宝盈睿丰创新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:广发证券股份有限公司
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。

基金托管人广发证券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	宝盈睿丰创新混合
基金主代码	000794
交易代码	000794
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月26日
报告期末基金份额总额	161,207,722.14份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置,重点关注具备持续创新能力的上市公司,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期,稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。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部分组成。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65% +中债综合指数收益率(全价)×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。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	宝盈睿丰创新混合A/B 宝盈睿丰创新混合C
下属分级基金的交易代码	000794 000796
下属分级基金的前端交易代码	000794 –
下属分级基金的后端交易代码	000795 –
报告期末下属分级基金的份额总额	40,236,861.34份 120,970,860.80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)	
	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
1. 本期已实现收益	3,734,344.45	9,849,226.16
2. 本期利润	–1,718,707.70	–4,999,499.27
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0422	–0.0408
4. 期末基金资产净值	50,675,859.34	138,075,261.40
5. 期末基金份额净值	1.259	1.141

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

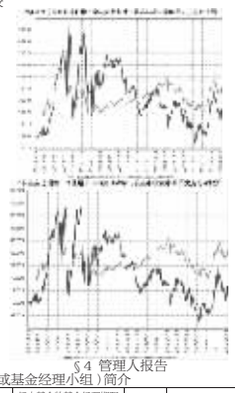
宝盈睿丰创新混合A/B

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	–3.38%	1.82%	–0.70%	0.99%	–2.68%	0.83%

宝盈睿丰创新混合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	–3.63%	1.82%	–0.70%	0.99%	–2.93%	0.83%

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		
朱建明	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理	2017年1月5日	–	9年	朱建明先生,中国人民银行研究生部金融学硕士。2010年7月至2011年3月任职于瀚信资产管理有限公司,担任研究员;自2011年5月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部研究员、专户投资部投资经理、宝盈策略增长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。
杨思亮	本基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018年3月3日	–	8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。

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,在投资管理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

2019二季度市场处于震荡调整期,以食品饮料为代表的白马核心资产走势亮眼,科技成长股受贸易摩擦持续深化的负面影响,调整幅度较大。本基金投资方向主要为科技创新和产业升级,基金净值不可避免受到市场调整的拖累。从操作上,管理人通过仓位的灵活调整,适当规避了市场风险。在投资方向上,基于产业研究和数据跟踪,产业未来和景气度没有改变,我们依然坚持一贯的长期创新方向,不会盲目追逐市场热点。本基金二季度依然聚焦于长期深度研究和理解的方向,如医疗信息化龙头、云计算互联网、创新药产业链、人工智能和金融科技龙头,具备全球竞争力的CDMO龙头和新能源汽车中游等,以及部分受益于消费升级的可选消费龙头。

从二季度的实际操作情况来分析,我们坚持配置的创新药产业链、CDMO龙头表现非常亮眼,基于估值与利润增速的匹配,在上涨的过程中适当减持,同时增持了业绩向好估值较低的医药标的。云计算互联网、人工智能与金融科技龙头有所回调,我们加大了配置。重点配置的医疗信息化公司由于政策真空期回调幅度较大,我们强调,医疗领域的变革和创新是较为缓慢的,业绩的兑现节奏也需要一个过程,因此,持股周期也应该相应拉长,我们并未改变对医疗信息化的产业判断,下跌过程中加大了配置比例。可选消费龙头二季度表现优秀,该龙头是基于五年以上的长期配置思路,从二季度跟踪的终端数据来看仍然十分强劲。总体来说,我们二季度的持仓大部分延续18年甚至17年研究成果并长期配置。在市场调整的过程中,对投资组合进一步优化。

我们一直强调,从长期来看,我们相信消费升级和产业创新是未来前景广阔、确定性较强的两大方向。一方面,随着居民可支配收入增长,消费代际更迭,勇于在产品研发、商业模式、业务形态上锐意创新、提升能力的企业,就能抓住消费升级浪潮,成就伟大的企业。另一方面,新兴产业中引领技术趋势与工艺创新的企业,通过持续研发投入和产品创新,构筑了越来越宽的护城河,核心竞争力和产业链地位不断加强,具备长期投资价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈睿丰创新混合A/B基金份额净值为1.259元,本报告期基金份额净值增长率为–3.38%;截至本报告期末宝盈睿丰创新混合C基金份额净值为1.141元,本报告期基金份额净值增长率为–3.63%;同期业绩比较基准收益率为–0.70%。

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一百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	170,437,293.01	89.67
	其中:股票	170,437,293.01	89.67
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,062,353.86	0.56
	其中:债券	1,062,353.86	0.56
	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	18,146,337.19	9.55
8	其他资产	431,565.05	0.23
9	合计	190,077,549.11	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	–	–
C	制造业	77,625,645.60	41.13
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	75,698,586.76	40.10
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	16,981,523.05	9.00
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	131,532.60	0.07
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	170,437,293.01	90.30

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	600588	用友网络	689,338	18,529,405.44	9.82
2	601888	中国国旅	191,557	16,981,528.05	9.00
3	002020	京新药业	1,350,000	15,552,000.00	8.24
4	300550	和仁科技	489,982	15,424,633.36	8.17
5	300253	卫宁健康	1,043,627	14,798,630.86	7.84
6	300702	天宇股份	400,000	14,416,000.00	7.64
7	002230	科大讯飞	419,950	13,959,138.00	7.40
8	002422	科伦药业	400,000	11,892,000.00	6.30
9	600745	闻泰科技	300,000	9,966,000.00	5.28
10	300451	创业慧康	599,998	8,969,970.10	4.75

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	–	–
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)	1,062,353.86	0.56
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,062,353.86	0.56

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	123021	万信转2	9,846	1,062,353.86	0.56

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 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

5.10.3 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除闻泰科技外未受到公开谴责、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65,645,998.60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1.4条、第2.1条、第10.2.4条等有关规定,对闻泰科技股份有限公司予以监管关注。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	286,041.73
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,606.16
5	应收申购款	140,917.16
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	431,565.05

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
报告期期初基金份额总额	42,108,988.00	124,323,488.54
报告期期间基金总申购份额	2,280,461.37	12,678,878.98
减:报告期期间基金总赎回份额	4,152,588.03	16,031,506.72
报告期期末基金份额总额	40,236,861.34	120,970,860.80

§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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈睿丰创新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

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:广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

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

宝盈祥泰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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	宝盈祥泰混合
基金主代码	001358
交易代码	001358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	278,302,064.91份
投资目标	在严格控制下行风险的前提下,追求稳定的投资回报,为投资人提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,在控制下行风险的前提下,确定大类资产配置比例,通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益,适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+1%
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,属于中等收益/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	中国建设银行股份有限公司

§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	737,623.64
2.本期利润	4,527,184.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0691
4.期末基金资产净值	310,410,996.67
5.期末基金份额净值	1.115

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

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	0.81%	0.62%	0.62%	0.01%	0.19%	0.61%

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		
高宇	本基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈鑫泰纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥顺定期开放混合型证券投资基金基金经理;固定收益部副总经理	2017年11月11日	–	11年	高宇先生,厦门大学投资学硕士。2008年6月至2009年8月任职于第一创业证券资产管理部,担任研究员;2009年8月至2010年10月任职于国信证券经济研究所,担任固定收益分析师;2010年10月至2016年6月任职于博时基金,先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理等职位;2016年7月至2017年8月任职于天风证券,担任机构业务总部总经理助理。2017年8月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部,历任宝盈货币市场证券投资基金基金经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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,在投资管理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

2019年二季度,国内经济在消费、出口、投资等方面仍面临着下行的压力,经济的下行趋势比较确定,政策调整成为当前阶段驱动国内资产价格走势的主要原因。股票和转债等风险资产经历了一轮快速的上涨下跌,目前没有观察到明确的盈利驱动,风险偏好的转变是短期影响价格的主要因素;债券的方向较为确定,但空间取决于是否有更积极的政策。

报告期内,本组合适当增加了蓝筹股的仓位,同时增加短债资产的配置,积极参与新股申购策略以增强收益。

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1.115元;本报告期基金份额净值增长率为0.81%,业绩比较基准收益率为0.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§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	112,040,632.00	34.58
	其中:股票	112,040,632.00	34.58
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	185,461,200.00	57.23
	其中:债券	185,461,200.00	57.23
	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	24,817,162.62	7.66
8	其他资产	1,728,041.59	0.53
9	合计	324,047,036.21	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	6,318,762.00	2.04
C	制造业	29,039,552.00	9.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	5,346,779.00	1.72
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	2,249,761.00	0.72
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,116,976.00	0.68
J	金融业	60,045,297.00	19.34
K	房地产业	4,367,430.00	1.41
L	租赁和商务服务业	1,906,975.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	650,100.00	0.21
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	112,040,632.00	36.09

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	179,400	15,896,634.00	5.12
2	600519	贵州茅台	8,200	8,068,800.00	2.60
3	600036	招商银行	198,000	7,124,040.00	2.30
4	601166	兴业银行	222,800	4,075,012.00	1.31
5	600030	中信证券	147,300	3,507,213.00	1.13
6	600276	恒瑞医药	52,100	3,438,600.00	1.11
7	601328	交通银行	517,700	3,168,324.00	1.02
8	600887	伊利股份	93,600	3,127,176.00	1.01
9	600016	民生银行	477,000	3,028,950.00	0.98
10	601288	农业银行	754,200	2,715,120.00	0.87

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	15,987,200.00	5.15
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	10,100,000.00	3.25
5	企业短期融资券	100,243,000.00	32.29
6	中期票据	20,339,000.00	6.55
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	38,792,000.00	12.50
9	其他	–	–
10	合计	185,461,200.00	59.75

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	041900152	19西南水泥CP002	200,000	20,022,000.00	6.45
2	019611	19国债01	160,000	15,987,200.00	5.15
3	101556011	15希开投MTN001	100,000	10,186,000.00	3.28
4	101453027	14晋保MTN001	100,000	10,153,000.00	3.27
5	155406	19恒大01	100,000	10,100,000.00	3.25

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

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金可相应调整和更新相关投资策略。

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 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

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除兴业银行外未受到公开谴责、处罚。

2018年9月12日上海证监局就兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时"不符合法定条件,未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试,不具备任职资格"的情形,责令兴业银行股份有限公司于2018年10月25日前整改,健全基金托管业务内部控制制度,加强从业人员管理,并于2018年10月25日前提交整改报告。

上述事项对兴业银行实际运营管理影响较小,本基金日后也将关注公司在内部控制方面的改善。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	330,860.70
2	应收证券清算款	446,069.20
3	应收股利	–
4	应收利息	3,847.80
5	应收申购款	35,259.64
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	816,037.34

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

本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限的情况。

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	251,737,621.28
报告期期间基金总申购份额	16,585,945.46
减:报告期期间基金总赎回份额	24,675,020.24
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	243,648,546.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳证券投资基金基金托管协议》。

中国证监会准予鸿阳证券投资基金变更注册的文件;

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

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28号凯晨世贸中心东座F9

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

宝盈消费主题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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7