宝盈鸿利收益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

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	宝盈鸿利收益混合
基金主代码	213001
交易代码	213001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年10月8日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	548,158,318.48份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,为基金投资人谋求长期资本增值收益。
投资策略	本基金主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益: (一)战略资产配置策略 基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标,对不同市场的风险收益状况做出判断,据此调整股票、债券和现金等大类资产的配置比例。 (二)股票投资策略 1.行业资金配置策略。首先由行业分析师估计各行业未来的期望增长速度,以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整,将投总体投资价值被相对低估的行业,根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标,结合经济发展不同阶段对不同行业的影响,决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。 2.公司选择策略。本基金对上市公司投资价值的判断,主要依赖于两方面的基础工作:一是从行业发展趋势、公司核心竞争优势、公司运营管理效率的角度对公司进行定性分析,二是通过选择适当的估值模型对公司的投资价值进行定量测算,在筛选过程中,侧重调公司长期(3-5年)的发展和竞争优势、稳定成长的市场、可持续的主营业务利润、良好的现金流和满意的红利分配政策。在对行业内上市公司进行合理排序的基础上,重点投资于位于行业前列的收益型上市公司,排序所依据的主要指标为红利收益率和增长率调整后的市盈率。 (三)固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。 (四)权证投资策略 本基金还可能运用能达到财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率(全价)×35%	
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

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
信息披露负责人	姓名	张璋	贺倩
	联系电话	0755-83276688	010-66060069
	电子邮箱	zhangj@bfunds.com	tgxxpl@ibchina.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

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	10,079,902.64
本期利润	23,859,666.41
加权平均基金份额本期利润	0.0622
本期基金份额净值增长率	6.76%
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	0.3189
期末基金资产净值	576,221,933.36
期末基金份额净值	1.051

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。

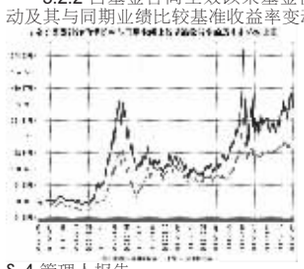
4、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-1.02%	1.80%	-4.90%	0.83%	3.88%	0.97%
过去三个月	-1.82%	1.53%	-6.16%	0.74%	4.34%	0.79%
过去六个月	6.76%	1.54%	-7.72%	0.75%	14.48%	0.79%
过去一年	22.59%	1.33%	-2.25%	0.62%	24.84%	0.71%
过去三年	-8.87%	1.85%	-19.98%	0.99%	11.11%	0.86%
自基金合同生效起至今	397.70%	1.39%	200.38%	1.31%	197.32%	0.08%

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		
李进	本基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年1月4日	-	8年	李进先生,武汉大学金融学专业硕士。2007年7月至2010年2月任职于中国农业银行深圳分行,担任信贷审批员,2010年3月至2013年8月任职于华泰联合证券研究所,担任研究员。自2013年8月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理、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,“离任日期”指公司决定确定的解聘日期;

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,市场整体处于下行趋势。主要原因集中在3个方面:

1、中美贸易战态势恶化,影响市场整体的风险偏好。

2、实体经济持续去杠杆,经济走弱,信用债务违约频发。

3、人民币持续贬值。

2018年上半年基金组合保持中性仓位,在配置方面,在医药、半导体、电动车、军工等板块实现了相对较好的收益率,并适当兑现了部分板块的收益。但是在高端制造、通信、消费电子等行业有较大的负面贡献。

上市公司业绩可持续的成长性一直是本基金投资的重点方向;2018年上半年本基金上涨6.76%。

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1.051元;本报告期基金份额净值增长率为6.76%,业绩比较基准收益率为-7.72%。

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,我们认为贸易战的影响短期内仍将存在;宏观经济短期内难出现拐头向上的局面;随着去杠杆力度的减弱,流动性边际好转。

市场方面,我们判断继续大幅下跌的概率较小,市场可能存在结构性机会。基于当前的时代背景和产业发展趋势,未来组合配置主要集中在医药、新能源、电子、通信、云计算等行业以及其他估值和业绩相匹配的个股。

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

本基金收益分配原则:在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多为12次,每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若基金份额持有人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,报告期内本基金共进行了1次收益分配:

1、本基金管理人已于2018年6月27日发布公告,以2018年6月20日可供分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.47元。

本报告期末宝盈鸿利收益混合可供分配基金份额利润0.3189元,基金份额净值1.051元,符合利润分配条件。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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—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 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)

6.1 资产负债表

会计主体:宝盈鸿利收益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	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	180,499,263.79	61,677,844.30
结算备付金	1,856,601.42	1,747,335.73
存出保证金	402,590.80	484,510.55
交易性金融资产	406,301,486.45	326,800,742.72
其中:股票投资	406,301,486.45	326,800,742.72
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	8,865,055.78
应收利息	43,737.80	15,461.19
应收股利	-	-
应收申购款	319,120.42	63,224.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	589,422,800.68	399,654,174.99
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	11,196,714.00	7,604,608.75
应付赎回款	263,518.17	516,692.38
应付管理人报酬	636,414.75	499,411.99
应付托管费	106,069.12	83,235.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	718,699.05	1,048,985.86
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	279,452.23	160,990.73
负债合计	13,200,867.32	9,913,925.04
所有者权益:		
实收基金	401,405,755.15	277,025,185.48
未分配利润	174,816,178.21	112,715,064.47
所有者权益合计	576,221,933.36	389,740,249.95
负债和所有者权益总计	589,422,800.68	399,654,174.99

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.051元,基金份额总额548,158,318.48份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈鸿利收益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	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	30,238,897.73	19,206,830.58
1.利息收入	331,787.64	314,584.23
其中:存款利息收入	331,787.64	314,584.23
债券利息收入	-	-
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)	15,973,145.63	-28,413,982.86
其中:股票投资收益	15,059,678.15	-29,755,649.02
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	913,467.48	1,341,666.16
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	13,779,763.77	47,256,647.97
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	154,200.69	49,581.24
减:二、费用	6,379,231.32	6,251,389.87
1.管理人报酬	3,039,010.74	2,636,947.48
2.托管费	506,501.75	439,491.22
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,639,232.16	2,971,566.82
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	194,486.67	203,384.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	23,859,666.41	12,955,440.71
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	23,859,666.41	12,955,440.71

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈鸿利收益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	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)	277,025,185.48	112,715,064.47	389,740,249.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,859,666.41	23,859,666.41
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)	124,380,569.67	63,533,541.98	187,914,111.65
其中:1.基金申购款	188,264,531.35	93,407,340.61	281,671,871.96
2.基金赎回款	-63,883,961.68	-29,873,798.63	-93,757,760.31
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)	-	-25,292,094.65	-25,292,094.65
五、期末所有者权益(基金净值)	401,405,755.15	174,816,178.21	576,221,933.36

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)	300,965,576.27	54,504,074.18	355,469,650.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,955,440.71	12,955,440.71
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)	-11,085,005.91	-2,196,512.38	-13,281,518.29
其中:1.基金申购款	20,481,411.75	4,148,913.52	24,630,325.27
2.基金赎回款	-31,566,417.66	-6,345,425.90	-37,911,843.56
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)	289,880,570.36	65,263,002.51	355,143,572.87

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
中国农行银行股份有限公司(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	3,039,010.74	2,636,947.48
其中:支付销售机构的客户维护费	573,201.88	540,006.73

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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷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	506,501.75	439,491.22

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
中国农业银行	180,499,263.79	311,547.98	85,823,798.22	299,460.42

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

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	406,301,486.45	68.93
	其中:股票	406,301,486.45	68.93
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	182,355,865.21	30.94
7	其他各项资产	765,449.02	0.13
8	合计	589,422,800.68	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	397,029,534.95	68.90
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	9,271,951.50	1.61
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	-	-
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	406,301,486.45	70.51

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	300567	精测电子	706,186	56,212,405.60	9.76
2	300601	康泰生物	837,143	51,944,723.15	9.01
3	300122	智飞生物	735,963	33,662,947.62	5.84
4	300450	先导智能	995,755	30,111,631.20	5.23
5	603659	璞泰来	470,000	30,028,300.00	5.21
6	300607	拓斯达	484,580	29,132,949.60	5.06
7	300308	中际旭创	414,000	24,856,560.00	4.31
8	002456	欧菲科技	1,523,600	24,575,668.00	4.26
9	300357	我武生物	448,401	17,877,747.87	3.10
10	300037	新宙邦	630,000	16,877,700.00	2.93

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	002456	欧菲科技	47,297,862.22	12.14
2	300450	先导智能	39,395,318.21	10.11
3	300373	扬杰科技	36,103,481.93	9.26
4	300601	康泰生物	32,121,177.96	8.24
5	300122	智飞生物	28,788,014.08	7.39
6	603659	璞泰来	28,003,151.02	7.19
7	600760	中航沈飞	27,261,534.00	6.99
8	300607	拓斯达	26,661,261.46	6.84
9	300567	精测电子	26,512,655.96	6.80
10	300308	中际旭创	22,846,510.66	5.86
11	002202	金风科技	22,805,508.53	5.85
12	600183	生益科技	19,816,444.00	5.08
13	601398	工商银行	18,924,578.00	4.86
14	600216	浙江医药	18,270,610.30	4.69
15	002273	水晶光电	18,101,098.66	4.64
16	002920	德赛西威	17,415,574.75	4.47
17	601636	旗滨集团	16,506,709.00	4.24
18	300357	我武生物	16,265,647.85	4.17
19	601688	华泰证券	16,208,471.00	4.16
20	600352	浙江龙盛	15,937,316.90	4.09
21	300568	星源材质	15,749,307.37	4.04
22	300037	新宙邦	15,209,833.00	3.90
23	300408	三环集团	14,942,571.64	3.83
24	603626	科森科技	14,788,118.51	3.79
25	600967	内蒙一机	14,758,622.56	3.79
26	002916	深南电路	14,417,104.00	3.70
27	002677	浙江美大	14,127,487.54	3.62
28	601012	隆基股份	13,821,375.67	3.55
29	002179	中航光电	13,653,947.60	3.50
30	300296	利亚德	13,259,597.00	3.40
31	002439	启明星辰	13,070,788.73	3.35
32	600271	航天信息	12,889,224.00	3.31
33	600584	长电科技	12,398,612.00	3.18
34	300059	东方财富	11,564,730.00	2.97
35	603595	东尼电子	11,413,963.40	2.93
36	601318	中国平安	10,901,164.00	2.80
37	000960	锡业股份	10,898,289.42	2.80
38	300604	长川科技	10,213,767.10	2.62
39	600999	招商证券	10,202,930.00	2.62
40	000661	长春高新	10,113,733.50	2.59
41	300476	胜宏科技	9,674,378.60	2.48
42	000672	上峰水泥	9,649,651.00	2.48
43	002343	慈文传媒	9,625,599.40	2.47
44	002008	大族激光	8,357,305.35	2.14
45	603799	华友钴业	8,294,236.00	2.13

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	300373	扬杰科技	54,558,965.69	14.00
2	601398	工商银行	31,937,378.10	8.19
3	600585	海螺水泥