日，无上年度可比数据。

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

单位：人民币元

本期 2020 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	30,003,386.30	-	-	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2020 年 2 月 26 日，无上年可比期间数据。

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

无。

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

无。

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 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,230,925.67	211,973.05

注：1、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。

2、本基金合同生效日为 2020 年 2 月 26 日，无上年度对比数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

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

无。

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的余额为 105,999,441.00 元。正回购交易中作为抵押的债券如下：

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
012000230	20 永煤 SCP002	2020 年 7 月 6 日	100.18	80,000	8,014,400.00
011902355	19 云城投 SCP007	2020 年 7 月 6 日	100.62	300,000	30,186,000.00
101901047	19 北汽新能 MTN002	2020 年 7 月 6 日	100.63	300,000	30,189,000.00
011902522	19 永煤 SCP015	2020 年 7 月 6 日	100.45	400,000	40,180,000.00
101901131	19 北汽新能 MTN003	2020 年 7 月 6 日	100.68	90,000	9,061,200.00

合计				1,170,000	117,630,600.00
----	--	--	--	-----------	----------------

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，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 175,000,000.00 元。

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

本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种，本基金的预期风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金，高于货币市场基金。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“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	89,925,000.00
A-1 以下	-
未评级	260,565,000.00
合计	350,490,000.00

注：未评级部分为国债、短期融资券，债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 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 2020 年 6 月 30 日
AAA	472,250,446.20
AAA 以下	208,374,428.80
未评级	88,634,000.00
合计	769,258,875.00

注：未评级部分为国债、短期融资券，债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	9,974,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	9,974,000.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构。

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。

本基金所承担的其他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，因此账面余额约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》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该比例限制)。

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 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	2,230,925.67	-	-	-	2,230,925.67
结算备付金	2,344,221.40	-	-	-	2,344,221.40
存出保证金	73,378.82	-	-	-	73,378.82
交易性金融资产	350,490,000.00	-	779,232,875.00	-	1,129,722,875.00
应收证券清算款	-	-	-	7,998,027.44	7,998,027.44
应收利息	-	-	-	15,909,720.04	15,909,720.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	355,138,525.89	-	779,232,875.00	23,907,747.48	1,158,279,148.37

负债					
卖出回购金融资产款	280,999,441.00	-	-	-	280,999,441.00
应付证券清算款	-	-	-	5,010,273.97	5,010,273.97
应付赎回款	-	-	-	9,022,083.18	9,022,083.18
应付管理人报酬	-	-	-	438,316.03	438,316.03
应付托管费	-	-	-	109,578.99	109,578.99
应付销售服务费	-	-	-	4,262.46	4,262.46
应付交易费用	-	-	-	19,764.60	19,764.60
应付利息	-	-	-	75,945.32	75,945.32
应交税费	-	-	-	113,205.46	113,205.46
其他负债	-	-	-	39,961.29	39,961.29
负债总计	280,999,441.00	-	-	14,833,391.30	295,832,832.30
利率敏感度缺口	74,139,084.89	-	779,232,875.00	9,074,356.18	862,446,316.07

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

假设	除市场利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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	11,113,104.15	-
	市场利率上升 25 个基点	-10,831,828.26	

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，通过对宏观经济形势与市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极大类资产配置策略；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。

本基金投资组合不直接从二级市场买入股票；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。

6.4.14 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,129,722,875.00	97.53
	其中：债券	1,119,748,875.00	96.67
	资产支持证券	9,974,000.00	0.86
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	4,575,147.07	0.39
8	其他各项资产	23,981,126.30	2.07
9	合计	1,158,279,148.37	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603636	南威软件	4,169,777.92	0.48
2	603019	中科曙光	3,601,137.40	0.42

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603019	中科曙光	3,918,859.04	0.45

2	603636	南威软件	3,894,132.35	0.45
---	--------	------	--------------	------

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	7,770,915.32
卖出股票收入（成交）总额	7,812,991.39

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	88,634,000.00	10.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,070,000.00	5.81
	其中：政策性金融债	50,070,000.00	5.81
4	企业债券	326,398,675.00	37.85
5	企业短期融资券	300,420,000.00	34.83
6	中期票据	319,461,000.00	37.04
7	可转债（可交换债）	34,765,200.00	4.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,119,748,875.00	129.83

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	200201	20 国开 01	500,000	50,070,000.00	5.81
2	011902522	19 永煤 SCP015	400,000	40,180,000.00	4.66
3	102000560	20 镜湖开发 MTN001	400,000	39,844,000.00	4.62
4	200004	20 付息国债 04	400,000	38,792,000.00	4.50
5	101801229	18 津保投 MTN011	300,000	30,693,000.00	3.56

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	131189	恒浩云 B	100,000	9,974,000.00	1.16

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，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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。

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 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	73,378.82
2	应收证券清算款	7,998,027.44
3	应收股利	-
4	应收利息	15,909,720.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,981,126.30

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113029	明阳转债	7,168,111.40	0.83
2	128084	木森转债	4,897,200.00	0.57
3	128057	博彦转债	3,487,800.00	0.40
4	113552	克来转债	1,411,400.00	0.16

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

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
宝盈鸿盛债券 A	2,906	294,196.69	5,000,125.00	0.58%	849,935,456.87	99.42%
宝盈鸿盛债券 C	168	59,818.88	-	-	10,049,571.92	100.00%
合计	3,074	281,387.49	5,000,125.00	0.58%	859,985,028.79	99.42%

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	宝盈鸿盛债券 A	0.00	0.0000%
	宝盈鸿盛债券 C	110.11	0.0011%
	合计	110.11	0.0000%

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	宝盈鸿盛债券 A	0
	宝盈鸿盛债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	宝盈鸿盛债券 A	0

开放式基金	宝盈鸿盛债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈鸿盛债券 A	宝盈鸿盛债券 C
基金合同生效日（2020 年 2 月 26 日）基金份额总额	971,291,220.34	18,560,675.58
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	116,355,638.47	8,511,103.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	854,935,581.87	10,049,571.92

§ 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

本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	
长城证券	1	7,812,991.39	100.00%	7,119.93	100.00%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
中信证券（华南）	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

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

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

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。

2、交易单元变更情况

（1）本基金本报告期新租长城证券上海交易单元一个。新租华泰证券上海、深圳交易单元各一个。新租海通证券上海交易单元一个、深圳交易单元两个。新租招商证券上海交易单元一个。新租中信证券上海交易单元一个。新租中泰证券上海交易单元一个。新租华创证券上海交易单元一个。新租东北证券上海交易单元一个。新租中信证券（华南）上海、深圳交易单元一个。新租天风证券上海、深圳交易单元一个。新租浙商证券上海、深圳交易单元一个。新租渤海证券深圳交易单元一个。新租国泰君安证券深圳交易单元一个。新租兴业证券深圳交易单元一个。新租平安证券深圳交易单元一个。新租西南证券深圳交易单元一个。新租东兴证券深圳交易单元一个。新租长江证券深圳交易单元一个。

(2) 本报告期无退租交易单元。

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
长城证券	433,954,920.26	78.35%	2,511,200,000.00	93.94%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	119,906,274.68	21.65%	162,000,000.00	6.06%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

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增加中信证券华南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 6 月 30 日
2	宝盈基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证	2020 年 6 月 24 日

	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	券报,本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	
3	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
4	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
5	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
6	宝盈鸿盛债券型证券投资基金开放日常赎回业务的公告	上海证券报,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 23 日
7	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
8	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
9	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 3 月 24 日
10	宝盈鸿盛债券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 3 月 16 日
11	宝盈鸿盛债券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 3 月 16 日
12	宝盈鸿盛债券型证券投资基	上海证券报,本基金	2020 年 3 月 13 日

	金基金经理变更公告	管理人网站,中国证 券会基金电子披露 网站	
13	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金基金合同生效公告	上海证券报,本基 金管理人网站,中国证 券会基金电子披露 网站	2020 年 2 月 27 日
14	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金基金合同	本基金管理人网站, 中国证劵会基金电 子披露网站	2020 年 1 月 11 日
15	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金托管协议	本基金管理人网站, 中国证劵会基金电 子披露网站	2020 年 1 月 11 日
16	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金基金合同及招募说明书提 示性公告	上海证券报	2020 年 1 月 11 日
17	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金招募说明书	本基金管理人网站, 中国证劵会基金电 子披露网站	2020 年 1 月 11 日
18	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金招募说明书摘要	本基金管理人网站, 中国证劵会基金电 子披露网站	2020 年 1 月 11 日
19	宝盈鸿盛债券型证券投资基 金基金份额发售公告	上海证券报,本基 金管理人网站,中国证 券会基金电子披露 网站	2020 年 1 月 11 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鸿盛债券型证券投资基金设立的文件。

《宝盈鸿盛债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈鸿盛债券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

上述备查文件文本分别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

上述备查文件文本分别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

2020 年 8 月 31 日