宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈泛沿海混合
基金主代码	213002
交易代码	213002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月8日
报告期末基金份额总额	1,693,899,704.45份
投资目标	通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司,有效分享中国经济快速增长的成果,在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”进行资产配置和行业及类属资产配置,“自下而上”精选个股的彩极投资策略。 在整体资产配置层面,本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 在区域资产配置及行业权重层面,本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。 在个股选择层面,本基金以PEG、每股经营现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据,通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。
业绩比较基准	上证A股指数×80%+上证国债指数×20% 当市场出现合适的全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。
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。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	22,255,228.76
2.本期利润	35,921,580.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0209
4.期末基金资产净值	1,085,526,095.14
5.期末基金份额净值	0.6408

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

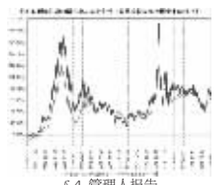
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	3.35%	1.51%	-2.67%	1.09%	6.02%	0.42%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张志梅	本基金、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理;权益投资部总经理	2017年12月7日	-	19年	张志梅女士,中国人民银行研究生部经济学硕士。1994年8月至1996年8月任职于南方证券有限公司资金部;1999年3月至2000年7月任职于南方证券有限公司研究所;2000年7月至2000年11月任职于21世纪科技投资有限公司投资部;2000年11月至2015年5月任职于南方基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理助理、专户投资部投资经理兼总监助理。2015年5月加入宝盈基金管理有限公司,曾任专户投资部投资经理、专户投资部副总经理、权益投资部副总经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观政策在2018年4季度已经出现转折性变化,流动性大幅改善,经过一年的持续下跌,A股市场核心品种的长期投资价值更加突出。1季度A股市场经历了典型的由预期驱动的估值修复性上涨。进入2季度以来,外围关系和内部金融条件再次出现曲折性变化,如中美贸易战再次进入僵持状态,由部分城商行兑付危机和被接管为代表的事件性冲击也偶有发生,进而引发市场对金融条件是否会进一步收紧的担忧。

本基金年初以来继续保持较高的权益配置比例,遵循“行业分散、个股集中”的投资策略,集中配置于保险、券商、金融信息、地产、电子、家电、医药、零售等行业中最优秀的企业。2季度减持券商、金融信息、电子和零售行业,增加对医疗服务、调味品、白酒和资源行业中具有最佳商业模式的公司的投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.6408元;本报告期基金份额净值增长率为3.35%,业绩比较基准收益率为-2.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,006,587,558.49	92.41
	其中:股票	1,006,587,558.49	92.41
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	82,396,399.30	7.56
8	其他资产	313,174.19	0.03
9	合计	1,089,297,131.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	199,176,607.93	18.35
C	制造业	356,298,188.83	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	39,603.76	0.00
J	金融业	109,024,169.94	10.04
K	房地产业	216,762,488.03	19.97
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	106,846,500.00	9.84
R	文化、体育和娱乐业	18,440,000.00	1.70
S	综合	-	-
	合计	1,006,587,558.49	92.73

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,230,000	108,990,300.00	10.04
2	600519	贵州茅台	109,000	107,256,000.00	9.88
3	300015	爱尔眼科	3,450,000	106,846,500.00	9.84
4	601225	陕西煤业	11,400,000	105,336,000.00	9.70
5	001979	招商蛇口	4,632,080	96,810,472.00	8.92
6	603288	海天味业	703,194	73,835,370.00	6.80
7	000333	美的集团	1,381,738	71,656,932.68	6.60
8	601155	新城控股	1,694,363	67,452,591.03	6.21
9	600600	青岛啤酒	1,168,159	58,326,178.87	5.37
10	600188	兖州煤业	4,850,000	52,719,500.00	4.86

注:报告期末受市场波动及基金规模变动等影响,本基金持有的中国平安占基金资产净值比例被动超过10%。本基金管理人将严格按照法律法规及基金合同的相关规定及时进行调整。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	247,896.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,065.74
5	应收申购款	49,212.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	313,174.19

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,742,907,521.99
报告期期间基金总申购份额	21,245,272.36
减:报告期期间基金总赎回份额	70,253,089.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,693,899,704.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,575,801.75
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,575,801.75
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.86

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金设立的文件。

根据《关于宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金名称变更为宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金。

《宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 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层

基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

9.3 查阅方式

上述备查文件文本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
2019年7月18日

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告送出日期:2019年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈核心优势灵活配置混合
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
报告期末基金份额总额	1,087,272,667.25份
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、行业前景、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制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,兼顾价值与成长性股票,以均衡资产混合策略建立动力资产组合,努力实现每一风险投资所带来的回报性,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、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等彩极的投资策略,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。
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
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	1,070,094,243.13份 / 17,178,424.12份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
1. 本期已实现收益	23,953,540.04	314,142.00
2. 本期利润	-103,613,359.14	-1,703,239.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0962	-0.0965
4. 期末基金资产净值	978,652,006.40	15,487,870.20
5. 期末基金份额净值	0.9145	0.9016

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、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 本报告期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

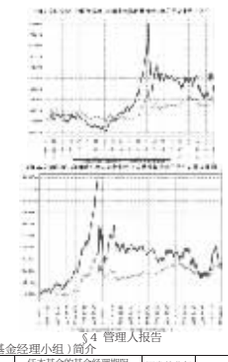
宝盈核心优势混合A

阶段	净值增长率①	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	-9.58%	2.03%	-0.37%	1.00%	-9.21%	1.03%

宝盈核心优势混合C

阶段	净值增长率①	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	-9.94%	2.03%	-0.37%	1.00%	-9.57%	1.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	8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稳健投资部,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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

在2018年基金年报中基金经理认为2019年比2018年更有机会,一季度市场迎来了报复性的反弹。但是随着贸易摩擦在二季度的恶化,以华为产业链为代表的科技股被集中抛售,市场风险偏好急剧下行。

基金经理对于未来市场结构的判断是,经济下行趋势明确,和宏观周期相关度较高的蓝筹品种难有超额收益(加之已经历了三年的蓝筹牛市)。从五月份公布的经济数据来看,经济走势前高后低的态势十分明显。投资数据来看,投资的主要领域制造业、房地产、基建等都呈现增速见顶回落态势。

随着经济下行压力显现,宽松政策逐步走上轨道。美国方面,6月美联储会议虽然没有宣布降息,但是声明基调明显偏鸽派。当前美联储7月降息的概率已经升至100%。国内方面,无风险利率呈现阶段性下行状态,而五月份新增社融同比增速保持较高增长,流动性重现“货宽信宽”格局。

流动性宽松和政策呵护提升风险偏好,随着贸易摩擦和科技战的推进,所有人都明白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。成长类的高景气度行业未来预期会有比较好的表现。

基金目前仓位主要是弱周期相关的、高景气度的细分行业龙头,主要持仓聚焦于新能源汽车、半导体、信息安全等领域。本基金管理人认为未来2-3年会是成长股有相对收益和绝对收益的市场。

4.5 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0.9145元,本报告期基金份额净值增长率为-9.58%;截至本报告期末宝盈核心优势混合C基金份额净值为0.9016元,本报告期基金份额净值增长率为-9.94%;同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	785,117,379.28	78.61
	其中:股票	785,117,379.28	78.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	153,027,503.76	15.32
	其中:债券	153,027,503.76	15.32
	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	49,319,793.04	4.94
8	其他资产	11,227,579.32	1.12
9	合计	998,692,255.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	22,943,261.25	2.31
C	制造业	582,839,598.91	58.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	179,300,649.18	18.04
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	785,117,379.28	78.97

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002439	启明星辰	3,499,173	94,127,753.70	9.47
2	600745	闻泰科技	2,763,353	91,798,586.66	9.23
3	002463	沪电股份	6,313,619	85,991,490.78	8.65
4	300420	五洲停车	14,678,102	80,582,779.98	8.11
5	300241	瑞丰光电	12,838,507	76,260,731.58	7.67
6	300113	顺网科技	4,762,800	74,680,704.00	7.51
7	603690	至纯科技	3,650,219	73,113,836.57	7.35
8	002832	比音勒芬	929,800	44,323,566.00	4.46
9	300450	先导智能	1,157,348	38,886,892.80	3.91
10	300604	长川科技	1,512,160	28,504,216.00	2.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,912,064.00	1.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	143,115,439.76	14.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	153,027,503.76	15.39

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123016	洲明转债	498,031	61,287,694.86	6.16
2	113521	科森转债	556,170	56,117,553.00	5.64
3	123021	万信转2	168,792	18,212,656.80	1.83
4	019611	19国债01	99,200	9,912,064.00	1.00
5	110054	通威转债	40,000	4,912,400.00	0.49

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2019年1月9日,闻泰科技股份有限公司收到上海证券交易所出具的《关于对闻泰科技股份有限公司和有关责任人予以监管关注的决定》,具体情况如下:2018年4月28日,闻泰科技股份有限公司披露了2017年度内部控制审计报告。根据上述报告,2017年1月5日,公司子公司徐州中茵置业有限公司与关联方西藏中茵集团有限公司签订《借款合同》,约定自2017年1月1日起,中茵集团向徐州中茵提供的借款利率由银行同期贷款利率4.35%改为年利率11.15%,借款期限展期为2017年1月1日至2018年12月21日止。根据公司七届十一次董事会决议,从2011年1月1日起,凡公司及控股子公司向实际控制人及其关联企业借款,一律按银行同等利率计提支付计息。截至2017年12月31日,公司2017年度根据上述关联方借款协议计提的关联方借款利息超过同期银行贷款利率部分金额为52,769,113.34元,占公司2016年经审计净资产的1.22%,占公司2016年经审计净利润的109.98%,金额较大。根据公司内部的《关联交易制度》,上述关联借款事项应提交董事会审议通过,但公司未就上述关联借款提交董事会审议,截至公司2017年年报出具日仍未履行审批程序。据此,公司2017年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。同时,根据公司于2017年10月31日披露的2017年半年度报告问询函回复公告,截至2017年1月1日,中茵集团向徐州中茵提供的借款余额为588,753,350.68元,按照当时约定的借款利率计算,预计2017年全年借款利息65,645,936.60元。上述借款利息占公司最近一期经审计净资产的1.53%,达到应当披露的标准。公司应当在2017年1月签订借款合同时及时披露相关公告,但公司迟至回复2017年半年报问询函公告中才予以披露。公司未就上述关联交易事项及时履行信息披露义务。公司于2017年1月5日签订上述关联借款合同时,未及时履行内部决策程序及相应信息披露义务,导致公司2017年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》(以下简称《股票上市规则》)第14.4条、第21条、第10.2.4条等有关规定,对闻泰科技股份有限公司子以监管关注。本基金注意到,以上事件是闻泰科技公司在管理细节上的问题,事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注闻泰科技自身业务发展的同时,也会持续关注公司在公司治理方面的改善,并将公司治理加入到对该公司的长期价值评估中。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	411,525.39
2	应收证券清算款	9,939,938.57
3	应收股利	-
4	应收利息	407,173.05
5	应收申购款	468,942.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,227,579.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123016	洲明转债	61,287,694.86	6.16
2	113521	科森转债	56,117,553.00	5.64

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
报告期期初基金份额总额	1,101,060,323.06	18,361,155.69
报告期期间基金总申购份额	60,033,438.33	1,848,692.39
减:报告期期间基金总赎回份额	90,999,518.26	3,031,423.96
报告期期末基金份额总额	1,070,094,243.13	17,178,424.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,300,645.16
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,300,645.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.40

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人住所:北京市西城区复兴门内大街1号

9.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2019年7月18日

光大保德信安和债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:光大保德信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性