宝盈新价值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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	宝盈新价值混合
基金主代码	000674
交易代码	000674
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月10日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	685,950,589.47份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以超越业绩比较基准为目标,在严格控制下行风险的基础上进行有效的资产配置与投资标的精选,力争实现资产的稳定增值。
投资策略	本基金将实施积极主动的投资策略,运用多种方法进行资产配置。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个部分组成。 (一)大类资产配置策略 本基金大类资产配置的策略目标是一方面规避相关资产的下行风险,另一方面促进合能够成功地捕捉某类资产的上行趋势。 (二)股票投资策略 本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法,以深入的基本面研究为基础,精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式来构建备选股票库。 (三)固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。 (四)权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨凯	张燕
	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	yangk@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515699	0755-83195201

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

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	43,087,658.22
本期利润	327,049,289.47
加权平均基金份额本期利润	0.4620
本期基金份额净值增长率	45.01%
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	0.0252
期末基金资产净值	996,789,170.90
期末基金份额净值	1.453

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。

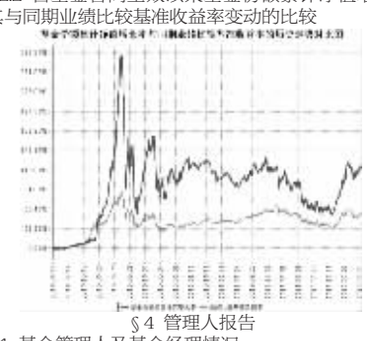
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.05%	1.20%	3.61%	0.75%	-0.56%	0.45%
过去三个月	2.40%	1.63%	-0.70%	0.99%	3.10%	0.64%
过去六个月	45.01%	1.55%	17.34%	1.00%	27.67%	0.55%
过去一年	26.79%	1.63%	7.49%	0.99%	19.30%	0.64%
过去三年	-0.07%	1.31%	14.58%	0.72%	-14.65%	0.59%
自基金合同生效起至今	118.56%	1.95%	51.40%	1.01%	67.16%	0.94%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖肖	本基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈品牌消费股票型证券投资基金基金经理;研究部副总经理	2017年12月15日	-	11年	肖肖先生,北京大学金融学硕士。2008年7月至2011年4月任职于联合证券有限责任公司,担任研究员;2011年5月至2014年5月任职于民生证券有限责任公司,担任研究员;2014年6月至2015年2月任职于方正证券股份有限公司,担任研究员;自2015年2月加入宝盈基金管理有限公司研究部,担任研究员。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
陈卓苗	本基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2019年1月18日	-	4年	陈卓苗先生,金融学硕士。曾就职于上海重阳投资管理股份有限公司。任研究员;2017年12月加入宝盈基金管理有限公司,曾任研究员。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

回顾2019年上半年,本基金在板块选择上坚持选择高景气和稳定成长的细分行业及个股,随着市场整体风险偏好的修复和经济托底政策效应的显现,重点持仓个股的企业价值逐步得到市场发现及认可。本报告期主要持仓集中在地产、白电、乳制品、调味品、保险、白酒、养猪业、煤炭等估值具备安全边际,同时伴随中国经济增长能获得稳定现金流回报的企业和个股。

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1.453元;本报告期基金份额净值增长率为45.01%,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

本基金管理人认为,2019年中国的宏观经济将处于磨底的过程。不可忽视的是,经过近几年的去产能及2016年以来的供给侧改革,部分传统行业已有显著改善,加上改革和创新的持续推进,向好的力量渐有积蓄。

A股目前整体处于“估值低分位+盈利能力高分位”的状态,2019年盈利增速趋势向下,但权益资产价格已部分反映了机构投资者对宏观经济下行的预期。从投资的角度来看,即使经济出现一定程度下滑,部分优质标的的估值水平也提供了较高的安全边际,本产品将继续聚焦核心资产,守正用奇,以守为攻。

目前来看,市场的悲观因素经过一年多的时间已大部分price in,G20会谈后中美贸易战再次获得边际改善,有利于整体市场风险偏好的转暖,贸易摩擦对微观经济的影响将会边际减弱,同时相信政府有充足的政策工具实现经济托底。从价值投资的角度来看,目前自下而上选股仍有相当一部分股票处于合理的价值投资区间。

本基金将继续秉承中观行业高景气+自下而上精选高成长个股的策略,坚持价值投资的理念,为投资者追求较高的收益。

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,由其按约定提有关债券品种、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

托管人声明,招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:宝盈新价值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	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	58,099,790.69	39,574,409.46
结算备付金	568,910.42	35,140.39
存出保证金	105,459.98	156,351.09
交易性金融资产	938,055,986.56	692,248,864.72
其中:股票投资	938,055,986.56	692,248,864.72
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	2,682,534.36	2,823,938.98
应收利息	11,621.90	8,769.56
应收股利	-	-
应收申购款	319,411.62	66,228.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	999,843,715.53	734,913,702.65
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
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	-	-
应付赎回款	1,300,145.12	222,176.05
应付管理人报酬	1,202,630.37	963,215.92
应付托管费	200,438.38	160,535.97
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	158,631.60	272,436.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	192,699.16	300,320.23
负债合计	3,054,544.63	1,918,684.37
所有者权益:		
实收基金	685,950,589.47	731,862,307.19
未分配利润	310,838,581.43	1,132,711.09
所有者权益合计	996,789,170.90	732,995,018.28
负债和所有者权益总计	999,843,715.53	734,913,702.65

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.453元,基金份额总额685,950,589.47份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈新价值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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	335,983,364.95	-186,099,762.78
1.利息收入	183,761.93	253,681.47
其中:存款利息收入	183,761.93	253,618.97
债券利息收入	-	62.50
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)	51,556,896.17	18,562,696.99
其中:股票投资收益	39,055,875.80	11,285,881.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	12,429.43
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	12,501,020.37	7,264,385.63
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	283,961,631.25	-205,139,424.11
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	281,075.60	223,282.87
减:二、费用	8,934,075.48	11,859,911.60
1、管理人报酬	6,833,957.45	7,851,366.04
2、托管费	1,138,992.90	1,308,561.02
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	858,537.45	2,546,240.40
5、利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6、税金及附加	-	0.23
7、其他费用	102,587.68	153,743.91
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	327,049,289.47	-197,959,674.38
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	327,049,289.47	-197,959,674.38

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈新价值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)	731,862,307.19	1,132,711.09	732,995,018.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	327,049,289.47	327,049,289.47
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)	-45,911,717.72	-17,343,419.13	-63,255,136.85
其中:1.基金申购款	67,257,900.26	23,328,738.58	90,586,638.84
2.基金赎回款	-113,169,617.98	-40,672,157.71	-153,841,775.69
四、本期向基金分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)	685,950,589.47	310,838,581.43	996,789,170.90

项目	上年度可比期间 2019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)	905,925,974.89	362,484,755.65	1,268,410,730.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-197,959,674.38	-197,959,674.38
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)	-152,549,877.46	-54,769,502.95	-207,319,380.41
其中:1.基金申购款	34,118,633.07	10,391,799.37	44,510,432.44
2.基金赎回款	-186,668,510.53	-65,161,302.32	-251,829,812.85
四、本期向基金分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)	753,376,097.43	109,755,578.32	863,131,675.75

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

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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

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
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期内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

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	6,833,957.45	7,851,366.04
其中:支付销售机构的客户维护费	3,121,330.96	3,547,744.63

注:支付基金管理人宝盈基金管理有限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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷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	1,138,992.90	1,308,561.02

注:支付基金托管人招商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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

份额单位:份

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
期初持有的基金份额	5,658,743.63	5,658,743.63
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,658,743.63	5,658,743.63
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.82%	0.75%

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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		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	期末余额	当期利息收入
招商银行	58,099,790.69	179,535.87	88,515,345.64	239,992.84

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,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

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

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

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

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	938,055,986.56	93.82
	其中:股票	938,055,986.56	93.82
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	58,668,701.11	5.87
7	其他各项资产	3,119,027.86	0.31
8	合计	999,843,715.53	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	174,434,497.00	17.50
B	采矿业	99,342,311.25	9.97
C	制造业	341,468,450.97	34.26
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	99,702,397.94	10.00
K	房地产业	223,068,725.64	22.38
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	938,055,986.56	94.11

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	600872	中炬高新	2,332,093	99,883,543.19	10.02
2	601318	中国平安	1,124,800	99,668,528.00	10.00
3	600519	贵州茅台	100,890	99,275,760.00	9.96
4	601225	陕西煤业	10,712,000	98,978,880.00	9.93
5	002714	牧原股份	1,526,700	89,754,693.00	9.00
6	300498	温氏股份	2,361,400	84,679,804.00	8.50
7	601155	新城控股	1,907,786	75,948,960.66	7.62
8	000333	美的集团	1,287,825	66,786,604.50	6.70
9	001979	招商蛇口	1,904,656	39,807,310.40	3.99
10	600048	保利地产	2,926,300	37,339,588.00	3.75
11	600585	海螺水泥	877,400	36,412,100.00	3.65
12	000002	万 科A	1,130,000	31,425,300.00	3.15
13	000876	新 希 望	1,704,300	29,603,691.00	2.97
14	000961	中南建设	3,013,800	26,099,508.00	2.62
15	600340	华夏幸福	382,194	12,448,058.58	1.25
16	000858	五 粮 液	79,100	9,329,845.00	0.94
17	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.04
18	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
19	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
20	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.00
21	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
22	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
23	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00

注:1、报告期末受市场波动及基金规模变动等影响,本基金持有的中炬高新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。

2、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	300498	温氏股份	81,613,491.50	11.13
2	000333	美的集团	30,784,673.78	4.20
3	000876	新 希 望	25,842,983.58	3.53
4	000961	中南建设	24,837,003.00	3.39
5	601225	陕西煤业	24,205,690.00	3.30
6	002714	牧原股份	18,593,933.00	2.54
7	601318	中国平安	13,217,723.71	1.80
8	600340	华夏幸福	11,981,664.96	1.63
9	000002	万 科A	11,889,518.00	1.62
10	000418	小天鹅A	8,238,359.00	1.12
11	000858	五 粮 液	7,204,774.00	0.98
12	600519	贵州茅台	4,424,147.00	0.60
13	600872	中炬高新	1,272,059.00	0.17
14	600989	宝丰能源	270,838.72	0.04
15	600968	海油发展	208,845.00	0.03
16	601298	青岛港	109,487.50	0.01
17	002948	青岛银行	94,522.24	0.01
18	600928	西安银行	90,684.36	0.01
19	002958	青农商行	70,092.00	0.01
20	603379	三美股份	66,546.36	0.01

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	000651