

## 宝盈祥瑞混合型证券投资基金

基金管理人: 宝盈基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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。

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。

## 《2 基金简介

基金简称	宝盈祥瑞混合	
基金主代码	000639	
交易代码	000639	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月21日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	40,288,626.85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《关于变更宝盈祥瑞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"宝盈祥瑞养老混合型证券投资 基金"基金名称变更为"宝盈祥瑞混合型证券投资基金",基金简称相 应变更为"宝盈祥瑞混合"。

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	本基金果取能量的/PB/查爾縣。在中期下下风险的的原程下。而定大學 实产配置证例,通过增身。货币市场工具等的定处截盖费产价会获 取稳定收益。通度参与规则等权益债劳产的投资物间积。本基金 PB/查尔斯特别,是一个企业的企业。 PB/查尔斯特别,是一个企业的企业。 PB/查尔斯特别,是一个企业的企业。 PB/查尔斯特别,是一个企业的企业。 和关键,是一个企业的企业。 (二)届定收益债劳产投资额。可转换债券的投资额。 (二)届定收益债劳产投资额。 在进行的现实总债劳产投资额。 第一个企业分子依然的一个企业。 第一个企业分子依然的一个企业。 中心之一个企业分子依然的一个企业。 中心之一个一个企业。 本基金的企业。 中心之一个一个企业。 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个
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,其預期收益及預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。

名称		宝盈基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
	姓名	张瑾	张燕
信息披露负责	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201

基金管理人、基金托管人 《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 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-2,184,287.67
本期利润	-2,020,421.94
加权平均基金份額本期利润	-0.0289
本期基金份额净值增长率	-281%
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額利润	0.2361
期末基金资产净值	50,172,359.65
期末基金份额净值	1.245

(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

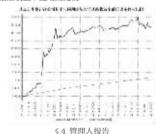
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计

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

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	-0.56%	0.11%	0.21%	0.01%	-0.77%	0.109
过去三个月	-0.80%	0.31%	0.63%	0.01%	-1.43%	0.309
过去六个月	-2.81%	0.33%	1.25%	0.01%	-4.06%	0.329
过去一年	-0.48%	0.25%	2.53%	0.01%	-3.01%	0.249
过去三年	4.01%	0.20%	8.48%	0.01%	-4.47%	0.199
自基金合同 生效起至今	49.33%	0.31%	13.27%	0.01%	36.06%	0.309

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

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 金经理 理)	里(助	证券从业年限	说明
		任职 日期	离任 日期	那址略	
高宇	本基金、宝盈资金。 实是投强处理。 本市场宝强证品增强。 实验是现实证品增强。 实验是是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。	2017 年 11 月 11 日	-	10年	高学先生,原门大学投资学和上,2000年 自月至2000年8月年前青年 向似业连 资产管理器,担任研究员,2000年8月至 2010年10月任用于国信证券参约。 所,担任规定收益分析第,2010年10月任 国定收益总部研究员,基金登到物理。基 证实金总部研究员,基金登到物理。基 任事于天从证券,担任机会会总部 经理助理。2017年8月加入宝备基金管 建期为服。2017年8月加入宝备基金管 建销保险等。担任任金基金周密收益 证明总经理,中国国籍。证券投资基金从 业人负责格。

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

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1.245元;本报告期基金份额净 值增长率为-2.81%、业绩比较基准收益率为1.25%。

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

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

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

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公

司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民 共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽 责地履行了应尽的义务。 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 木招告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分

配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何 损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投 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

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投 资组合报告等内容直实、准确和完整,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: 宝盈祥瑞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
资产:		
<b>長行存款</b>	4,679,323.92	2,296,767.53
吉算备付金	181,823.11	203,277.94
存出保证金	53,690.58	28,383.64
交易性金融资产	38,227,538.80	82,508,802.20
其中:股票投资	398,060.00	3,023,570.00
基金投资	-	-
责券投资	37,829,478.80	79,485,232.20
资产支持证券投资	-	
<b>贵金属投资</b>	-	
衍生金融资产	-	
买入返售金融资产	-	20,000,000.00
应收证券清算款	_	35,210.96
应收利息	363,078.21	1,206,421.20
应收股利	_	_
应收申购款	10,011,205.89	2,193.9
<b>並延所得税资产</b>	_	-
其他资产	_	
资产总计	53,516,660.51	106,281,057.38
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
5 债:		
豆期借款	_	
交易性金融负债	_	
行生金融负债	_	-
卖出回购金融资产款	_	
应付证券清算款	2,804,220.87	
应付赎回款	165,374.41	166,799.08
应付管理人报酬	20,753.33	92,057.60
应付托管费	6,917.78	18,411.53
应付销售服务费	_	
位付交易费用	117,888.75	48,768.17
☆交税费	164.44	
位付利息	_	
应付利润	_	
递延所得税负债	_	
其他负债	228,981.28	160,016.83
为债合计	3,344,300.86	486,053.2
所有者权益:	0,011,00000	100,00020
实收基金	40,288,626.85	82,599,490.54
<del>大</del> 公配利润	9,883,732.80	23,195,513.59
所有者权益合计	50,172,359.65	105,795,004.13
5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5. 5	53,516,660,51	106,281,057.38

40 288 626.85份。

6.2 利润表

今十十分, 空及光理洞众刑证老机次甘众

		单位:人民
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	-1,011,872.56	9,668,909.1
1.利息收入	1,194,914.51	10,495,586.17
其中:存款利息收入	59,628.05	41,446.0
债券利息收入	958,328.57	9,530,900.3
资产支持证券利息收入	-	
买人返售金融资产收人	176,957.89	923,239.7
其他利息收入	-	
2.投资收益( 损失以 "-" 填列)	-2,377,794.38	-4,765,574.8
其中:股票投资收益	-2,293,817.68	969,593.5
基金投资收益	-	
债券投资收益	-190,040.13	-5,846,063.4
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	106,063.43	110,895.0
<ol> <li>公允价值变动收益(损失以 "-"号填列)</li> </ol>	163,865.73	3,823,171.4
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	=	
5.其他收入( 损失以 "-" 号填列)	7,141.58	115,726.4
减:二、费用	1,008,549.38	4,488,795.8
1. 管理人报酬	346,181.53	2,281,1225
2. 托管费	88,256.70	456,224.4
3. 销售服务费	-	
4. 交易费用	360,295.37	373,724.2
5. 利息支出	15,548.36	1,191,583.5
其中:卖出回购金融资产支出	15,548.36	1,191,583.5
6. 税金及附加	1,701.90	
7. 其他费用	196,565.52	186,141.1
三、利润总额(亏损总额以"-" 号填列)	-2,020,421.94	5,180,113.2
减:所得税费用	-	
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,020,421.94	5,180,113.2

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 宝盈祥瑞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

项目	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)	82,599,490.54	23,195,513.59	105,795,004.13
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	-2,020,421.94	-2,020,421.94
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)	-42,310,863.69	-11,291,358.85	-53,602,222.54
其中:1.基金申购款	9,700,917.55	2,417,264.46	12,118,182.01
2.基金赎回款	-52,011,781.24	-13,708,623.31	-65,720,404.58
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)	40,288,626.85	9,883,732.80	50,172,359.68
项目			
	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)	616,152,411.25	143,221,892.92	759,374,304.17
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	5,180,113.28	5,180,113.28
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)	-444,583,339.52	-105,258,324.64	-549,841,664.16
其中:1.基金申购款	3,819,482.50	905,530.52	4,725,013.02
2.基金赎回款	-448,402,822.02	-106,163,855.16	-554,566,677.18
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)			

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署: 张 啸 川 何瑜

基金管理人负责人 主管会计工作负责人

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

木基全木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

其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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《关于租人固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及

(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

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 人,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

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

(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, 新减按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

(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

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

1全管理人 注册登记机构 基金销售机构 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 本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行

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

2,281,122 注:根据相关法律法规的规定,并经与基金托管人协商一致,基金管

理人修改了《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈祥 瑞养老混合型证券投资基金托管协议》,并将基金管理费率调整为 0.60%, 修改后的文件自2018年3月14日起生效。 因此,2018年3月14日前,支付基金管理人宝盈基金管理有限公司 的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%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×1.00% - 当年天数 自2018年3月14日起(含2018年3月14日),支付基金管理人宝盈基 卖成 金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%-当年天数 6.4.5.2.2 基金托管费

注:支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值

费率计提,该日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

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×0.2%÷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

	201		は期 至2018年6月	30日		
银行间市场交	债券交易会	金額	基金逆回购		基金正回购	
易的 各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收人	交易金額	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
	201		可比期间 至2017年6月	]30日		
银行间市场交 债券交易金额		基金)	逆回购	基金	正回购	
易的 各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
招商银行	19,679,722.85	-	-	-	-	-

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

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

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

8年6月30日 期末余額

## 2018年半年度报告摘要

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利 率计息。

6.45.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

单位:人民币元

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

6462 期末持有的新时停牕等流通受限股票

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

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

《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	398,060.00	0.74
	其中:股票	398,060.00	0.74
2	固定收益投资	37,829,478.80	70.69
	其中:债券	37,829,478.80	70.69
	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	-	_
	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	4,861,147.03	9.08
7	其他各项资产	10,427,974.68	19.49
8	合计	53,516,660.51	100.00

马 行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
农、林、牧、渔业	-	-
采矿业	-	-
制造业	398,060.00	0.79
电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	-
建筑业	-	-
批发和零售业	-	-
交通运输、仓储和邮政业	-	-
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服 务业	-	-
金融业	-	_
房地产业	-	-
租赁和商务服务业	-	_
科学研究和技术服务业	-	-
水利、环境和公共设施管理业	-	-
居民服务、修理和其他服务业	-	-
教育	-	-
卫生和社会工作	-	-
文化、体育和娱乐业	-	-
综合	-	_
合计	398,060.00	0.79

投资明细 金额单位:人民币元

1	002000	45/1X 45/167	13,000	398,000.00	0.79
7.4	报告期内	内股票投	资组合的重	大变动	,
7.4.1	累计买	<b>?</b> 人金额	超出期初基金	金资产净值2%或	就前20名的股票
				金	额单位:人民口
序号	股票代码	股票名	称 本	胡累计买人金额	占期初基金资产净 值比例(%)
1	002508	老板电器		6,155,541.37	5.82
2	601318	中国平安		6,118,209.00	5.78
3	000651	格力电器		5,690,752.00	5.38
4	600585	海螺水泥		5,038,484.00	4.76
5	601225	陕西煤业		4,230,041.00	4.00

注:表中"本期累计买入金额"指买入成交金额,即成交单价乘以成 交数量,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

金额单位:人民币元 大族激光 3,363,563 3,141,68 五粮液 2,543,220

注:表中"本期累计卖出金额"指卖出成交金额,即成交单价乘以成 交数量,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

	注:	买人股票成本(成交	) 总额、卖出股票收	人(成交)总额,均挂	安买
į	艾交金	额(成交单价乘以)	成交数量)填列,不表	#虑相关交易费用。	
	7.5	期末按债券品种分割	类的债券投资组合		
				金额单位:人民市	5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	2,800,280.00	5.58	
	2	央行票据	-		
	3	金融债券	30,461,000.00	60.71	
		其中:政策性金融债	30,461,000.00	60.71	
	4	企业债券	1,778,498.80	3.54	
	-	Authoritativity de			I

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	200,000	20,512,000.00	40.88
2	170206	17国开06	100,000	9,949,000.00	19.83
3	019571	17国债17	28,000	2,800,280.00	5.58
4	132004	15国盛EB	30,000	2,789,700.00	5.56
5	122446	15万达01	17,860	1,778,498.80	3.54

支持证券投资明细 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 单位:人民币元 投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

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投资股指期货。 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。

本基金本报告期末未持有投资国债期货。

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

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 案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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

7123 期末其他各项资产构成

/.12	**************************************	
		单位:人民
序号	名称	金額
1	存出保证金	53,690.58
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	-
4	应收利息	363,078.21
5	应收申购款	10,011,205.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,427,974.68
7.12	.4 期末持有的处于转股期的	的可转换债券明细
		金额单位:人民币元
		上其今资立为值

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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 的情况

《9 开放式基金份额变动

本公司高级管理人员、基金投资和 部门负责人持有本开放式基金

本报告期期末基金份额总额 § 10 重大事件揭示

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、基金托管业务的诉

报告期内,本基金管理人的基金投资策略遵循本基金(基金合同)中规定的投资策略,未发生设蓄改变。

10.7 基全租田证券公司交易单元的有关情况

10.4 基金投资策略的改变

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选 择标准为:

(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

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。

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、席位变更情况

(1)租用交易单元情况

会处罚。

单位:人民币元

本基金本报告期内无退租交易单元。

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

券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金額	占当期权 证 成交总额 的比例
光大证券	202,882, 147.00	100.00%	868,700, 000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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

投資		IFF	INOU				
者类别	序号	持有基金份額比例 达到或者超过20% 的时间区间	期初 份额	申购 份額	赎回 份额	持有份 额	份额占 比
机构	1	20180101-20180 530	40,614, 312.65	-	40,614, 312.65	0.00	0.009
	•	•	产品特有风	(险			•
		期内存在单一投资者 性等风险,敬请投资/		例达到	或超过20%的信	紀,在极	端情况

宝盈基金管理有限公司 2018年8月29日

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12 投资组合报告附注

7.12.2

份额单位:份

单位:份

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

其今經期人	所有从业人员		2,006,633	144	4.9806%
IJ	ŧII	持有份额总统	数(份)	占基金总份	额比例
8.2 期末	基金管理。	人的从业人员:	持有本基	金的情况	
1,505	26,769.85	8,044,247.79	19.97%	32,244,379.06	80.03%
		持有份額	比例	持有份额	额比例

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处

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

(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

(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

本报告期内新租东北证券上海、深圳交易单元各一个。 (2)退租交易单元情况

金额单位:人民币元 权证交易

《11 影响投资者决策的其他重要信息

报告期末持有基金 报告期内持有基金份额变化情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息