

1, 607, 004, 184.4

182, 497, 674.2

85, 243, 082.2

1, 424, 506, 510.19

1, 998, 675, 640.

- 177, 757, 276.54

228, 051, 225.3

1, 820, 918. 363 47

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署,

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

表的组成部分

张啸川

6.4.2.1 会计政策变更的说明

6423 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。 6422 会计估计变更的说明

基金管理人负责人

6.4 报表附注

本期 2018年1月1日至2018年6月30日

955, 097, 652.47

- 150, 992, 153.6

- 100, 574, 029.9

43, 066, 951.0

703, 531, 468.86

945, 186, 034.08

- 18, 028, 193.8

- 77, 894, 215.76

- 99, 258, 857.3

849, 263, 624.44

主管会计工作负责人

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

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

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

个人所得稅政策有关问题的通知》,财稅[2015]101 号《关于上市公司股息紅利差别化个人所得稅政策有关问题的通知》、财稅[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

上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30

2, 562, 101, 836.9

- 150, 992, 153.6

- 283, 071, 704.

128, 310, 0332

2, 128, 037, 979.0

2, 943, 861, 674.0

- 18.028.1938

- 255, 651, 492.3

327, 310, 082,

2, 670, 181, 987.9

会计机构负责

宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

期初所有者权益(基

朝末所有者权益(基

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

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。

基金托管人中国农业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太其全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

基金简称	宝盈科技 30 混合	
基金主代码	000698	
交易代码	000698	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年 8 月 13 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	
报告期末基金份额总额	1, 424, 506, 510.19 💮	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金	产品说明
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置,重点投资于以科学技术创新为动力,在产业竞争中掌握核心竞争化势的科技主题优质上市公司,在产格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期,稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面;首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动志调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股,个券精选, 具体由大资产配置策略,股票投资策略,固定收益类资产投资策略和权证投资策略 四部分组成。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
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

	I HI VIII Y 4 IVILLE		
项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
	姓名	张瓘	贺倩
信息披露负责人	联系电话	0755- 83276688	010- 66060069
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400- 8888- 300	95599
传真		0755- 83515599	010- 68121816
2.4 信息	披露方式		

www.byfunds.com

基金管理人、基金托管

全额单位, 人民币元

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址

83 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

报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
- 43, 810, 958.38
- 150, 992, 153.66
- 0.1022
- 627%
报告期末(2018年6月30日)
- 0.8608
2, 128, 037, 979.05
1.494

(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

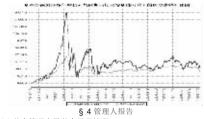
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用.计 人费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	行额伊祖昭 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业頭比较基础 收益率标准差 ④	1)-3)	2-4
过去一个月	- 2.10%	2.12%	- 4.65%	0.83%	2.55%	1.29%
过去三个月	- 6.39%	1.74%	- 6.05%	0.69%	- 0.34%	1.05%
过去六个月	- 6.27%	1.77%	- 6.90%	0.70%	0.63%	1.07%
过去一年	1.91%	1.51%	- 2.54%	0.57%	4.45%	0.94%
过去三年	- 27.79%	2.25%	- 12.09%	0.93%	- 15.70%	1.32%
自基金合同生 效起至今	49.40%	2.21%	35.60%	0.98%	13.80%	1.23%
322	白其全会	同生物以	业 其 全 仏	郷 里 计净4	古	沙及甘与尼

期业绩比较基准收益率变动的比较



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 盈资源优选混合,宝盈核心优势混合 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

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	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		
张仲维	本基金 (京港) (東京) 本) 本 (東京) 東 (東東) 東	2016年 9 月 21 日	-	8年	张仲睢先生,台湾政治大学国际贸易硕士。曾任台湾元大宝朱证 贸易硕士。曾任台湾元大宝朱证 等投资信托级存限公司研究员、基金经理, 6型有限公司研究员、基金经理, 自 2015年5月加入宝童基金管 理有限公司,历任研究部研究员、 投资经理,中自台湾籍、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 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 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

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年上半年市场持续震荡下跌,沪深 300 和创业板指的收益率 分别为 -12.90%、-8.33%。

宏观经济出现了较大变化,主要是两方面,首先是金融去杠杆持续 深化落实,导致了信用债违约频发、上市公司股权质押爆仓等事件;第二 是中美贸易战恶化,影响市场对于成长股的风险偏好,同时人民币汇率 也出现了非常大幅度快速的贬值,导致资金面进一步出现紧缩预期。

行业上涨幅靠前的(以中信一级行业指数为准)分别是餐饮旅游和 医药,分别上涨 10.15%和 4.46%,表现最差的行业为综合和电力设备, 分别下跌 **32.12%**和 **26.99%**。 本基金主要投资科技行业中高增长的公司,报告期内投资组合微幅 调整个股持股比例,主要布局光学行业、半导体、新能源汽车供应链等,

2018年上半年基金下跌 6.27%。 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 1.494 元;本报告期基金份额净 值增长率为 -6.27%,业绩比较基准收益率为 -6.90%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,政府金融去杠杆决心坚定,近期政策的放松将使得去杠 杆时间持续较长,对于高估值却没有业绩的股票,估值压力将持续。中美 对抗持续时间也会比较长,但本基金管理人认为中美对抗也让中国政府

未来将持续大力支持科技行业发展。 投资,是一件反人性的事情,行情总是在绝望中诞生。两个负面因素

(金融去杠杆和贸易战),边际上好转,事件逐渐被市场所消化,目前估值 也是处于比较低的位置,对于行业趋势好且公司业绩增速高的标的,目 前是比较好的投资时间点。

看好以下四个方向:

1. 首先是消费电子行业,我们看好光学行业持续发展,苹果的 3D sensing 加上华为的三摄将再次推动行业持续高速增长。

2.半导体。中美贸易战体现芯片对中国的重要性,中国政府将大力 发展半导体行业,我们看好半导体设备和半导体设计相关的公司。

3.新能源汽车和自动驾驶的长期趋势带来汽车电子化的比例提高, 看好汽车电子部件增加,其中包含电子控制器、摄像头、传感器、电子仪 表板、中控屏等。新能源汽车行业我们重点看好海外电池供应链的公司。

4.网络流量持续增长带来的投资机会。网络流量的持续高增长将带 来相关光通讯厂商投资机会,未来 5G 网络、物联网的建设也将带动天 线. 诵讯 pcb. 射频器件等公司的业绩爆发。

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

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

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 严格遵守《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一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 金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,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 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

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,未发现有损 害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金

资产	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资 / ⁶ :		
银行存款	262, 845, 473.85	182, 553, 766.17
站算备付金	3, 064, 193.20	3, 645, 716.78
存出保证金	796, 957.96	800, 711.6
交易性金融资产	1, 880, 478, 651.84	2, 166, 045, 857.3
其中:股票投资	1, 880, 478, 651.84	2, 166, 045, 857.36
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	-	
买人返售金融资产	7, 990, 124.00	200, 000, 300.00
应收证券清算款	-	19, 327, 723.1
应收利息	57, 690.37	227, 486.12
应收股利	-	
应收申购款	298, 707.76	805, 372.03
递延所得税资产	-	
其他资产	-	
资产总计	2, 155, 531, 798.98	2, 573, 406, 933.2
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	21, 001, 248.00	
立付赎回款	1, 290, 672.94	5, 083, 015.4
应付管理人报酬	2, 602, 905.61	3, 411, 003.5
应付托管费	433, 817.60	568, 500.5
立付销售服务费		
应付交易费用	1, 866, 590.20	2, 042, 045.3
应交税费	-	
应付利息	-	
位付利润	-	
递延所得税负债		
其他负债	298, 585.58	200, 531.3
负债合计	27, 493, 819.93	11, 305, 096.3
所有者权益:		,
实收基金	1, 424, 506, 510.19	1, 607, 004, 184.4
未分配利润	703, 531, 468.86	955, 097, 652.4
所有者权益合计	2, 128, 037, 979.05	2, 562, 101, 836.9
负债和所有者权益总计	2, 155, 531, 798.98	2, 573, 406, 933.2

金份额总额 1.424.506.510.19 份

会计主体,宝盈科技 30 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
項目	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	- 123, 599, 928.14	16, 646, 557.35
1.利息收入	1, 473, 696.22	1, 720, 592.00
其中:存款利息收入	1, 141, 335.71	1, 251, 806.92
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
买人返售金融资产收入	332, 360.51	468, 785.08
其他利息收入		
2.投资收益(损失以"-"填列)	- 18, 380, 501.43	- 660, 950, 765.84
其中:股票投资收益	- 23, 014, 600.38	- 668, 591, 626.86
基金投资收益		
债券投资收益		
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	4, 634, 098.95	7, 640, 861.02
3.公允价值变动收益(损失以"。"号填列)	- 107, 181, 195.28	675, 672, 203.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		
5.其他收入(损失以"-"号填列)	488, 072.35	204, 527.84
诚:二、费用	27, 392, 225.52	34, 674, 751.23
1. 管理人报酬	16, 671, 152.54	20, 369, 122.09
2. 托管费	2, 778, 525.41	3, 394, 853.70
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7, 708, 816.38	10, 677, 608.52
5. 利息支出		
其中:卖出回购金融资产支出		
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	233, 731.19	233, 166.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	- 150, 992, 153.66	- 18, 028, 193.88
减;所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以*。**号填列)	- 150, 992, 153.66	- 18, 028, 193.88

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:宝盈科技 30 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 限售之日起 12 个月内,通过集中竞价交易减持的数量不得超过

关于租人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 , 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 .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

(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 全额计人应纳税所得额,持股期限在1个月以上至1年(含1年)的 暂 减按50%计人应纳税所得额;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。 644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

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

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")	
中国农业银行股份有限公司(以下简称中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
注, 下法关联亦具构在正常证	V 冬菇 国内 按一 奶 商 业 冬き

6.4.5 本提供期及上年度可比期间的关联: 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

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
	当期发生的基金应支付的管 理费	16, 671, 152.54	20, 369, 122.09
	其中:支付销售机构的客户 维护费	8, 292, 364.07	10, 140, 385.42
	注:支付基金管	理人宝盈基金公司的管理	理人报酬按前一日基金资产
2	争值 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:		

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.5%/ 当年天数

6.4.5.2.2 基金托管费

		Thr://///
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	2, 778, 525.41	3, 394, 853.70
注:支付基金托	管人中国农业银行的托管	费按前一日基金资产净值
0.25%的年费率计提	是,逐日累计至每月月底,按	安月支付。其计算公式为:
con Just Auto other white		A to be due on the

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/ 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以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 冬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 本报告期内以及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资 回购及行权等减少的股票

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

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 2017年1月1日至2017年6月30日 2018年1月1日至2018年6月30日

期末余額 当期利息收 262, 845, 473,85 1, 099, 292,7 277, 528, 771 1, 202, 040,3 注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保 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 支持证券投资明细 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

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 全额单位, 人民币元 投资明细

								亚山	РШ:/\V	III
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)	期末成本总額	期末估值总额	备注
30036 4	中文在线	2016年 8月12 日	2018年 8月15 日	非公开 发行流 通受限	46.8 0	6.73	1, 767, 298	33, 067, 967.41	11, 893, 915.54	-
60369 3	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	
60370 6	东 方 环 宇	2018年 6月29 日	2018年 7月9 日	新股流 通受限	13.0 9	13.09	1,765	23, 103.85	23, 103.85	
60310 5	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	
注:1.基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发										
7管理	里办法》	规范的	的非公	开发行	亍股	份,所	认购的	股份自发	行结束之	日末
2 个.	月内不	得转让	L。根扎	居《上市	5公	司股?	东、董监	高减持股份	分的若干规	l É

及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减

持股份实施细则》,本基金持有的上市公司非公开发行股份,自股份解除

其持有该次非公开发行股份数量的 50%;采取大宗交易方式的,在任意 连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外,本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减 持的股份,在受让后6个月内,不得转让所受让的股份

2.本基金持有的流通受限股票"中文在线"(证券代码;300364)包含 非公开发行锁定期内根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 1, 060,718 股 (根据中文在线 2017 年度权益分派实施公告,中文在线以 2017年4月12日的总股本 284,752,577 股为基数,向全体股东每10 股派发现金股利 0.4 元人民币(含税);同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 15 股,除权除息日为 2017 年 8 月 1 日)。

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 6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

木其全木损生期末无银行间市场债券正同购亦具全额 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

647 有肋于理解和分析令计报表需要说明的其他事劢

§ 7 投资组合报告

		金額	单位:人民币:
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1, 880, 478, 651.84	87.2
	其中:股票	1, 880, 478, 651.84	87.24
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	买人返售金融资产	7, 990, 124.00	0.3
	其中:买断式回购的买人返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	265, 909, 667.05	12.34
7	其他各项资产	1, 153, 356.09	0.0
8	合计	2, 155, 531, 798.98	100.0

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业		
В	采矿业		
С	制造业	1, 220, 090, 908.91	57.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71, 559.85	0.00
Е	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
Н	住宿和餐饮业		
1	信息传输、软件和信息技术服务业	468, 741, 245.00	22.03
J	金融业		
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业	35, 150, 000.00	1.65
М	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	0.00
0	居民服务、修理和其他服务业		
Р	教育		
Q	卫生和社会工作	144, 449, 796.40	6.79
R	文化、体育和娱乐业	11, 893, 915.54	0.56
S	综合		
	合计	1, 880, 478, 651.84	88.37

				金额单	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	300567	精测电子	2, 350, 000	187, 060, 000.00	8.79
2	002456	欧菲科技	9, 299, 962	150, 008, 387.06	7.05
3	300059	东方财富	10, 000, 000	131, 800, 000.00	6.19
4	002273	水晶光电	9, 250, 000	119, 047, 500.00	5.59
5	300450	先导智能	3, 576, 180	108, 143, 683.20	5.08
6	300373	扬杰科技	3, 699, 962	105, 818, 913.20	4.97
7	300308	中际旭创	1, 500, 000	90, 060, 000.00	4.23
8	002044	美年健康	3, 819, 814	86, 327, 796.40	4.06
9	300571	平治信息	1, 000, 000	68, 200, 000.00	3.20
10	300671	富满电子	2, 199, 940	64, 348, 245.00	3.02

F宝盈基金管理有限公司 http://www.bvfunds.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 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票

股票代码 股票名称 本期累计买入金额 164, 463, 162,7 002044 90, 746, 268.86 美年健康 002273 89. 067. 070.46 86, 341, 104.28 79, 850, 145,22 精測电 74, 139, 557.32 600887 71 626 626 95 德赛西属 70, 427, 058.98 2.75 002916 66, 396, 399,06 贵州茅 64, 455, 671.62 002456 60, 524, 924,70 56, 318, 051.88 300015 55, 513, 972,76 51, 318, 054.26 300357 51 194 615 93

股及行权等获得的股票。 2、买人金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑

48, 680, 413.93

1.90

20

002410

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 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	000333	美的集团	149, 570, 538.14	5.84
2	600887	伊利股份	103, 378, 566.08	4.03
3	002833	弘亚数控	101, 926, 289.36	3.9
4	601398	工商银行	100, 591, 944.74	3.9
5	002773	康弘药业	98, 224, 716.66	3.8
6	000063	中兴通讯	81, 151, 438.51	3.1
7	601318	中国平安	80, 159, 401.64	3.1
8	300136	信维通信	68, 819, 499.48	2.6
9	002273	水品光电	65, 941, 944.45	2.5
10	002916	深南电路	65, 310, 526.78	2.5
11	600760	中航沈飞	64, 117, 061.03	2.5
12	300308	中际旭创	63, 969, 158.91	2.5
13	600519	贵州茅台	63, 743, 428.06	2.4
14	002624	完美世界	56, 246, 023.51	22
15	002050	三花智控	55, 578, 453.13	2.1
16	603197	保隆科技	55, 451, 959.61	2.1
17	300097	智云股份	54, 687, 334.50	2.1
18	300373	扬杰科技	53, 529, 262.32	2.0
19	300170	汉得信息	51, 585, 005.80	2.0
20	300567	精測电子	48, 374, 440.70	1.8

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 2. 466. 778. 578.87

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

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

本基金本报告期末未持有债券投资 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名

贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证

本基金本报告期末未持有权证 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

本基金本报告期末未持有股指期货 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信 息披露等,本基金暂不参与股指期货交易 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策 本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有国债期货。 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货 7.12 投资组合报告附注

家调查 在本报告编制日前一年内除欧菲科技外未受到公开谴责 外罚

欧菲科技股份有限公司(以下简称"欧菲科技")于 2018 年 1 月收 到《深圳证监局关于对欧菲科技股份有限公司采取监管谈话措施的决 定》, 主要原因是子公司苏州欧菲光科技有限公司在2016年2月3日 与苏州市相城区签订框架性意向协议后未做及时的信息披露。考虑到上 述投资协议的签署及后续投资未对公司的资产、负债、权益和经营成果 产生重要影响,并且上市公司在短期也采取了签订《补充协议》并予以公 告的补救措施,根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条第二项的 规定,监管机构对公司采取了监管谈话的行政监管措施。

欧菲科技股份有限公司(以下简称"公司")于 2018年5月14日收 到深圳证券交易所中小板公司管理部向公司出具的《关于对欧菲科技股 份有限公司 2017 年年报的问询函》。后于 2018 年 6 月 1 日,公司披露 《关于会计差错更正的公告》,称在2017年度报告中,误将控股股东业 绩承诺补偿金额 220.233.953.14 元确认为营业外收入。对应的所得税 影响 33,035,092.97 元确认为所得税费用。本次会计差错更正调减公司 2017年度合并资产负债表未分配利润项目 179,097,645.74元,调增资 本公积项目 187,198,860.17 元,调减盈余公积项目 8,101,214.43 元;调 减公司 2017 年度合并利润表营业外收入、所得税费用、净利润项目分 别为 220.233.953.14 元、33.035.092.97 元、187.198.860.17 元, 净利润 项目调整金额占更正后当年净利润的比例为22.8%。深圳交易所称上述 行为违反了《股票上市规则(2018年修订)》第 1.4 条和第 2.1 条的规 定,因此给予监管关注。

本基金注意到,以上事件是欧菲科技公司在管理细节上的问题,在 事件发生后,欧菲科技也立即启动了签订补充协议的措施,事件本身不 影响公司主营业务的发展。本基金在关注欧菲科技自身业务发展的同 时,也会持续关注公司在公司治理方面的改善,并将公司治理加入到对 该公司的长期价值评估中。

的情况

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。 7.12.3 期末其他各项资产构成

份额单位,份

序号	名称	金額
1	存出保证金	796, 957.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57, 690.3
5	应收申购款	298, 707.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	
9	合计	1, 153, 356.09

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

机构投资者

持有份額 持有份額 74, 313 19, 169.01 6, 585, 897.02 0.46% 1, 417, 920, 613.17 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 3, 787.92 0.00039

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间

公司高级管理人员、基金投资和研究部(人持有本开放式基金 本基金基金经理持有本开放式基金

§ 9 开放式基金份额变动 单位:化 基金合同生效日(2014年8月13日)基金份額总額 1, 291, 529, 429.81 1, 607, 004, 184,44 267, 740, 756,47 1, 424, 506, 510,19

x报告期期末基金份额总额 8 10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变 股告期内本基金管理人重大人事变动情况如下, 根据证盈基金管理有限公司第五届董寿会第五次临时会议决议。同意张新元辞去副总经理职务。该变更 项已按规定印册证券监督管理委员会深测证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备,并发布基金

II人员变更公告。 II内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务自 10.4 基金投资策略的改变 报告期内,本基金管理人的基金投资策略遵循本基金/基金台

报告期内无基金份额持有人大会决议

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 报告期内未发生改聘会计师事务所情态

10.6 管理人 托管人及其高级管理人员受稽查或外罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

成交金額 佣金 当期佣金 846 921 0897 36.31% 1 683 1020 36.31 23.14% 1, 072, 750.13 177, 163, 816.75 23.14% 696, 644, 059,66 634, 852.5 600, 016, 191.43 11.80% 546, 793.42 71, 859, 798.20 1.41% 65, 485.83

注:1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序

(1)实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。 (2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3)经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监 会处罚. (4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作

高度保密的要求。 (5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理 本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为

本基金提供高质量的咨询服务 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与 被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况: (I)租用交易单元情况

本报告期内新租太平洋证券上海、深圳交易单元各1个。 (Ⅱ)退租交易单元情况 本报告期内未退租已有的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

8 11 影响投资者决策的其他重要信息 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过

20%的情况。 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

宝盈基金管理有限公司

2018年8月29日