

宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司

送出日期:2018年8月29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。

基金托管人中国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。

本报告中财务数据未经审计。

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	宝盈新锐混合
基金主代码	001543
交易代码	001543
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月4日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金的份额总额	128,444,976.56份
基金总份额净值	1.00元

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在综合考虑风险收益特征的基础上,在严格控制下行风险的基础上,力争取得超越业绩比较基准的收益,力争长期资产增值。

投资策略 本基金在综合考虑风险收益特征的基础上,运用多种方法进行资产配置,具体由大类资产配置策略、精选投资策略、固定收益类资产投资策略与金融衍生品投资策略等部分组成。

(一) 大类资产配置策略 本基金在综合考虑风险收益特征的基础上,运用多种方法进行资产配置,具体由大类资产配置策略、精选投资策略、固定收益类资产投资策略与金融衍生品投资策略等部分组成。

(二) 精选投资策略 本基金在综合考虑风险收益特征的基础上,运用多种方法进行资产配置,具体由大类资产配置策略、精选投资策略、固定收益类资产投资策略与金融衍生品投资策略等部分组成。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*65%+中债综合指数收益率*35%

风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于货币型基金及货币市场基金,属中高收益/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	中国银行股份有限公司
姓名	张理	王永民
信息披露负责人	张理	王永民
联系电话	0755-83276688	010-66594896
电子邮箱	zhang@byfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-8888-300	95568
传真	0755-83515599	010-66594942

2.4 信息披露方式

基金基本情况报告书的管理人互联网网址: www.byfunds.com

基金半年度报告备置地:基金管理人办公场所,基金托管人住所。

§ 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(2018年1月1日至2018年6月30日)	
本期已实现收益	2,487,827.22	
本期利润	-18,889,177.25	
加权平均基金份额利润	-0.1437	
本期基金份额总额增长率	-10.16%	
报告期(2018年6月30日)		
期末可供分配基金份额利润	0.01944	
期末基金资产净值	156,448,454.44	
期末基金份额总额	1220	

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。

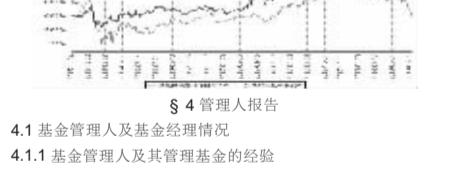
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

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	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率	①-③	②-④
过去一个月	-8.48%	1.72%	-4.90%	0.83%	-3.56%
过去三个月	-5.72%	1.53%	-6.16%	0.74%	0.44%
过去六个月	-10.16%	1.52%	-7.72%	0.75%	-2.44%
过去一年	3.74%	1.36%	-2.25%	0.62%	5.99%
自基金合同生 效至今	22.00%	0.96%	1.18%	0.75%	20.82%

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与其同期业绩比较基准收益率变动的比较



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

本报告期间的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注: 财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内), 投资组合报告等数据真实、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:宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末	2018年6月30日	上年度末	2017年12月31日
货币资产		10,417,091.52	10,190,357.75		
银行存款		152,348.78	476,744.71		
结算备付金		59,553.99	61,935.68		
存出保证金		146,538.20	163,270.00		
交易性金融资产		163,177.00	163,177.00		
其中:股票投资		146,538.20	163,177.00		
基金投资		0.00	0.00		
债券投资		0.00	0.00		
贵金属投资		0.00	0.00		
衍生金融资产		0.00	0.00		
应收证券清算款		307,664.68	267,330.30		
应收利息		2,101.94	2,547.76		
应收股利		0.00	0.00		
应收申购款		67,201.50	1,133,439.66		
应付证券清算款		0.00	0.00		
应付赎回款		157,544.00	175,310.56		
应付交易费用		89,148.44	112,970.20		
应付利息		0.00	0.00		
应付股利		0.00	0.00		
应付申购款		0.00	0.00		
负债合计		1,351,074.69	1,351,074.69		
所有者权益		156,448,454.44	156,448,454.44		
其中:实收基金		128,444,976.56	128,444,976.56		
未分配利润		28,003,778.88	45,996,915.13		
所有者权益合计		156,448,454.44	174,416,454.45		
负债和所有者权益总计		157,799,530.10	175,310.56		

注:1、本基金基金经理非基金经理,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 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

本报告期内,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规定,以诚信为原则,勤勉尽责的原则管理好基金,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 管理人对报告期公平交易情况的专项说明

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、向市场交易价差、向代理价差等作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的向市场交易价差均在合理解释范围内;在本报告期内公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.1 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、向市场交易价差、向代理价差等作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的向市场交易价差均在合理解释范围内;在本报告期内公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 公平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

报告期内,本基金股票仓位整体维持在较高水平,本报告期内净值增长率是-10.16%。本基金采取稳健成长的价值投资策略,行业配置以航空、家电、食品饮料、电子、零售等方向为主。

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1.220元,本报告期基金份额净值增长率是-10.16%。本基金采取稳健成长的价值投资策略,行业配置以航空、家电、食品饮料、电子、零售等方向为主。

4.5 管理人对报告期未持有债券情况的说明

本报告期内,未持有债券。

4.6 管理人对报告期未持有衍生品情况的说明

本报告期内,未持有衍生品。

4.7 管理人对报告期未持有黄金情况的说明

本报告期内,未持有黄金。

4.8 管理人对报告期未持有贵金属情况的说明

本报告期内,未持有