宝盈中证100指数增强型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

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:2018年8月29日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28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2018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	宝盈中证100指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月8日
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
报告期末基金份额总额	168,497,135.99份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度约绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,基金总体投资业绩超越中证100指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分采用完全复制法,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术,适当参与金融衍生产品的投资。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的80%,预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金,属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张璀	田菁
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@bfunds.com	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

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.bfunds.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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	6,341,782.07
本期利润	-26,137,976.07
加权平均基金份额本期利润	-0.1561
本期基金份额净值增长率	-9.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2008
期末基金资产净值	219,868,545.96
期末基金份额净值	1.305

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

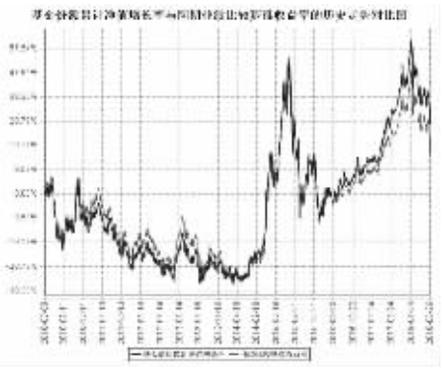
4、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-5.37%	1.18%	-6.40%	1.19%	1.03%	-0.01%
过去三个月	-6.99%	1.11%	-8.22%	1.12%	1.23%	-0.01%
过去六个月	-9.69%	1.15%	-11.17%	1.16%	1.48%	-0.01%
过去一年	4.48%	0.97%	-0.13%	0.96%	4.61%	0.01%
过去三年	0.00%	1.37%	-9.91%	1.36%	9.91%	0.01%
自基金合同生效起至今	30.50%	1.38%	18.77%	1.39%	11.73%	-0.01%

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)、宝盈盈泰纯债债券二十三只基金,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
蔡丹	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理	2017年8月5日	-	8年	蔡丹女士,CFA,中山大学概率论与数理统计硕士，曾任职于网易互动娱乐有限公司,广发证券股份有限公司,2011年9月至2017年7月任职于长城证券股份有限公司,先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事，2017年7月加入宝盈基金管理有限公司。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2018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

今年上半年，受中美贸易摩擦、信用风险加剧等一系列利空因素影响,A股主要指数均明显下行:1月份上证综指冲高创出本轮反弹新高3587.03点后开始大幅快速调整。从主要指数来看:中证100指数下跌11.77%,上证50指数下跌13.3%,沪深300指数下跌12.9%,上证综指下跌13.9%,中小板指下跌14.26%,创业板指下跌8.33%,中证1000指数下跌20.08%。分行业来看,申万28个一级行业中仅有3个行业上涨,分别是休闲服务(涨8.98%)、医药生物(涨3.11%)和食品饮料(涨0.14%);25个行业下跌,跌幅前五的行业有:综合(跌31.17%)、通信(跌27.14%)、电气设备(跌24.88%)、机械设备(跌22.98%)和有色金属(跌22.77%)。

从风格来看,1月份大盘蓝筹维持强势,2月初创业板走强带动小盘风格持续走强,于4月中旬达到相对高位后开始震荡回落,其中5月下旬至6月中下旬出现一波快速下行。从整体来看,上半年风格波动较大,切换较为频繁,趋势持续性不强。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子,构建多维度、多策略的选股体系。2017年在成份股内构建了行业内增强策略,在实现主要风险因子中性的基础上,严格控制与基准指数的偏离度,通过增强策略来增强产品收益。此外,本基金还积极参与网下新股申购,通过打新来提供稳定的增强收益。

报告期内,本基金的股票仓位维持94%左右的水平,在复制中证100指数成份股的基础上,配置了部分增强策略。本基金2018年上半年单位净值增长率为-9.69%,相对基准超额收益为1.48%,年化跟踪误差为0.86%。

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1.305元；本报告期基金份额净值增长率为-9.69%,业绩比较基准收益率为-11.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然A股中长期趋势不明朗,但经历上半年的持续下跌后,短期市场做空动能已得到大幅缓解。

从估值水平来看,截至2018年7月23日A股整体估值靠近长期底部:上证50的PE为10.08倍,中证100的为11.1倍,沪深300的PE为12倍,中证500的PE为22.49倍，中小板的PE为26.73倍，创业板的PE为40.45倍,均处于历史上相对较低水平。中证100下一年业绩预期增速为13.91%,当前预期PEG水平为0.7，不论是从绝对还是相对来看，均处于较为合理的水平。

从利率来看,当前利率处于温和的下行趋势,在政策边际宽松预期下,信用利差开始小幅回落,短期市场波动率略有上行,近期创业板相对抗跌,如信用利差拐点出现将会使得小盘风格更具相对优势。

展望后市,伴随汇率贬值趋势性的缓解、中报业绩的披露、流动性短期改善和中美贸易战冲击效应的边际减弱,三季度避险情绪有望缓和,市场可能迎来阶段性反弹的机会。从市场风格来看,预计在维持大体均衡的基础上,中小盘成长风格可能相对占优,从因子来看,随着养老金、机构资金入市比例的持续放大,基本面因子、质量因子和流动性因子都是持续关注的重点。

我们将严格按照基金合同的规定,在严格控制与基准指数偏离的基础上,依托我们的多维度选股策略体系,控制主要风险因子,运用数量化选股模型,构建增强部分投资组合,以增强产品业绩。我们将继续努力尽责地做好本基金的管理工作,尽力为投资者谋取较好的回报。

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

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、利润分配等情况的说明

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:宝盈中证100指数增强型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	14,873,587.92	3,998,209.42
结算备付金	14,444.04	242,079.33
存出保证金	35,755.83	32,708.33
交易性金融资产	205,650,744.34	216,474,581.86
其中:股票投资	205,650,744.34	207,487,181.86
基金投资	-	-
债券投资	-	8,987,400.00
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	-	151,037.15
应收利息	3,303.89	224,370.56
应收股利	-	-
应收申购款	263,215.60	1,157,131.88
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	220,841,051.62	222,280,118.53
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	190,909.88	497,297.04
应付赎回款	291,541.24	1,060,736.17
应付管理人报酬	142,122.32	143,120.84
应付托管费	28,424.47	28,624.16
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	40,005.26	74,019.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	279,502.49	151,717.17
负债合计	972,505.66	1,955,514.70
所有者权益:		
实收基金	168,497,135.99	152,469,957.68
未分配利润	51,371,409.97	67,854,646.15
所有者权益合计	219,868,545.96	220,324,603.83
负债和所有者权益总计	220,841,051.62	222,280,118.53

注:本报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.305元,基金份额总额168,497,135.99份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈中证100指数增强型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-24,679,922.83	23,584,100.72
1.利息收入	133,521.29	88,477.75
其中:存款利息收入	34,522.36	40,852.46
债券利息收入	98,998.93	47,625.29
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)	7,526,314.78	3,535,367.05
其中:股票投资收益	4,978,064.51	1,958,061.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	17,877.66	481.00
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	2,530,372.61	1,576,824.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-32,479,758.14	19,834,196.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	139,999.24	126,059.39
减:二、费用	1,458,053.24	1,259,674.23
1. 管理人报酬	895,408.09	590,249.20
2. 托管费	179,081.61	118,049.82
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	195,064.05	371,770.54
5. 利息支出	7,730.39	7,847.39
其中:卖出回购金融资产支出	7,730.39	7,847.39
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	180,769.10	171,757.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-26,137,976.07	22,324,426.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-26,137,976.07	22,324,426.49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈中证100指数增强型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	152,469,957.68	67,854,646.15	220,324,603.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,137,976.07	-26,137,976.07
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)	16,027,178.31	9,654,739.89	25,681,918.20
其中:1.基金申购款	99,996,660.54	51,202,587.89	151,199,248.43
2.基金赎回款	-83,969,482.23	-41,547,848.00	-125,517,330.23
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)	168,497,135.99	51,371,409.97	219,868,545.96
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	76,010,760.38	5,891,068.89	81,901,829.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,324,426.49	22,324,426.49
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)	75,268,485.59	9,522,342.70	84,790,828.29
其中:1.基金申购款	168,277,370.72	24,599,028.11	192,876,398.83
2.基金赎回款	-93,008,885.13	-15,076,685.41	-108,085,570.54
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)	151,279,245.97	37,737,838.08	189,017,084.05

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:

_____张啸川_____ _____丁宁_____ _____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、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")	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

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

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	895,408.09	590,249.20
其中:支付销售机构的客户维护费	264,063.63	111,961.62

注:支付基金管理人宝盈基金公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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:日基金管理报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	179,081.61	118,049.82

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0.15%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×0.15%/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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国建设银行	14,873,587.92	32,422.10	3,038,084.11	34,891.85

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

无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末(2018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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	38.03	-	-	30,100	1,769,013.56	1,144,703.00	-
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大事项	19.52	-	-	48,800	1,008,638.29	952,576.00	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大事项	6.34	2018年8月7日	5.71	99,100	752,709.19	628,294.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项	14.59	-	-	17,000	421,972.84	248,030.00	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	17.08	-	-	7,500	142,820.00	128,100.00	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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	205,650,744.34	93.12
	其中:股票	205,650,744.34	93.12
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	14,888,031.96	6.74
7	其他各项资产	302,275.32	0.14
8	合计	220,841,051.62	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	7,018,221.00	3.19
C	制造业	71,561,266.83	32.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,025,429.00	2.74
E	建筑业	7,332,706.40	3.34
F	批发和零售业	1,515,008.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	4,308,023.00	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,104,179.08	1.41
J	金融业	85,636,190.94	38.95
K	房地产业	9,460,952.00	4.30
L	租赁和商务服务业	2,006,943.84	0.91
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	1,144,703.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	199,113,623.09	90.56

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	3,597,771.26	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	243,319.85	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	786,920.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,486,864.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	341,020.00	0.16
J	金融业	-	-
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	81,226.14	0.04
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	6,537,121.25	2.97

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

7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	312,290	18,293,948.20	8.32
2	600519	贵州茅台	14,400	10,533,024.00	4.79
3	600036	招商银行	295,500	7,813,020.00	3.55
4	000333	美的集团	132,150	6,900,873.00	3.14
5	000651	格力电器	139,600	6,582,140.00	2.99
6	601166	兴业银行	362,000	5,212,800.00	2.37
7	600887	伊利股份	173,700	4,846,230.00	2.20
8	600276	恒瑞医药	63,962	4,845,761.12	2.20
9	600016	民生银行	684,100	4,788,700.00	2.18
10	601328	交通银行	779,600	4,474,904.00	2.04

注:投资者欲了解本报告期末基金指数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网站http://www.byfunds.com的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603288	海天味业	23,400	1,723,176.00	0.78
2	600009	上海机场	26,800	1,486,864.00	0.68
3	000568	泸州老窖	20,200	1,229,372.00	0.56
4	601933	永辉超市	103,000	786,920.00	0.36
5	601360	三六零	11,800	341,020.00	0.16

注:投资者欲了解本报告期末基金积极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网站http://www.byfunds.com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(%)