宝盈祥泰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
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	62,853,200.71份
基金合同存续期	不定期

注:根据中国证券监督管理委员会2018年第2号公告《养老目标证券投资基金指引(试行)》的规定,本基金管理人在履行相关程序后,于2018年5月9日发布《关于变更宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金名称并修改基金法律文件的公告》,将"宝盈祥泰养老混合型证券投资基金"基金名称变更为"宝盈祥泰混合型证券投资基金",基金简称相应变更为"宝盈祥泰混合"。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制下行风险的前提下,追求稳定的投资回报,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提下,确定大类资产配置比例,通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益,适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。
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低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中等收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		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	张璟	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-2,572,517.18
本期利润	-2,377,172.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0304
本期基金份额净值增长率	-2.44%
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	0.0386
期末基金资产净值	65,280,163.35
期末基金份额净值	1.039

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	-0.19%	0.14%	0.21%	0.01%	-0.40%	0.13%
过去三个月	-0.29%	0.29%	0.62%	0.01%	-0.91%	0.28%
过去六个月	-2.44%	0.32%	1.24%	0.01%	-3.68%	0.31%
过去一年	-0.86%	0.23%	2.50%	0.01%	-3.36%	0.22%
过去三年	3.90%	0.15%	7.88%	0.01%	-3.98%	0.14%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.15%	8.17%	0.01%	-4.27%	0.14%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高宇	本基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金基金经理;固定收益部副总经理	2017年11月11日	-	10年	高宇先生,厦门大学投资学硕士,2008年6月至2009年8月任职于第一创业证券资产管理部,担任研究员;2009年8月至2010年10月任职于国信证券经济研究所,担任固定收益分析师;2010年10月至2016年6月任职于博时基金,先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理等职位;2016年7月至2017年8月任职于天风证券,担任机构业务总部总经理助理,2017年8月加入宝盈基金管理有限公司,现担任宝盈基金固定收益部副总经理。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

2018年上半年,利率、信用、权益三大类资产表现出现明显分化。社融、基建等数据的显著下行,以及在紧信用环境下市场对民企潜在信用出现了显著担忧,市场风险偏好继续降低,以10年期国开、国债为代表的长端收益率下行明显,但高等级优质公司债券表现一般,中低等级品种几乎无人问津。继1月底权益市场大跌后,3月底的中美贸易摩擦导致4月份权益市场二次调整,亦或因增长数据乏力,加上社融、消费数据超预期下行,加上人民币汇率的大幅波动,转债市场和股票市场在6月份出现了年内第三次明显的下跌。

报告期内,本组合在1月初增加权益仓位,受2月份市场调整影响净值有明显回撤,4、5月份增加医药、消费及新兴产业的权益仓位,并在6月初市场出现大幅调整前显著降低了仓位,部分地保留了前期权益仓位的收益,同时在二季度显著提高了10年期国开品种的仓位。

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1.039元;本报告期基金份额净值增长率为-2.44%,业绩比较基准收益率为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

展望下半年经济,我们认为货币政策会继续保持当前的中性偏松的状态,银行贷款投放可能会有边际上的改善,但财政支出依然受到去杠杆这一更高政策目标的约束。制造业投资稳定,基建投资受资金来源约束继续回落,地产投资可能会因企业加速开工而继续回升,消费及出口大概率会继续下行,因此总体依然维持经济增速逐步放缓的基本判断。工业品通胀3季度大概率会出现小幅反弹,但通胀短期对货币政策仍然不构成约束。

趋势上,我们依然看好长端利率的下行机会,但因年初至今的大幅上涨导致交易获利的情形会增加,短期波动会上升,需要更好把握节奏。信用债收益率整体回升,机会也在逐渐酝酿,下半年宽货币政策既定,信用微调及财政紧中微松可以预期,将利好信用债的中等级债券资产类别。权益及转债市场的方向目前暂未明确,市场波动率较高,整体仓位适度。

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:宝盈祥泰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	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	3,073,822.74	19,804,519.24
结算备付金	141,303.43	159,573.43
存出保证金	46,212.49	6,573.51
交易性金融资产	67,460,360.00	55,622,594.50
其中:股票投资	4,066,700.00	4,908,219.50
基金投资	-	-
债券投资	63,393,660.00	50,714,375.00
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	-	45,000,150.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	580,905.53	1,064,144.16
应收股利	-	-
应收申购款	591.14	1,280.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	1,000.00	1,000.00
资产总计	71,304,195.33	121,659,835.63
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	3,000,000.00	6,000,000.00
应付证券清算款	2,400,182.20	18,000,000.00
应付赎回款	189,033.34	408,809.43
应付管理人报酬	32,536.73	100,165.01
应付托管费	13,556.97	20,867.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	109,852.40	26,599.73
应交税费	350.04	-
应付利息	-	6,460.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	278,520.30	160,055.87
负债合计	6,024,031.98	24,722,958.00
所有者权益:		
实收基金	62,853,200.71	91,056,250.98
未分配利润	2,426,962.64	5,880,626.65
所有者权益合计	65,280,163.35	96,936,877.63
负债和所有者权益总计	71,304,195.33	121,659,835.63

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.039元,基金份额总额62,853,200.71份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈祥泰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	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	-1,258,928.10	4,426,899.99
1.利息收入	1,208,598.83	7,336,922.23
其中:存款利息收入	48,437.34	22,570.19
债券利息收入	943,955.46	6,590,280.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	216,206.03	724,071.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,663,736.07	-5,081,452.48
其中:股票投资收益	-2,484,812.26	-1,716,825.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-266,973.81	-3,366,628.39
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	88,050.00	2,001.16
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	195,344.24	2,026,478.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	864.90	144,951.71
减:二、费用	1,118,244.84	3,406,353.49
1. 管理人报酬	357,038.62	2,022,188.16
2. 托管费	102,142.79	421,289.21
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	333,480.23	61,562.71
5. 利息支出	74,478.20	678,477.98
其中:卖出回购金融资产支出	74,478.20	678,477.98
6. 税金及附加	1,647.47	-
7. 其他费用	249,457.53	222,835.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-2,377,172.94	1,020,546.50
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,377,172.94	1,020,546.50

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈祥泰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	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)	91,056,250.98	5,880,626.65	96,936,877.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,377,172.94	-2,377,172.94
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)	-28,203,050.27	-1,076,491.07	-29,279,541.34
其中:1.基金申购款	514,272.46	29,847.71	544,120.17
2.基金赎回款	-28,717,322.73	-1,106,338.78	-29,823,661.51
四、本期向基金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)	62,853,200.71	2,426,962.64	65,280,163.35
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)	679,877,378.84	28,288,375.67	708,165,754.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,020,546.50	1,020,546.50
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)	-547,191,042.22	-22,882,485.53	-570,073,527.75
其中:1.基金申购款	1,043,983.10	43,576.27	1,087,559.37
2.基金赎回款	-548,235,025.32	-22,926,061.80	-571,161,087.12
四、本期向基金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)	132,686,336.62	6,426,436.64	139,112,773.26

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、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 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	357,038.62	2,022,188.16
其中:支付销售机构的客户维护费	97,978.28	217,320.06

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0.6%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×0.6%/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	102,142.79	421,289.21

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

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	3,073,822.74	39,323.32	706,666.52	16,704.10

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

无。

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

无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,000,000.00元,于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,066,700.00	5.70
	其中:股票	4,066,700.00	5.70
2	固定收益投资	63,393,660.00	88.91
	其中:债券	63,393,660.00	88.91
	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	3,215,126.17	4.51
7	其他各项资产	628,709.16	0.88
8	合计	71,304,195.33	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,645,700.00	4.05
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	659,000.00	1.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	762,000.00	1.17
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	4,066,700.00	6.23

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	001979	招商蛇口	40,000	762,000.00	1.17
2	300088	长信科技	120,000	696,000.00	1.07
3	601233	桐昆股份	40,000	688,800.00	1.06
4	300059	东方财富	50,000	659,000.00	1.01
5	300115	长盈精密	50,000	648,500.00	0.99
6	002508	老板电器	20,000	612,400.00	0.94

注: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	601318	中国平安	6,960,017.00	7.18
2	002508	老板电器	5,705,792.45	5.89
3	600048	保利地产	4,942,528.00	5.10
4	601225	陕西煤业	4,740,857.00	4.89
5	600585	海螺水泥	4,050,577.00	4.18
6	000002	万 科A	3,423,414.88	3.53
7	600298	安琪酵母	3,422,313.49	3.53
8	600036	招商银行	3,340,215.44	3.45
9	002410	广联达	3,064,049.00	3.16
10	000333	美的集团	2,940,338.00	3.03
11	002008	大族激光	2,874,695.00	2.97
12	600196	复星医药	2,671,171.00	2.76
13	600887	伊利股份	2,625,693.02	2.71
14	000651	格力电器	2,563,552.00	2.64
15	001979	招商蛇口	2,495,008.00	2.57
16	000830	鲁西化工	2,232,491.58	2.30
17	601398	工商银行	2,210,748.00	2.28
18	601155	新城控股	2,159,173.63	2.23
19	600340	华夏幸福	2,118,131.00	2.19
20	300059	东方财富	2,031,418.00	2.10

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601318	中国平安	6,542,875.01	6.75
2	600298	安琪酵母	4,742,848.44	4.89
3	002508	老板电器	4,727,859.30	4.88
4	601225	陕西煤业	4,692,228.00	4.84
5	600048	保利地产	4,665,003.00	4.81
6	600196	复星医药	3,908,735.12	4.03
7	600585	海螺水泥	3,860,637.95	3.98
8	000651	格力电器	3,496,895.00	3.61
9	000002	万 科A	3,326,904.00	3.43
10	600036	招商银行	3,298,509.54	3.40
11	002410	广联达	3,087,579.00	3.19
12	600887	伊利股份	3,059,200.00	3.16
13	002008	大族激光	2,823,206.98	2.91
14	603288	海天味业	2,698,608.00	2.78
15	000333	美的集团	2,521,067.00	2.60
16	601155	新城控股	2,326,067.00	2.40
17	600436	片仔癀	2,305,456.00	2.38
18	000830	鲁西化工	2,201,997.00	2.27
19	601398	工商银行	2,116,000.00	2.18
20	600340	华夏幸福	2,069,643.00	2.14

注:1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	109,337,711.69
卖出股票收入(成交)总额	107,671,411.63

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:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,600,360.00	5.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,666,000.00	77.61
	其中:政策性金融债	50,666,000.00	77.61
4	企业债券	3,968,000.00	6.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	5,159,300.00	7.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,393,660.00	97.11

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

金额单位:人民币元

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(%)
1	180406	18农发06	300,000	30,768,000.00	47.13
2	170206	17国开06	200,000	19,898,000.00	30.48
3	122467	15万达02	40,000	3,968,000.00	6.08