## 宝盈祥泰混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

6.4.3 税项

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

送出日期:2019年8月27日

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。

基金托管人中国建设银行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
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
SEA ALCOHOLI	the many hard feet design and advanced as the

投资目标	在严格控制下行风险的前提下,追求稳定的投资E 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 下、确定大贵产得暨社师,通过榜李 货币市场 等期近收益类资产投资获取稳定收益。超度参与规则 等权益类资产投资;和基金的投资等的 大贵资产配置策略,固定收益类资产投资策略,股票 投资策略和金融行生品投资策略的一个部分担瓜。
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信于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,基于中等收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 名称		基金管理人	基金托管人
		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
	姓名	杨凯	田青
信息披露负责 人	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	yangk@byfunds.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信自拡震方式

§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

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)
本期已实现收益	5,194,891.70
本期利润	8,039,034.41
加权平均基金份额本期利润	0.1380
本期基金份额净值增长率	5.39%
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	0.1154
期末基金资产净值	310,410,996.67
期末基金份额净值	1.118

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。

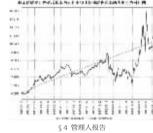
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	1.83%	0.29%	0.21%	0.01%	1.62%	0.289
过去三个月	0.81%	0.62%	0.62%	0.01%	0.19%	0.619
过去六个月	5.39%	0.60%	1.24%	0.01%	4.15%	0.599
过去一年	7.31%	0.45%	2.50%	0.01%	4.81%	0.449
过去三年	7.11%	0.30%	7.50%	0.01%	-0.39%	0.299
自基金合同 生效起至今	11.50%	0.26%	10.67%	0.01%	0.83%	0.25

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



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 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 只致力于获得良好业绩,努力为投资者创造丰厚的回报。

姓名 职务	任本基金的基金经	理(助理)期限	证券从	证券从	
住名 時時	任职日期	离任日期	业年限	19599	
本端校園建立。在後次 (1) 在	2017年11月11日	_	11年	審字先生、厦门大会 经营等础上、2009年8月月 2009年8月月 2009年8月月 2009年8月月 2009年8月月 2009年8月 2010年10月 2010年	

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

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 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,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。

4.4.2 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 5.39%、小纺比较基准收益率为1.24%。

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下半年,我们认为经济基本面的下行趋势比较确定,通胀略低于年 初预期,且在需求回落的背景下压力不大。目前来看中短端信用债的空间比较确

定,利差压缩是全年主线,长端利率债的下行空间取决于货币政策价格工具的放

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 所的专业音见 中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,由其按约定提有关债券品种、流通受限股票的估值参考

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 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了 《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金 的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行 为。报告期内,本基金未实施利润分配。

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 本托管人复核审查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

《6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:宝盈祥泰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 况

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
jit.		
行存款	24,817,162.62	5,279,348.07
算备付金	-	251,777.93
出保证金	57,611.39	46,627.70
易性金融资产	297,501,832.00	60,238,233.92
中:股票投资	112,040,632.00	_
金投资	-	-
券投资	185,461,200.00	60,238,233.92
产支持证券投资	-	_
金属投资	-	_
生金融资产	-	_
人返售金融资产	-	_
收证券清算款	-	-
收利息	1,668,054.22	1,272,373.23
收股利	-	_
收申购款	1,375.98	12,305.56
延所得税资产	-	_
他资产	1,000.00	1,000.00
产总计	324,047,036.21	67,101,666.41
债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
债:		
期借款	-	_
易性金融负债	-	_
生金融负债	-	_
出回购金融资产款	-	3,000,000.00
付证券清算款	13,223,422.54	
付赎回款	485.61	27,023.27
付管理人报酬	74,840.58	32,475.96
付托管费	31,183.57	13,531.66
付销售服务费	-	_
付交易费用	127,449.29	62,120.75
交税费	4,274.19	8,560.59
付利息	-	4,832.94
付利润	-	_
延所得税负债	-	_
他负债	174,383.76	150,000.00
债合计	13,636,039.54	3,298,545.17
有者权益:		
收基金	278,302,064.91	60,296,275.86
分配利润	32,108,931.76	3,506,845.38
有者权益合计	310,410,996,67	63,803,121.24
债和所有者权益总计	324,047,036.21	67,101,666.41

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值人民币1.115元,基金份额总额278

会计主体:宝盈祥泰混合刑证券投资基金 本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

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
一、收入	8,849,606.87	-1,258,928.10
1.利息收入	669,214.46	1,208,598.83
其中:存款利息收入	63,947.25	48,437.34
债券利息收入	593,048.32	943,955.46
资产支持证券利息收人	-	
买人返售金融资产收人	12,218.89	216,206.03
其他利息收入	-	
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,331,343.08	-2,663,736.07
其中:股票投资收益	1,365,114.97	-2,484,812.26
基金投资收益	-	
债券投资收益	3,280,891.15	-266,973.81
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	685,336.96	88,050.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,844,142.71	195,344.24
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,906.62	864.90
减:二、费用	810,572.46	1,118,244.84
1. 管理人报酬	187,110.61	357,038.62
2. 托管费	77,962.73	102,142.79
3. 销售服务费	-	_
4. 交易费用	383,867.97	333,480.23
5. 利息支出	60,395.62	74,478.20
其中: 卖出回购金融资产支出	60,395.62	74,478.20
6. 税金及附加	1,839.02	1,647.47
7. 其他费用	99,396.51	249,457.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	8,039,034.41	-2,377,172.94
减:所得税费用	-	_
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	8,039,034.41	-2,377,172.94

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元 項目 实收基金 未分配利润 所有者权益合计 -、期初所有者权 基金净值、 60,296,275 3,506,845.3 63.803.121 8.039.034.4 8.039.034 、本期基金份额交易 生的基金净值变; (净值减少 "号填列) 中: 1.基金申购款 32,108,931.76 278,302,064 310,410,996 实收基金 未分配利润 所有者权益合计 91,056,25 5,880,62 96.936.87 -2.377.1729 -2.377.172 、本期基金份额交易 生的基金净值变动 (净值减少D 中:1.基金申购款

2,426,962.64 65,280,163.38 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:

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责

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

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

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

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。

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占的通 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 是《关于资管产品增值稳有关问题的通知》 财税[2017]90是《关于和太固定资产 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

(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

(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

(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

6) 木基全的城市维护建设税 教育费附加和地方教育费附加等税费按昭实际 缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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

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。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 家和基金管理有限公司心1下简称"宝劢基 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

中国建设银行股份有限公司(以下简称"中 国建设银行") 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

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。 6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

上年度可比期间 18年1月1日至2018年6月30日 頭目 当期发生的基金应支付的管理费

单位:人民币元

注:自2015年5月29日(基金合同生效日)至2018年3月13日,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1.20%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 × 1.20%/ 当年天数

根据基金份额持有人大会表决通过的《宝盈基金管理有限公司关于宝盈祥泰

养老混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自 2018年3月14日起,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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.60%/ 当年天数。 6.4.5.2.2 基金托管费

注: 支付基金托管人中国建设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。

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

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

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 6.455 由关联方促管的银行左数全额及当期产生的利息收入

上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 19年6月30日 期末余额 当期利息收入 期末余額 当期利息收入 24,817, 162,62

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

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

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 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 6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	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	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	-	_	
3	贵金属投资	-	-	
4	金融衍生品投资	-	-	
5	买人返售金融资产	-	_	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-	
6	银行存款和结算备付金合计	24,817,162.62	7.66	-34
7	其他各项资产	1,728,041.59	0.53	着
8	合计	324,047,036.21	100.00	送

金额单位:人民币元 占基金资产净值比例(%) 信息传输、软件和信息技术服 科学研究和技术服务』 民服务、修理和其他服务 文化、体育和娱乐业 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

18 中国平安 19 贵州茅台 36 招商银行 66 兴业银行 30 中信证券 76 恒璐医药	8,200 198,000 222,800 147,300	15,896,634.00 8,068,800.00 7,124,040.00 4,075,012.00 3,507,213.00	5.1: 2.60 2.30 1.3: 1.1:
36 招商银行 66 兴业银行 30 中信证券	198,000 222,800 147,300	7,124,040.00 4,075,012.00 3,507,213.00	2.30 1.3 1.11
66 兴业银行 30 中信证券	222,800 147,300	4,075,012.00 3,507,213.00	1.3:
30 中信证券	147,300	3,507,213.00	1.13
76 信磁库药	ED 400		
10 1521012353	52,100	3,438,600.00	1.1
28 交通银行	517,700	3,168,324.00	1.00
87 伊利股份	93,600	3,127,176.00	1.0
16 民生银行	477,000	3,028,950.00	0.90
88 农业银行	754,200	2,715,120.00	0.83
	16 民生银行 88 农业银行	16 民生银行 477,000 88 农业银行 754,200	16 民生银行 477,000 3,028,950.00

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

7,041,806 大秦铁路

老虎相关交易费用。 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

注:表中"本期累计买入金额"指买入成交金额,即成交单价乘以成交数量,不

金额单位:人民币元

占期初基金资产净值比例(%)	本期累计卖出金额	股票名称	股票代码	序号
14.09	8,990,056.18	长城汽车	601633	1
9.49	6,052,798.00	万华化学	600309	2
8.65	5,521,399.70	上汽集团	600104	3
8.62	5,499,371.99	老板电器	002508	4
7.55	4,815,418.56	海螺水泥	600585	5
7.38	4,707,330.00	中国平安	601318	6
6.57	4,193,833.00	迈克生物	300463	7
6.22	3,970,774.90	兆易创新	603986	8
6.00	3,828,121.00	精測电子	300567	9
5.88	3,752,893.00	温氏股份	300498	10
5.53	3,530,789.00	伊利股份	600887	11
5.41	3,451,424.12	华夏幸福	600340	12
4.31	2,749,710.00	中际旭创	300308	13
3.30	2,106,967.00	万 科A	000002	14
3.26	2,083,124.00	美的集团	000333	15
3.19	2,037,824.00	桐昆股份	601233	16
3.14	2,002,475.00	中新赛克	002912	17
3.13	1,995,746.00	欧菲光	002456	18
3.04	1,940,307.00	贵州茅台	600519	19
2.93	1,872,187.00	通威股份	600438	20
2.74	1,750,086.00	中炬高新	600872	21
2.74	1,746,050.00	陕西煤业	601225	22
2.70	1,722,460.00	上海机场	600009	23
2.34	1,491,331.00	阳光城	000671	24
2.21	1,409,480.00	万达电影	002739	25
2.12	1,354,326.00	恒生电子	600570	26

注:表中"本期累计卖出金额"指卖出成交金额,即成交单价乘以成交数量,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:人民而元

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
序号	债券品种	公允价值	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	-	-

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

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
13-13	100,951 (419)	1四分子-芒-村小	9X III ( 9K )	257G0F1H	(%)
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甬开投 MTN001	100,000	10,186, 000.00	3.28
4	101453027	14晋煤MTN001	100,000	10,153, 000.00	3.27
5	155406	19恒大01	100,000	10,100, 000,00	3.25

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

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

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。

710.2 本基全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

7.11 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。 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 本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.1 本期国债期货投资政策

7.12 投资组合报告附注

部控制方面的改善。

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

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

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 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-四舍五人的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。	
§ 8 基金份额持有人信息	
期末基金份额持有人户数及持有人结构	
	份额单位:份

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	9.45	0.0000%

§ 9 升放式基金份	狈变动
	单位
基金合同生效日(2015年5月29日)基金份额总额	3,989,623,187.02
本报告期期初基金份额总额	60,296,275.86
本报告期基金总申购份额	254,301,190.72
减:本报告期基金总赎回份额	36,295,401.67

§ 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,同意张啸川同志商 经理离职之日自动终止。 )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,同意张瑾同志不同 醫學於明決。 以上受更事項已按規定向中國证券監督管理委员会深圳证監局报告以及向中国证券投资 並协会報務,并沒有基金行业高级管理人用受更公告。 社分限期至基基金管理有限公司股东会2019年第一次现场会议决议,同意贯开强、陈赤不 主公司董事,尚水红、陈裕阻任公司董事;同意张建华、刘循军不再担任公司董事,陈林、王 (4) 財叛王進惠惠由(1977)。 担任公司董事, 3次北、原始但任公司董事;同意张建年, 37億 8 个时组正公中無十 (2)担任公司董事, 3次北、原始但任公司董五届监事会第四次现场会议决议, 同意张建年不时 (3) 則報至臺建金管理有限公司第五届监事会第四次现场会议决议, 同意张建年不时 (3) 司董事会主席,由陈林但任宣章会主席联系。 (3) 提供了企业的原本任宣和劳力,通先任管部门重大人事空动情况如下; 中国建设银行2019年0月4日发布公告, 得任聚业费为中国建设银行股份有限公司资产

10.3 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,未发生显高灾变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,基金管理人、托管人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

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

备注 华泰证券 202,248 东方证券 63,561,144,36 海通证券 东北证券

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)实力维厚,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

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、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况: ( I )租用交易单元情况

本报告期内新租招商证券上海交易单元一个;新租海通证券上海交易单元一 个;新租申万宏源证券上海交易单元一个;新租银河证券上海、深圳交易单元各一 个;新租国金证券上海、深圳交易单元各一个;新租平安证券深圳交易单元一个;新 租安信证券上海、深圳交易单元各一个;新租西南证券深圳交易单元一个。

(Ⅱ)退和交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。 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

东方证券

《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

报告期内持有基金份额变化情况

者类别	序号	持有基金份额比 例达到或者超过 20%的时间区间	期初 份额	申购 份額	赎回 份額	持有份额	份额 占比	
机构	1	20190613-201 90616	-	32,209, 132.42	-	32,209, 132.42	11.57 %	
	2	20190101-201 90313	28,766, 388.75	-	28,766, 388.75	-	0.00%	
	3	20190613-201 90616	-	32,218, 264.84	-	32,218, 264.84	11.58 %	
			jitt	品特有风险			•	
本基可能	金本存在	报告期内存在单一 流动性等风险,敬请	Q资者持有基: 投资人留意。	金份额比例达	到或超过20%的	的情况,在极端	情况下	

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

投

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

金额单位, 人民币元