宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

2018年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2019年3月29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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告,基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈核心优势混合	
基金主代码	213006	
交易代码	213006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年3月17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	1,120,583,524.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
下属分级基金的交易代码:	213006	000241
报告期末下属分级基金的份额总额	1,103,904,521.45份	16,679,003.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业,建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上,对于景气度提高的行业给予适当倾斜,以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力取得投资组合的市场适应性,在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2、股票投资策略 根据公司的基本面情况,根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业,建立股票池。本基金在构建投资组合时,强调两端投资,价值与成长性能平衡,兼顾价值与成长型股票,以均衡资产混合策略建立动力资产组合,努力克服单一风格投资所带来的局限性,这样可以较好控制组合市场适应性。一定程度上能够排除对景气误判概率,以求多空环境中都能创造主动管理回报。 3、债券投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差果断、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金是一只灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种。本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险预算范围内追求收益最大化。

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	张璀	王永民
	联系电话	0755-83276688	010-66594896
	电子邮箱	zhangc@byfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95566
传真		0755-83515599	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所、基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期数据和指标	2018年		2017年		2016年	
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
本期已实现收益	-188,881,144.70	-2,988,262.61	-123,622,224.77	-2,066,163.47	-18,113,405.92	1,362,299.75
本期利润	-246,984,464.89	-3,817,962.39	-14,630,384.27	-524,450.52	-493,220,044.11	-15,541,837.54
加权平均基金份额本期利润	-0.2221	-0.2330	-0.0100	-0.0231	-0.2943	-0.4628
本期基金份额净值增长率	-23.19%	-24.34%	0.00%	-1.47%	-21.53%	-22.29%

3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.2506	-0.2628	0.0052	-0.0257	0.0647	0.0399
期末基金资产净值	827,281,011.27	12,294,966.99	1,214,892,008.11	18,259,260.45	1,723,642,627.83	26,399,545.89
期末基金份额净值	0.7494	0.7372	1.0052	0.9743	1.0647	1.0399

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、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。

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

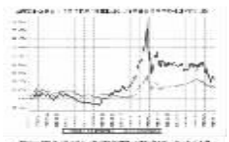
宝盈核心优势混合A

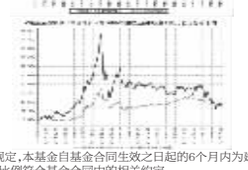
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.19%	1.79%	-7.54%	1.06%	3.35%	0.73%
过去六个月	-15.92%	1.71%	-8.37%	0.97%	-7.55%	0.74%
过去一年	-23.19%	1.66%	-15.25%	0.87%	-7.94%	0.79%
过去三年	-39.73%	1.34%	-9.02%	0.76%	-30.71%	0.58%
过去五年	37.07%	1.66%	30.84%	1.00%	6.23%	0.66%
自基金合同生效起至今	80.34%	1.45%	45.38%	0.99%	34.96%	0.46%

宝盈核心优势混合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
过去三个月	-4.56%	1.78%	-7.54%	1.06%	2.98%	0.72%
过去六个月	-16.55%	1.71%	-8.37%	0.97%	-8.18%	0.74%
过去一年	-24.34%	1.66%	-15.25%	0.87%	-9.09%	0.79%
过去三年	-42.07%	1.34%	-9.02%	0.76%	-33.05%	0.58%
过去五年	29.42%	1.66%	30.84%	1.00%	-1.42%	0.66%
自基金合同生效起至今	40.50%	1.64%	34.63%	0.98%	5.87%	0.66%

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

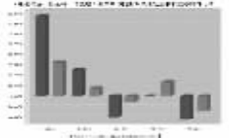


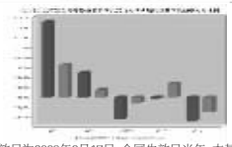


注:1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

2、本基金于2013年8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"宝盈核心优势混合C"。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:1、本基金合同生效日为2009年3月17日,合同生效日当年,本基金的收益率和业绩比较基准收益率是按实际存续期计算,不按整个自然年度折算。

2、本基金于2013年8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"宝盈核心优势混合C"。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

宝盈核心优势混合A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.3000	19,742,834.38	12,978,251.15	32,721,085.53	
2017	0.6000	54,583,378.19	32,450,118.63	87,033,496.82	
2016	1.2000	126,696,631.09	70,066,537.53	196,763,168.62	
合计	2.1000	201,022,843.66	115,494,907.31	316,517,750.97	

单位:人民币元

宝盈核心优势混合C

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	0.5100	564,186.67	626,624.36	1,190,811.03	
2016	1.2000	2,681,548.07	1,832,253.93	4,513,802.00	
合计	1.7100	3,245,734.74	2,458,878.29	5,704,613.03	

§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、宝盈安泰短债债券二十五只基金,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		
李健伟	本基金基金经理	2017年1月25日	-	7年	李健伟先生,华南理工大学工学硕士。2007年8月至2010年4月,在普华永道咨询有限公司任职高级顾问。2010年4月至2012年12月,在广发证券股份有限公司任职稽核员、行业研究员。2012年12月加入宝盈基金管理有限公司,先后任职研究部研究员、专户投资部投资经理、宝盈先进制造灵活配置混合型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、本基金基金经理非首任基金经理,其"任职日期"指根据公司决定确定的聘任日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,证券从业年限的计算截至2018年12月31日。

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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合,尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,形成《公平交易分析报告》,并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,公司要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存记录备查,但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析,并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2018年是十九大报告之后新开局第一年。基金管理人认为投资主线呈现为新经济领域科技创新、释放人口红利、工程师红利、教育红利从而实现技术赶超,核心科技、制造强国是2018年的核心投资主线。因此在基金配置中加大了对科技股和成长股的配置。但受到贸易战和去杠杆等国内政策的影响,权益市场表现并不理想,电子板块更是风声鹤唳,反复杀跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈核心优势混合A基金份额净值为0.7494元,本报告期基金份额净值增长率为-23.19%;截至本报告期末宝盈核心优势混合C基金份额净值为0.7372元,本报告期基金份额净值增长率为-24.34%;同期业绩比较基准收益率为-15.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

资本市场是多周期因素共同作用结果,核心驱动因素包括流动性周期、政策周期、经济周期和产业周期等。基于该分析框架,我们回顾审视2018年市场脉络,并对2019年进行展望。

流动性周期。2018年伴随严监管政策实施、金融条件收紧、利率上升,经济转向金融去杠杆的调整路径,从而带来社会融资增速下降,信贷市场利率上升,民营企业和低评级平台的利率水平大幅度上升。随着资本市场下跌的反身性,股权质押风险暴露频发,引发了权益市场企业盈利下行和流动性收紧的藏雍斯双杀。贸易战爆发后,经济下行、实体违约以及金融风险压力较大,人行货币政策委员会2018年第二季度将流动性定调从"保持流动性合理稳定"变为"保持流动性合理充裕"。7月23日国常会提出宽货币稳信用放财政,释放进一步宽松的信号,货币边际宽松得到反复确认,金融去杠杆的力度和节奏出现缓和。2019年开年以来,全球央行逐步由紧转松,流动性较为宽裕,国内资金价格全面下行。

政策周期。十九大后两会结束,从做减法到做加法,中央经济工作会议将供给侧改革工作重点转向推动高质量发展。对外关系尤其是对美关系成为2018年主导政策走向的核心考量,外部挑战倒逼国内政策趋于稳健,减税降费刺激消费基础和技创新自主可控成为核心要素。2019年贸易战迎来阶段性缓和,但贸易战对中国企业未来在全球制造体系地位产生长期重要影响。从权益市场监管态度而言,主流媒体不断吹风看多A股,叠加MSCI扩容预期,驱动海外资金加速入场。

经济周期。国内经济的趋势向下方向比较明确,积极的财政政策和融资环境改善形成一定对冲。2018年7月23日的国常会提出财政更加积极的两大举措,一个是"聚焦减税降费",一个是"加快今年1.35万亿元地方政府专项债券发行和使用进度",同时会议明确指出"在推动在建基础设施项目上早见成效",基建有望发力。

产业周期。在新格局和新经济下,政策方向已经转向补短板,孕育新动能,扶持创新,鼓励支持新经济将是政策基调和主线。在中兴事件和贸易战背景下,尤其能让我们深刻理解,科技自主创新而非房地产基建是中国未来的国运所在,消费和科技乃是新格局下新经济的大方向。我们认为未来三年行业将保持高景气度的行业包括光伏、新能源汽车、半导体设备、网络安全、医疗信息化等。

基于以上分析框架,在经济下行背景下,积极财政政策叠加流动性相对宽松,对权益市场相对利好,新兴成长乃是新格局下新经济的大方向,也是本基金未来的配置重点。同时,在市场配置中会适当规避强经济周期,以及直接受到贸易战冲击的行业。

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,由估值委员会以定估值方案,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

本基金收益分配原则:基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式,基金份额持有人可自行选择收益分配方式;基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同,本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权;当基金实现可分配收益达到0.04元或者当基金净值达到1.10元或以上时,且满足法定分红条件时,即实施收益分配,具体分红金额待定,分红方案将在满足上述条件的10个交易日内实施;基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值;如果基金当期出现亏损,则不进行收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至少分配1次,基金收益分配每年至多12次;年度分红12次后,如果再次达到分红条件,收益分配滚存到下一年度实施;全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的60%。基金合同生效不满三个月,收益可不分配;法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,报告期内本基金共进行了3次收益分配:

1、本基金管理人已于2018年4月25日发布公告,以2018年4月16日可供分配利润为基准,每10份A类基金份额派发红利0.10元,C类份额不分红。

2、本基金管理人已于2018年5月17日发布公告,以2018年5月8日可供分配利润为基准,每10份A类基金份额派发红利0.10元,C类份额不分红。

3、本基金管理人已于2018年5月30日发布公告,以2018年5月21日可供分配利润为基准,每10份A类基金份额派发红利0.10元,C类份额不分红。

本报告期末宝盈核心优势混合A可供分配基金份额利润-0.2506元,基金份额净值0.7494元,宝盈核心优势混合C可供分配基金份额利润-0.2628元,基金份额净值0.7372元。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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")在宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金(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,完全履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收益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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2018年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第20994号"标准无保留意见的审计报告",投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	48,000,944.02	102,220,005.71
结算备付金	1,935,451.57	2,713,839.35
存出保证金	364,751.42	397,658.04
交易性金融资产	797,886,553.31	1,053,553,743.55
其中:股票投资	654,479,632.21	837,682,024.95
基金投资	-	-
债券投资	143,406,921.10	215,871,718.60
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	-	50,000,145.00
应收证券清算款	4,368,622.10	29,383,128.78
应收利息	1,243,984.73	8,255,066.19
应收股利	-	-
应收申购款	154,917.32	462,124.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	853,955,224.47	1,246,985,711.04
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	-	-
应付证券清算款	10,813,273.12	7,720,469.61
应付赎回款	788,127.02	1,765,753.96
应付管理人报酬	1,090,549.54	1,565,600.49
应付托管费	181,758.27	260,933.41
应付销售服务费	15,995.39	23,817.30
应付交易费用	1,217,141.68	2,224,706.87
应交税费	71,907.27	70,261.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,493.92	202,899.24
负债合计	14,379,246.21	13,834,442.48
所有者权益:		
实收基金	1,120,583,524.55	1,227,303,187.23
未分配利润	-281,007,546.29	5,848,081.33
所有者权益合计	839,575,978.26	1,233,151,268.56
负债和所有者权益总计	853,955,224.47	1,246,985,711.04

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额总额为1,120,583,524.55份,其中宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值为0.7494元,基金份额为1,103,904,521.45份;宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额净值为0.7372元,基金份额为16,679,003.10份。

7.2 利润表

会计主体:宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-221,394,949.83	28,106,036.13
1.利息收入	3,324,148.48	12,032,929.91
其中:存款利息收入	372,328.77	887,167.45
债券利息收入	2,940,212.14	11,110,939.69
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,607.57	34,822.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-165,887,921.16	-94,801,014.30
其中:股票投资收益	-137,797,809.65	-90,277,326.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-31,024,494.66	-12,391,306.73
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	2,934,383.15	7,867,619.36
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-58,933,019.97	110,533,553.45
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	101,842.82	340,567.07
减:二、费用	29,407,477.45	43,260,870.92
1. 管理人报酬	15,120,832.22	22,455,470.72
2. 托管费	2,520,138.75	3,742,578.44
3. 销售服务费	214,681.86	334,887.05
4. 交易费用	11,099,493.96	16,269,053.74
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	587.15	-
7. 其他费用	451,743.51	458,880.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-250,802,427.28	-15,154,834.79
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-250,802,427.28	-15,154,834.79

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	1,227,303,187.23	5,848,081.33	1,233,151,268.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-250,802,427.28	-250,802,427.28
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)	-106,719,662.68	-3,332,114.81	-110,051,777.49
其中:1.基金申购款	150,570,947.42	-14,416,497.48	136,154,449.94
2.基金赎回款	-257,290,610.10	11,084,382.67	-246,206,227.43
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)	-	-32,721,085.53	-32,721,085.53
五、期末所有者权益(基金净值)	1,120,583,524.55	-281,007,546.29	839,575,978.26
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	1,644,279,865.39	105,762,308.33	1,750,042,173.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,154,834.79	-15,154,834.79
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)	-416,976,678.16	3,464,915.64	-413,511,762.52
其中:1.基金申购款	228,769,035.10	3,631,902.80	232,400,937.90
2.基金赎回款	-645,745,713.26	-166,987.16	-645,912,700.42
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)	-	-88,224,307.85	-88,224,307.85
五、期末所有者权益(基金净值)	1,227,303,187.23	5,848,081.33	1,233,151,268.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 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。

7.4.2.2 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。

7.4.2.3 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。

7.4.3 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[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。

7.4.4 关联方关系

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
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,120,832.22	22,455,470.72
其中:支付销售机构的客户维护费	3,106,026.64	4,334,648.09

注:支付基金管理人宝盈基金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:日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,520,138.75	3,742,578.44

注:支付基金托管人中国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。

7.4.5.2.3 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 2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	合计
宝盈基金公司	-	138,406.17	138,406.17
中国银行	-	-	-
合计	-	138,406.17	138,406.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日