宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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

送出日期:2019年8月27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。本半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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈睿丰创新混合	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	161,207,722.14份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨凯	崔瑞娟
	联系电话	0755-83276688	020-66338888
	电子邮箱	yangk@byfunds.com	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	95575
传真		0755-83515599	020-87555129

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	7,118,290.36	18,754,064.89
本期利润	10,204,499.17	27,005,169.28
加权平均基金份额本期利润	0.2430	0.2143
本期基金份额净值增长率	22.59%	22.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.9505	-0.9994
期末基金资产净值	50,675,859.34	138,075,261.40
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;

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 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	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	5.09%	1.57%	3.61%	0.75%	1.48%	0.82%
过去三个月	-3.38%	1.82%	-0.70%	0.99%	-2.68%	0.83%
过去六个月	22.59%	1.87%	17.34%	1.00%	5.25%	0.87%
过去一年	6.69%	1.93%	7.49%	0.99%	-0.80%	0.94%
过去三年	-21.07%	1.58%	14.58%	0.72%	-35.65%	0.86%
自基金合同生效起至今	25.90%	2.06%	41.61%	1.04%	-15.71%	1.02%

宝盈睿丰创新混合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	5.06%	1.56%	3.61%	0.75%	1.45%	0.81%
过去三个月	-3.63%	1.82%	-0.70%	0.99%	-2.93%	0.83%
过去六个月	22.03%	1.87%	17.34%	1.00%	4.69%	0.87%
过去一年	5.94%	1.94%	7.49%	0.99%	-1.55%	0.95%
过去三年	-22.85%	1.58%	14.58%	0.72%	-37.43%	0.86%
自基金合同生效起至今	14.10%	2.07%	41.61%	1.04%	-27.51%	1.03%

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

§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、宝盈品牌消费股票二十八只基金,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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。

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2019年6月30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

2019年上半年市场先扬后抑,食品饮料、中游周期、科技成长轮番表现。二季度开始以食品饮料为代表的白马核心资产估值提升明显,随着贸易摩擦的持续深化,以电子、通信为代表的科技成长股调整幅度较大。由于本基金的投资方向主要为科技创新和产业升级,基于产业研究和数据分析,我们认为长期看好的产业未来和景气度没有改变,仍然坚持一贯的长期创新方向,不盲目追逐市场热点。因此,上半年本基金依然聚焦于长期深度研究和持续看好的方向,如云计算、医疗信息化、人工智能和金融科技、创新药产业链、具备全球竞争力的CDMO龙头,以及真正受益于消费升级的可选消费龙头。在操作上,基于年初对大势的乐观判断,本基金保持了较高仓位,二季度初市场高位震荡,管理人通过仓位的灵活调整,一定程度上规避了市场风险,但由于成长股持续调整,基金净值不可避免受到市场调整的拖累。

从长期来看,我们对中国的产业创新和技术崛起抱有充分信心。在经济增速趋于平缓,长期去杠杆方向不变、市场空间从增量逐步转向存量竞争的大背景下,低技术含量低附加值的低端产业生存空间日益逼仄。特别是在贸易摩擦加剧的负面冲击下,中国企业的技术短板突出、核心竞争力缺乏的弱点暴露无遗,未来唯有植根于工程师红利和市场红利的土壤,沉下心来加大核心技术研发和投入、专注于产品和工艺创新,对标国际领先对手逐步缩小差距,才能成功实现产业创新升级,中国也才能成功跨过中等收入陷阱。另一方面,随着中产阶级扩大,居民可支配收入增长和代际更迭,消费升级仍然是前景广阔,确定性较强的方向。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,就能抓住消费升级的浪潮、成就伟大的企业。总体来说,经过这一轮大洗牌后,优秀的龙头公司将构筑更宽的护城河,提升核心竞争力和产业链地位,从这个意义上,这些企业更具备长期价值。

4.4.2 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22.59%;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22.03%;同期业绩比较基准收益率为17.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年,在科创板推出的大形势下,市场应有结构性机会。

宏观经济方面,我们认为经济平缓下行的趋势难以逆转,贸易摩擦深入化和长期化,去杠杆的反复,营商环境有待优化,都会影响企业部门的投资和扩张意愿,从而传导到产业链各个环节。经济政策如何平衡去杠杆和激发经济主体的活力之间的矛盾,从而激发被压制的经济内生动力,考验政策能力与定力。

证券市场方面,我们维持年初的判断,仍然倾向于市场将告别2018年的单边下跌,迎来结构性向好的行情,不可否认的是,2018年A股市场的结构恶化对实体经济形成了一定的拖累,既不利于发挥资本市场直接融资、为产业升级优化资源配置的功能,也不利于社会整体的消费与投资。放松资本市场管制、鼓励金融企业为民营企业融资、推出科创板,政策已经为证券市场的定位和未来指明了方向。

行业走势方面,我们仍然保持对长期成长行业的乐观态度,云计算、创新药、迎来5G创新周期的电子半导体、受益消费升级的可选消费,都会有不错的表现。

经过本轮冲击,全社会从上至下更加意识到创新的至关重要,创新将是未来成就伟大企业最重要的基因之一,由此带来的政策倾斜和资源集中,创新性龙头企业将具备长期的投资价值。本基金主要的投资方向为基于产业逻辑寻找创新方向的成长龙头,因此,我们不会盲目追逐市场热点,坚持创新方向长期持股,同时,根据经济环境的变化,适当配置可选消费龙头。通过自下而上选取基本面优秀的龙头公司,为客户创造长期稳健回报。

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,由其按约定提供相关债券品种、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,本基金托管人在对宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款		17,341,114.04	11,876,606.91
结算备付金		806,223.15	345,177.31
存出保证金		286,041.73	163,244.12
交易性金融资产		171,499,646.87	159,040,641.79
其中:股票投资		170,437,293.01	159,040,641.79
基金投资		-	-
债券投资		1,062,353.86	-
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		-	-
应收证券清算款		-	2,085,819.32
应收利息		4,606.16	3,947.69
应收股利		-	-
应收申购款		140,917.16	102,495.94
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		190,077,549.11	173,617,933.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		3,250.00	893,441.15
应付赎回款		526,988.25	77,951.63
应付管理人报酬		222,367.77	221,522.57
应付托管费		37,061.30	36,920.43
应付销售服务费		86,808.97	86,469.17
应付交易费用		264,090.23	225,258.05
应交税费		8.41	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		185,853.44	160,005.64
负债合计		1,326,428.37	1,701,568.64
所有者权益:			
实收基金		161,207,722.14	179,546,790.76
未分配利润		27,543,398.60	-7,630,426.32
所有者权益合计		188,751,120.74	171,916,364.44
负债和所有者权益总计		190,077,549.11	173,617,933.08

注:报告截止日2019年6月30日,宝盈睿丰创新混合A/B基金份额净值1.259元,基金份额总额40,236,861.34份;宝盈睿丰创新混合C基金份额净值1.141元,基金份额总额120,970,860.80份。宝盈睿丰创新混合份额总额合计为161,207,722.14份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		40,402,523.60	-7,456,959.28
1.利息收入		71,472.62	79,724.48
其中:存款利息收入		70,475.15	79,724.48
债券利息收入		997.47	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		28,886,152.26	-16,038,634.50
其中:股票投资收益		27,708,690.58	-17,252,905.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		1,177,461.68	1,214,270.97
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		11,337,313.20	8,442,548.41
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		107,585.52	59,402.33
减:二、费用		3,192,855.15	3,597,818.54
1. 管理人报酬		1,380,116.61	1,542,484.36
2. 托管费		230,019.43	257,080.73
3. 销售服务费		538,475.06	603,031.91
4. 交易费用		949,630.19	1,007,501.24
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.59	-
7. 其他费用		94,610.27	187,720.30
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		37,209,668.45	-11,054,777.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		37,209,668.45	-11,054,777.82

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	179,546,790.76	-7,630,426.32	171,916,364.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,209,668.45	37,209,668.45
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)	-18,339,068.62	-2,035,843.53	-20,374,912.15
其中:1.基金申购款	36,802,385.96	4,099,452.39	40,901,838.35
2.基金赎回款	-55,141,454.58	-6,135,295.92	-61,276,750.50
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)	161,207,722.14	27,543,398.60	188,751,120.74
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	201,647,640.72	33,707,844.50	235,355,485.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,054,777.82	-11,054,777.82
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)	-25,782,288.02	-4,651,522.49	-30,433,810.51
其中:1.基金申购款	29,908,184.14	3,772,752.89	33,680,937.03
2.基金赎回款	-55,690,472.16	-8,424,275.38	-64,114,747.54
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)	175,865,352.70	18,001,544.19	193,866,896.89

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______ ______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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 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
广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")	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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	623,887,961.52	100.00%	665,678,069.16	100.00%

6.4.5.1.2 债券交易

无。

6.4.5.1.3 债券回购交易

无。

6.4.5.1.4 权证交易

无。

6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	568,545.51	100.00%	264,090.23	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	606,633.10	100.00%	264,558.80	100.00%

注:1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,380,116.61	1,542,484.36
其中:支付销售机构的客户维护费	618,350.72	688,489.54

注:支付基金管理人宝盈基金公司的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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.5%/当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	230,019.43	257,080.73

注:支付基金托管人广发证券的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:

日托管费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

6.4.5.2.3 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 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 宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C	合计
宝盈基金公司	-	34,586.38	34,586.38
广发证券	-	249,460.86	249,460.86
合计	-	284,047.24	284,047.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C	合计
宝盈基金公司	-	39,628.27	39,628.27
广发证券	-	293,019.35	293,019.35
合计	-	332,647.62	332,647.62

注: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0.8%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×0.8% / 当年天数。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.5.4.2 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。

6.4.5.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入
广发证券	17,341,114.04	63,762.38	11,600,864.26	72,697.97

注:本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.7 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	170,437,293.01	89.67
	其中:股票	170,437,293.01	89.67
2	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	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,146,337.19	9.55
7	其他各项资产	431,565.05	0.23
8	合计	190,077,549.11	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	-	-
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	16,981,528.05	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

7.3 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

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	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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.byfunds.com网站的半年度报告正文。

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	300168	万达信息	22,377,643.48	13.02
2	300570	太辰光	16,559,288.74	9.63
3	002020	京新药业	15,760,391.93	9.17
4	002123	梦网集团	14,668,317.00	8.53
5	002422	科伦药业	14,655,899.14	8.53
6	300702	天宇股份	14,059,417.66	8.18
7	600588	用友网络	13,767,400.70	8.01
8	600745	闻泰科技	13,016,816.00	7.57
9	002230	科大讯飞	12,701,460.86	7.39
10	600570	恒生电子	12,019,100.00	6.99
11	601888	中国国旅	11,560,868.78	6.72
12	300212	易华录	10,871,138.60	6.32
13	300253	卫宁健康	9,831,110.33	5.72
14	002791	坚朗五金	8,932,602.80	5.20
15	603456	九洲药业	8,768,636.00	5.10
16	300550	和仁科技	8,505,033.05	4.95
17	300347	泰格医药	8,145,839.68	4.74
18	600055	万东医疗	7,129,203.52	4.15
19	600585	海螺水泥	7,089,503.00	4.12
20	300232	洲明科技	5,862,104.20	3.41
21	600703	三安光电	5,773,199.00	3.36
22	300568	星源材质	5,760,752.48	3.35
23	300590	移为通信	5,269,057.00	3.06
24	600276	恒瑞医药	4,787,440.00	2.78
25	002407	多氟多	4,493,432.00	2.61
26	002777	久远银海	4,318,963.00	2.51
27	300113	顺网科技	4,285,639.50	2.49
28	002920	德赛西威	4,226,665.00	2.46

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	300347	泰格医药	30,444,308.20	17.71
2	600570	恒生电子	22,432,844.77	13.05
3	300168	万达信息	19,988,724.00	11.63
4	601888	中国国旅	16,257,172.45	9.46
5	002123	梦网集团	14,283,946.83	8.31
6	600588	用友网络	14,127,364.06	8.22
7	300078	思创医惠	13,963,844.00	8.12
8	300570	太辰光	11,893,350.31	6.92
9	300212	易华录	11,161,092.47	6.49
10	600276	恒瑞医药	10,930,586.95	6.36
11	603508	思维列控	10,917,924.00	6.35
12	002230	科大讯飞	10,298,687.96	5.99
13	603456	九洲药业	8,193,710.40	4.77
14	300253	卫宁健康	7,102,545.00	4.13
15	600585	海螺水泥	7,029,044.00	4.09
16	300550	和仁科技	6,712,720.00	3.90
17	000739	普洛药业	6,533,263.96	3.80
18	300232	洲明科技	6,442,384.20	3.75
19	300568	星源材质	5,938,980.36	3.45
20	600703	三安光电	5,342,035.00	3.11
21	002792	通宇通讯	5,069,079.00	2.95
22	603636	南威软件	4,954,378.00	2.88
23	300497	富祥股份	4,819,498.00	2.80
24	002791	坚朗五金	4,666,921.00	2.71
25	002422	科伦药业	4,632,587.00	2.69
26	002920	德赛西威	4,618,013.00	2.69
27	002407	多氟多	4,587,906.92	2.67
28	600745	闻泰科技	4,575,953.00	2.66
29	601766	中国中车	4,400,000.00	2.56
30	002777	久远银海	4,359,396.00	2.54
31	002594	比亚迪	4,064,502.00	2.36
32	002271	东方雨虹	3,777,144.60	2.20
33	603538	美诺华	3,639,554.16	2.12

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	298,158,181.41
卖出股票收入(成交)总额	325,729,780.11

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	-	-
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

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	123021	万信转2	9,846	1,062,353.86	0.56

7.7 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。

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

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。

7.12.2

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。

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	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

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

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
宝盈睿丰创新混合A/B	2,820	14,268.39	-	-	40,236,861.34	100.00%
宝盈睿丰创新混合C	8,046	15,034.91	8.22	-	120,970,852.58	100.00%
合计	10,866	14,835.98	8.22	-	161,207,713.92	100.00%

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	宝盈睿丰创新混合A/B	0.61	0.0000%
	宝盈睿丰创新混合C	29,201.10	0.0241%
	合计	29,201.71	0.0181%

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	宝盈睿丰创新混合A/B	0
	宝盈睿丰创新混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈睿丰创新混合A/B	0
	宝盈睿丰创新混合C	0
	合计	0

§9 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
基金合同生效日(2014年9月26日)基金份额总额	85,899,566.53	775,547,215.40
本报告期期初基金份额总额	44,479,558.69	135,067,232.07
本报告期基金总申购份额	6,294,531.39	30,507,854.57
减:本报告期基金总赎回份额	10,537,228.74	44,604,225.84
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	40,236,861.34	120,970,860.80

§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

1、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下:

(1)根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第四次现场会议决议,同意张啸川同志辞去总经理职务。

(2)根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第五次现场会议决议,同意聘任杨凯同志担任公司总经理,同时,根据公司章程规定,经营管理层董事由公司总经理担任,经营管理层董事的资格与总经理职务不可分离,任职期间与总经理的任职期间相同,自总经理被任命之日起算,至总经理离职之日自动终止。

(3)根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第六次现场会议决议,同意张瓘同志不再担任督察长职务。

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备,并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(4)根据宝盈基金管理有限公司股东会2019年第一次现场会议决议,同意景开强、陈赤不再担任公司董事,马永红、陈铬担任公司董事;同意张建华、刘郁飞不再担任公司监事,陈林、王法立担任公司监事。

(5)根据宝盈基金管理有限公司第五届监事会第四次现场会议决议,同意张建华不再担任公司监事会主席,由陈林担任监事会主席职务。

2、报告期内本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

1、报告期内,基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

2、报告期内,基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚情况如下:

(1)2019年3月25日,本基金托管人广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(广东证监局行政监管措施决定书[2019]20号),指出广发证券存在对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题,决定对广发证券采取责令改正的行政监管措施,要求广发证券应于2019年6月30日之前予以改正,并向广东局提交书面整改报告。

对此,广发证券高度重视,将切实进行整改,采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系,并及时向广东证监局报送了整改报告。

(2)2019年4月19日,因本基金托管人广发证券在以低于成本价格参与公司债券项目投标的情形,广东证监局向广发证券下发了《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(广东证监局行政监管措施决定书【2019】28号),责成广发证券对相关问题予以改正,提交书面整改报告,并严格追究相关责任人员责任。

对此,广发证券高度重视,责令相关部门进行整改,组织对监管规定进行再学习,对相关人员进行内部问责,并及时向广东证监局报送了整改报告。

(3)2019年8月5日,本基金托管人广发证券收到《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》(中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书〔2019〕31号),因对广发控股(香港)有限公司风险管控缺失、合规管理存在缺陷、内部管控不足及未做好广发控股香港月度数据统计工作等问题,中国证券监督管理委员会对广发证券采取了限制增加场外衍生品业务规模6个月、限制增加新业务种类6个月的行政监管措施。

对此,广发证券高度重视,将切实进行整改,采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
广发证券	2	623,887,961.52	100.00%	568,545.51	100.00%	-

注:1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为:

(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席位租用协议。

2、交易单元变更情况

本基金本报告期内无租用和退租交易单元。

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

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

§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。

宝盈基金管理有限公司

2019年8月27日