

宝盈消费主题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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29日

1 重要提示
基金管理人、宝盈基金管理有限公司... 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。

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先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

2.1 基金基本情况
基金名称:宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:003715
基金运作方式:契约型开放式

2.2 基金产品说明
基金投资目标:本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司,追求基金资产的长期增值收益。

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
基金年度报告正文的管理人互联网网址:www.byfund.com
基金年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人处

3 主要财务数据和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 自基金转型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的比较

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证消费主题指数收益率\*70%+中证综合债指数收益率\*30%

4 基金管理人及基金托管人
4.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
4.2 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.3 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.4 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.5 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.6 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.7 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.8 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.9 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.10 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.11 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.12 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.13 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.14 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.15 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.16 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.17 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.18 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.19 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.20 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.21 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.22 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.23 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.24 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.25 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.26 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.27 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.28 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.29 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.30 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.31 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.32 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.33 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.34 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.35 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.36 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.37 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.38 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.39 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.40 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.41 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.42 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.43 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.44 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.45 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.46 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.47 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.48 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.49 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.50 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.51 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.52 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.53 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.54 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.55 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.56 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.57 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.58 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.59 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明
4.60 基金管理人及基金托管人符合法律法规要求的说明

4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对于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
2018年上半年,上证指数下跌13.9%,沪深300下跌12.9%,深成指下跌15.04%,中小板指数下跌14.26%,创业板指数下跌8.33%,A股市场呈现普跌趋势。本基金上半年收益率为-10.36%。

本基金属大消费领域投资主题,按照基金契约与法规规定,在本报告期内,重点投资行业限于以医疗健康产业、食品饮料、电商等行业为代表的大消费领域,并基于行业的发展前景分析,投资了部分消费电子产业链上的先进制造企业。

今年以来,消费领域的新动能更多地体现为消费新业态的快速发展,更具体地体现在网购零售额和限额以下企业零售额两方面的变化。今年前5个月网购零售额同比增长30.7%,网购零售额与社零的比值为21.9%,比去年同期提高4.6个百分点。同期,线下零售额同比增速仅为0.5%,比去年同期低7.5个百分点,与此同时,随着消费升级向农村和低收入城市发展,再加上大中城市房价增速的放缓,限额以上单位零售额增速增长乏力,而限额以下单位的零售增速和在社零中的占比在今年明显提升。前五个月,限额以上零售额同比增长7.8%,比去年同期回落0.6个百分点,而限额以下零售额同比增长14%,较去年同期提升2.3个百分点,限额以下零售额在社零中的占比达到63.9%,比去年同期提升了5.2个百分点,达到2013年以来的次高水平。

分析国内外的宏观经济变量以及国内消费领域的增量变量,认为:“消费升级”是大消费领域未来较长一段时间内的投资主题,至2025年我国的居民消费率将从目前的45%上升到60%,从中短期来看,投资的重点在于:医疗健康、食品饮料、纺织服装、电商、宠物经济等为代表的侧重于“内需”的受益于消费升级的行业及企业。

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1.0241元;本报告期基金份额净值增长率为-10.36%,业绩比较基准收益率为-0.87%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的宏观展望
宏观经济层面,2018年上半年,国内外宏观基本面发生了诸多重要变化,对国内经济增长前景和风险偏好均形成显著负面影响:全球经济在去年12月之后连续回落,经济复苏的不确定性加强;全球权益市场大概率迈入下行阶段;美国对中国战略发出防范性挑战,把中国定位为竞争对手和最大威胁;17年12月中央提出要把防范化解金融风险、人民币币制波动加大。在以上因素的共同影响下,上半年,上证指数和“深证综指”跌幅分别达到13.9%和15.04%。其中,中美贸易战以及国内的金融去杠杆是关键变量,将长时期内影响国内资本市场的运行趋势。

证券市场走势方面,虽有以上因素的不利影响,但也应看到当下A股的估值水平不论是横向比较还是纵向比较均处于较低的水平。与此同时,国内金融去杠杆的节奏有所调整,市场紧张的流动性在一定程度上有所缓解。因此认为在下半年,市场的走势应强于上半年。行业选择上,应紧扣以医疗健康、教育为代表的大消费行业以及以大数据、高端制造为代表的引领国家产业升级的新兴产业。

4.6 基金管理人对于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人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员、投资部门(权益投资部、固定收益部)、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验。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序,定期评估估值政策和程序的适用性。日常基金资产的估值程序,由基金运营部负责执行。对于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,由估值委员会认定估值方案,基金运营部具体执行。

截止本报告期末,本基金管理人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,由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等的估值参考价格。

4.7 基金管理人对于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约定。

4.8 报告期内管理人对于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守信守情况声明
在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格按照《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—宝盈基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 基金管理人对于报告期内基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本基金管理人,宝盈基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 基金管理人对于本半年度报告中基金财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为,宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.4 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:宝盈消费主题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 2018年6月30日 2017年12月31日
货币资金 20,989,941.09 77,980,901.50

交易性金融资产 865,570.00 422,980.96
应收利息 160,923.04 207,206.90
其他流动资产 249,534,193.13 268,204,900.69

其中:应收投资款 249,534,193.13 268,478,688.69
基金投资 - -
债券投资 - -
其他流动资产 - 1,742,442.00

流动资产合计 212,484,627.26 347,596,991.05
非流动资产 - -
其中:可供出售金融资产 - -
持有至到期投资 - -
长期股权投资 - -
其他非流动资产 - -

负债合计 722,716.33 313,522.30
其中:应付利息 5,258.16 10,564.00
应付股利 - -
其他应付款 167,606.96 272,064.60

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

所有者权益合计 211,761,910.93 347,283,468.75
其中:实收资本 272,406,188.41 345,476,324.39
未分配利润 - 1,877,140.36

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金
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 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入 -28,384,031.05 -7,149,110.65

1.利息收入 93,923.54 154,637.40
其中:债券利息收入 93,923.54 154,637.40
股利收入 1,284.15 989,657.33

2.公允价值变动收益(损失) 3,919,196.35 -19,068,386.80
其中:公允价值变动收益(损失) 3,919,196.35 -19,068,386.80

3.其他综合收益 68,644.13 901,522.68
其中:其他综合收益 68,644.13 901,522.68

4.其他 3,793,302.71 1,284,629.29
其中:其他 3,793,302.71 1,284,629.29

二、费用 2,261,081.51 1,708,156.29
其中:销售费用 377,346.92 1,284,629.29

三、净利润 2,657,949.54 1,576,513.35
其中:净利润 2,657,949.54 1,576,513.35

四、期初所有者权益(基金净值) 299,431,745.48 40,587,075.22 340,018,820.70

五、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) -32,323,333.76 -32,323,333.76

六、本期公允价值变动损益(净收益/净损失) -32,807,030.23 -3,505,963.75 -36,313,013.98

七、本期其他综合收益(损失) 17,200,807.35 1,719,071.80 18,919,873.15

八、本期利润分配产生的基金净值变动数(本期分配股利、利息) -50,007,831.58 -5,225,055.55 -55,232,887.13

九、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(减少) - - -

十、本期其他项下增加(减少) 266,624,715.25 4,757,757.71 271,382,473.96

十一、期末所有者权益(基金净值) 2,000,000,000.00 19,432,510.69 2,019,432,510.69

十二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) -18,947,428.27 -18,947,428.27

十三、本期公允价值变动损益(净收益/净损失) -1,540,391,995.24 -847,606.96 -1,541,239,602.20

十四、本期其他综合收益(损失) 483,222,233.32 -2,992,250.50 480,229,982.82

十五、本期利润分配产生的基金净值变动数(本期分配股利、利息) -2,023,614,218.58 2,144,643.54 -2,021,469,575.02

十六、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(减少) - - -

十七、本期其他项下增加(减少) 459,608,004.76 -362,524.54 459,245,480.22

十八、期末所有者权益(基金净值) 459,608,004.76 -362,524.54 459,245,480.22

报告附注为财务报表的重要组成部分
本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:
张啸川 丁宇 何

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

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
本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.3 关联方关系
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《关于金融同业往来存款利息免征增值税政策的通知》、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有关增值税政策的通知》以及其他相关财税法规和实务操作,主要税种列示如下:

(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,已缴纳增值税从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2)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。

(3)对基金从证券市场取得的收入,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。

(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)本基金的城镇维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照增值税应纳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 以下统称“宝盈基金” 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司 以下统称“中国农业” 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 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日
当期计提的基金应支付的报酬 2,261,081.51 7,708,159.29

其中:支付销售机构的客户维护费 380,535.40 918,600.41
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1.50%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:日基金资产净值\*前一日基金资产净值\*1.50%/当年天数。
6.4.5.2.2 基金托管费
单位:人民币元
项目 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日
当期计提的基金应支付的报酬 377,346.92 1,284,629.26

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值的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:日基金资产净值\*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
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
份额单位:份
项目 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效以来:2017年1月1日至2018年6月30日
期初持有的基金份额 0 0
期间申购/赎回情况 0 0
期间申购/买入份额 0 0
期间赎回/卖出份额 0 0
期末持有的基金份额 0 0
期间买入/卖出金额(含利息) 0 0
占基金总资产比例 0.00% 0.00%

5,000,000.00份,折算基准日折算比例为0.993916887,折算后基金管理人持有份额为4,969,584.44份。
2.2017年2月21日因确权增加份额4,969,584.44份,无费用。
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 2018年1月1日至2018年6月30日 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
中国农业银行 20,989,941.09 85,595.73 56,713,102.48 1,095,190.96

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同期利率计息。
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 受限证券类别:股票
序号 证券代码 证券名称 认购成功日期 可流通日期 认购数量 期末持仓数量 数量限制原因 期末公允价值 占基金资产净值比例(%) 备注

60286 江苏新能 2018年6月25日 2018年7月1日 900 900 5,384 48,456.00 48,456.00
60376 东方雨虹 2018年6月29日 2018年7月9日 1309 1309 1,765 23,103.85 23,103.85
60310 中科曙光 2018年6月29日 2018年7月9日 483 483 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
本基金本报告期末未持有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
无。
6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。
6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。
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 占基金资产净值比例(%)
1 权益投资 249,534,193.13 91.58
其中:股票 249,534,193.13 91.58

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 其他投资 - -
6 合计 272,466,188.41 100.00