

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
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	39
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投资明细	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40

§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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动	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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%的情况	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈核心优势混合	
基金主代码	213006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 3 月 17 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,115,012,531.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
下属分级基金的交易代码:	213006	000241
报告期末下属分级基金的份额总额	1,098,896,693.70 份	16,115,837.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期，本基金根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业，建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上，对于景气度提高的行业给予适当倾斜，以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。 2、股票投资策略 根据公司的基本面情况，根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业，建立股票池。本基金在构建投资组合时，强调两端投资，价值与成长性能平衡，兼顾价值与成长型股票，以均衡资产混合策略建立动力资产组合，努力克服单一风格投资所带来的局限性，这样可以较好控制组合市场适应性，一定程度上能够排除对景气误判概率，以求多空环境中都能创造主动管理回报。 3、债券投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略，运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数×65%+上证国债指数×35%

风险收益特征	本基金是一只灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险预算范围内追求收益最大化。
--------	--

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	95566
传真	0755-83515599	010-66594942
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518034	100818
法定代表人	李文众	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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	基金管理人办公场所、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

§ 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

基金级别	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
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)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-17,427,709.08	-355,855.69
本期利润	-91,028,009.69	-1,409,473.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0812	-0.0866
本期加权平均净值利润率	-8.20%	-9.00%
本期基金份额净值增长率	-8.65%	-9.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-119,420,562.47	-1,879,287.56
期末可供分配基金份额利润	-0.1087	-0.1166
期末基金资产净值	979,476,131.23	14,236,549.75

期末基金份额净值	0.8913	0.8834
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	114.49%	68.37%

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

宝盈核心优势混合 A

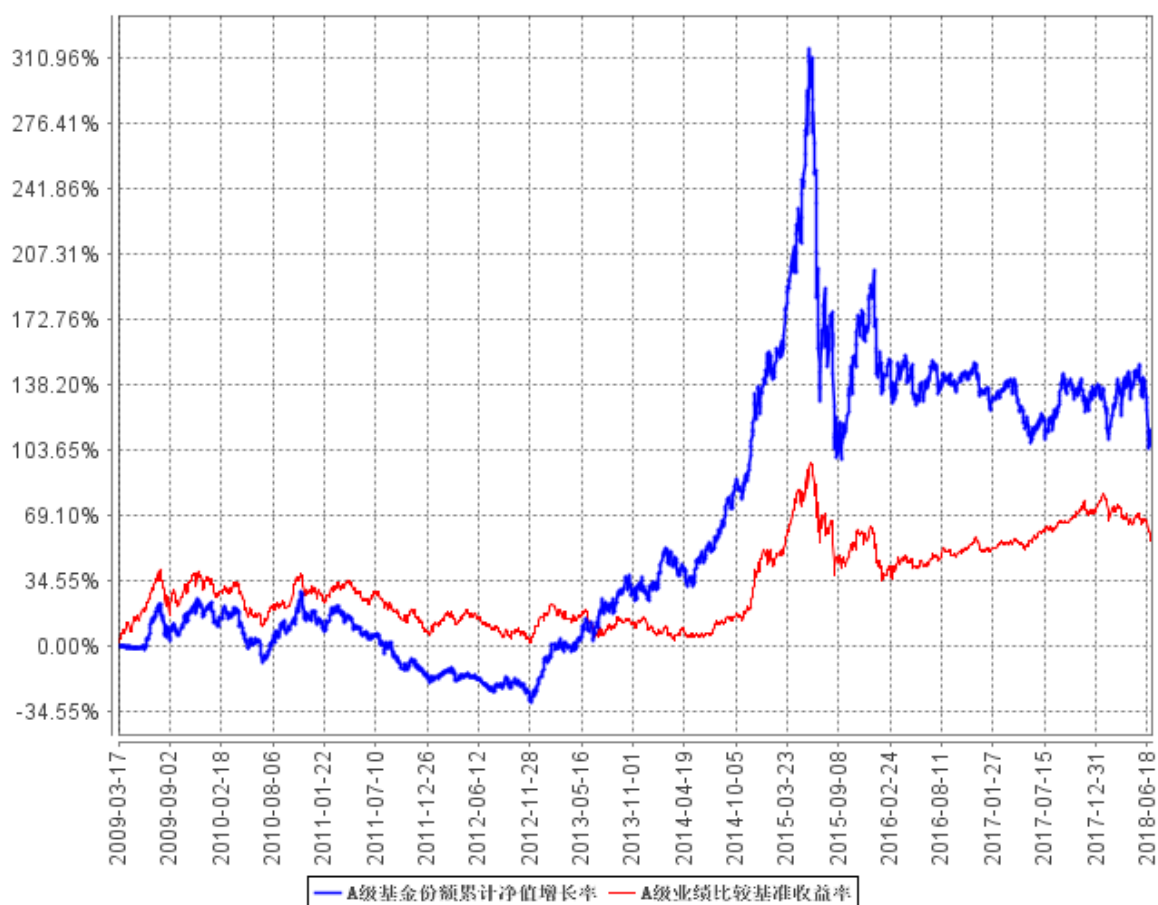
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-9.13%	2.19%	-4.86%	0.83%	-4.27%	1.36%
过去三个月	-10.51%	1.73%	-6.00%	0.74%	-4.51%	0.99%
过去六个月	-8.65%	1.62%	-7.51%	0.75%	-1.14%	0.87%
过去一年	-2.32%	1.35%	-1.47%	0.62%	-0.85%	0.73%
过去三年	-28.56%	1.63%	-9.81%	0.97%	-18.75%	0.66%
自基金合同生效起至今	114.49%	1.44%	58.65%	0.99%	55.84%	0.45%

宝盈核心优势混合 C

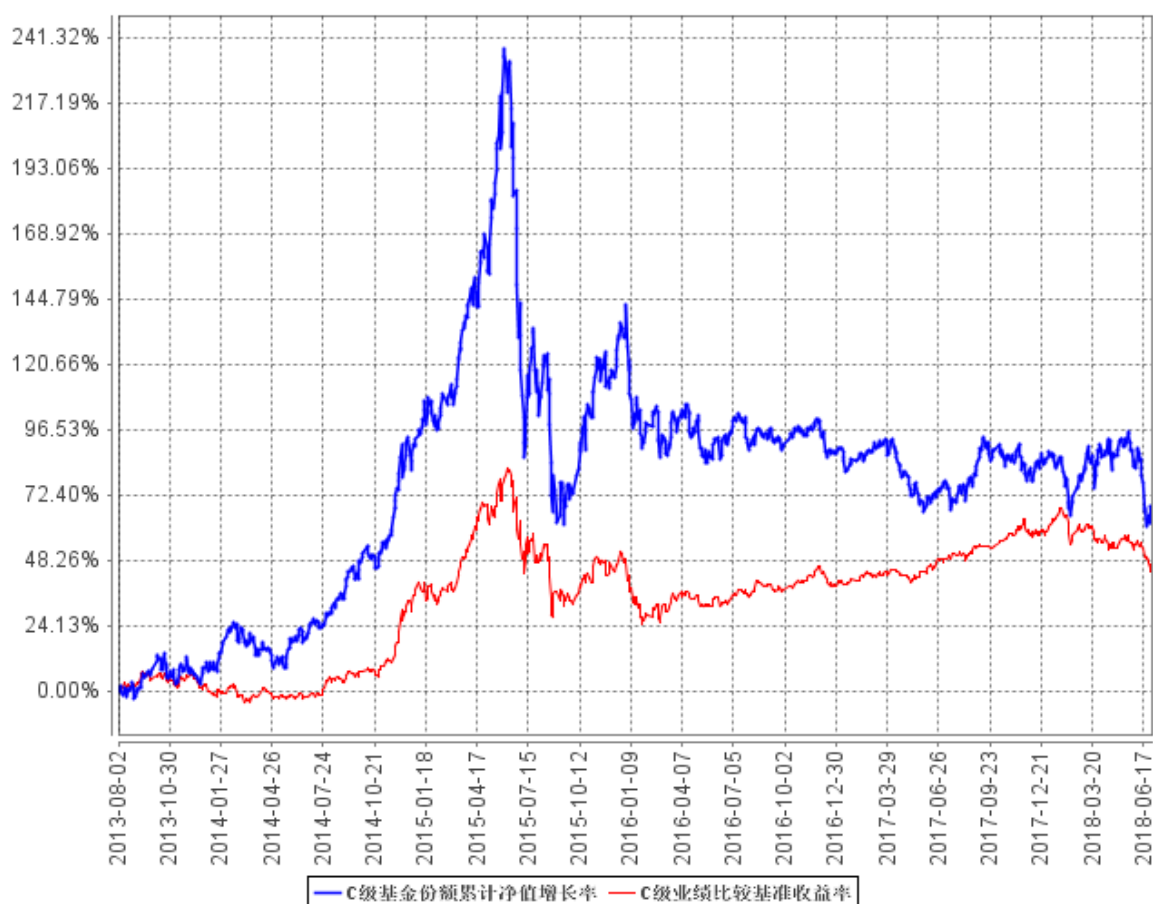
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-9.22%	2.19%	-4.86%	0.83%	-4.36%	1.36%
过去三个月	-10.84%	1.73%	-6.00%	0.74%	-4.84%	0.99%
过去六个月	-9.33%	1.62%	-7.51%	0.75%	-1.82%	0.87%
过去一年	-3.78%	1.35%	-1.47%	0.62%	-2.31%	0.73%
过去三年	-30.77%	1.63%	-9.81%	0.97%	-20.96%	0.66%
自基金合同生效起至今	68.37%	1.64%	46.92%	0.98%	21.45%	0.66%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
李健伟	本基金基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	7 年	李健伟先生，华南理工大学工学硕士。2007 年 8 月至 2010 年 4 月，在普华永道咨询有限公司任职高级顾问。2010 年 4 月至 2012 年 12 月，在广发证券股份有限公司任职稽核员、行业研究员。2012 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，先后任职研究部研究员、专户投资部投资经理、宝盈先进制造灵活配置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；

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合规守信情况的说明

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

本基金 2017 年的年报中，基金管理人认为：2018 年是十九大报告之后新开局第一年。投资主线呈现为新经济领域（计算机、通信、电子、医药等）科技创新，释放人口红利、工程师红利、教育红利从而实现技术赶超，核心科技、制造强国是 2018 年的核心投资主线。因此在基金配置中加大了对科技股和成长股的配置。贸易战和金融去杠杆的政策在二季度对科技股的投资逻辑短期有所破坏，贸易摩擦升级和流动性收紧的担忧显著降低了市场风险偏好。但我们认为中国对新经济、科技创新的发展战略不会改变。同时，本基金也适时加大对消费品的配置，以契合我国目前扩大内需的战略方向。

2018 年上半年宝盈核心优势混合 A 份额净值下跌 8.65%，宝盈核心优势混合 C 份额净值下跌 9.33%，同期沪深 300 涨跌幅为-12.89%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈核心优势混合 A 基金份额净值为 0.8913 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.65%；截至本报告期末宝盈核心优势混合 C 基金份额净值为 0.8834 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.33%；同期业绩比较基准收益率为-7.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

资本市场是多周期因素共同作用结果，核心驱动因素包括流动性周期、政策周期、经济周期和产业周期等。基于该分析框架，我们回顾审视 2018 年上半年市场脉络，并对 2018 年下半年进行展望。

流动性周期。2018 年上半年国内外经济形势面临着复杂严峻的态势，出现了两次比较明显的转向。2014 年以来，我国沿着财政去杠杆的总体路径，严格地约束和限制地方通过融资平台等的举债行为，督促国有企业降低负债率，出现了总需求减速、利率下降、汇率贬值等一系列变化。但在 2018 上半年伴随严监管政策实施，金融条件收紧，利率上升，经济转向金融去杠杆的调整路径，从而带来社会融资增速下降，信贷市场利率上升，民营企业和低评级平台的利率水平大幅度上升。引发了权益市场企业盈利下行和流动性收紧的戴维斯双杀。贸易战爆发后，经济下行、实体违约以及金融风险压力较大，严格的去杠杆政策已经不具备强力推进的大环境。人行货币政策委员会 2018 年第二季度将流动性定调从“保持流动性合理稳定”变为“保持流动性合理充裕”。7 月 23 日国常会提出宽货币稳信用放财政，释放进一步宽松的信号，货币边际宽松得到反复确认，金

融去杠杆的力度和节奏出现缓和。

政策周期。十九大后两会结束，从做减法到做加法，中央经济工作会议将供给侧改革工作重点转向推动高质量发展。2017 年，将主动防范化解系统性金融风险放在更加重要的位置。但随着贸易战爆发，对外关系尤其是对美关系成为主导政策走向的核心考量，外部挑战倒逼国内政策趋于稳健，减税降费刺激消费叠加科技创新自主可控成为核心要素。从权益市场监管态度而言，主流媒体不断吹风看多 A 股，年初药明康德、工业富联、宁德时代独角兽闪电上市，在 A 股市场低迷的背景下显著放缓，监管政策对权益市场也相对友好。

经济周期。国内经济的趋势向下，积极的财政政策和融资环境改善形成一定对冲。6、7 两月制造业 PMI 连续下跌，7 月制造业 PMI 跌到年内均值以下，这说明短期内国内经济下行压力持续上升，贸易战和去杠杆对经济的负面冲击体现得更加清晰，但是绝对水平并不算差，制造业 PMI 连续 5 个月稳定在 51%以上。积极的财政政策和融资环境的改善可以一定程度上对冲经济失速压力。7 月 23 日的国常会提出财政更加积极的两大举措，一个是“聚焦减税降费”，一个是“加快今年 1.35 万亿元地方政府专项债券发行和使用进度”，下半年财政有望大发力，结合去年未使用的限额，下半年地方政府专项债发行额可达 1.2 万亿，同时会议明确指出“在推动在建基础设施项目上早见成效”，下半年拉动经济“三驾马车”之一的基建有望发力。但贸易战仍然是最大的黑天鹅，未来不排除贸易摩擦深度发酵引发的经济大幅下行风险。

产业周期。在新格局和新经济下，政策方向已经转向补短板，孕育新动能，扶持创新，鼓励支持新经济将是政策基调和主线。在中兴事件和贸易战背景下，尤其能让我们深刻理解，科技自主创新而非房地产基建是中国未来的国运所在，消费和科技乃是新格局下新经济的大方向。未来两到三年产业景气周期向上的行业，我们看好科技创新背景下的先进制造、信息产业，以及减税降费背景下的消费，教育，医疗产业。

基于以上分析框架，在经济下行背景下，积极财政政策叠加流动性相对宽松，对权益市场相对利好，虽然财政政策对周期类行业会有短期刺激，但是消费和科技乃是新格局下新经济的大方向，也是本基金未来的配置重点。

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，由其按约定提供有关债券品种、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：当基金实现可分配收益达到 0.04 元或者当基金净值达到 1.10 元或以上时，且满足法定分红条件时，即实施收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少分配 1 次，基金收益分配每年至多 12 次；年度分红 12 次后，如果再次达到分红条件，收益分配滚存到下一年度实施；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 60%，基金合同生效不满三个月，收益可不分配；基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。

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 3 次收益分配：

1、本基金管理人已于 2018 年 4 月 25 日发布公告，以 2018 年 4 月 16 日可供分配利润为基准，每 10 份 A 类基金份额派发红利 0.10 元，C 类份额不分红。

2、本基金管理人已于 2018 年 5 月 17 日发布公告，以 2018 年 5 月 8 日可供分配利润为基准，每 10 份 A 类基金份额派发红利 0.10 元，C 类份额不分红。

3、本基金管理人已于 2018 年 5 月 30 日发布公告，以 2018 年 5 月 21 日可供分配利润为基准，每 10 份 A 类基金份额派发红利 0.10 元，C 类份额不分红。

本报告期末宝盈核心优势混合 A 可供分配基金份额利润-0.1087 元，基金份额净值 0.8913 元，宝盈核心优势混合 C 可供分配基金份额利润-0.1166 元，基金份额净值 0.8834 元，不符合利润分配条件。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合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：宝盈核心优势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	附注号	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	6.4.7.1	36,275,861.79	102,220,005.71
结算备付金		3,741,946.40	2,713,839.35
存出保证金		444,386.69	397,658.04
交易性金融资产	6.4.7.2	947,858,837.57	1,053,553,743.55
其中：股票投资		787,704,329.77	837,682,024.95
基金投资		-	-
债券投资		160,154,507.80	215,871,718.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	50,000,145.00
应收证券清算款		11,748,287.94	29,383,128.78

应收利息	6.4.7.5	963,058.00	8,255,066.19
应收股利		-	-
应收申购款		658,721.22	462,124.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,001,691,099.61	1,246,985,711.04
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,582,337.00	7,720,469.61
应付赎回款		718,253.21	1,765,753.96
应付管理人报酬		1,279,041.25	1,565,600.49
应付托管费		213,173.52	260,933.41
应付销售服务费		18,029.79	23,817.30
应付交易费用	6.4.7.7	1,797,034.38	2,224,706.87
应交税费		70,716.53	70,261.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	299,832.95	202,899.24
负债合计		7,978,418.63	13,834,442.48
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,115,012,531.01	1,227,303,187.23
未分配利润	6.4.7.10	-121,299,850.03	5,848,081.33
所有者权益合计		993,712,680.98	1,233,151,268.56
负债和所有者权益总计		1,001,691,099.61	1,246,985,711.04

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，宝盈核心优势混合 A 基金份额净值 0.8913 元，基金份额总额 1,098,896,693.70 份；宝盈核心优势混合 C 基金份额净值 0.8834 元，基金份额总额 16,115,837.31 份。宝盈核心优势混合份额总额合计为 1,115,012,531.01 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈核心优势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	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
-----	-----	---	---

		日	
一、收入		-74,750,009.50	-84,768,551.20
1. 利息收入		1,757,019.86	6,022,158.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	196,505.01	502,714.91
债券利息收入		1,548,907.28	5,519,443.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,607.57	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,930,777.05	-93,408,098.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,451,140.62	-98,426,407.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-22,033,209.26	-466,910.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,651,291.59	5,485,219.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-74,653,918.76	2,491,945.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	77,666.45	125,443.57
减：二、费用		17,687,474.03	22,660,913.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,350,698.83	12,271,003.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,391,783.14	2,045,167.30
3. 销售服务费		116,194.93	181,524.48
4. 交易费用	6.4.7.19	7,602,163.17	7,932,133.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		228.35	-
7. 其他费用	6.4.7.20	226,405.61	231,084.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-92,437,483.53	-107,429,464.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-92,437,483.53	-107,429,464.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈核心优势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）	1, 227, 303, 187. 23	5, 848, 081. 33	1, 233, 151, 268. 56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-92, 437, 483. 53	-92, 437, 483. 53
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）	-112, 290, 656. 22	-1, 989, 362. 30	-114, 280, 018. 52
其中：1.基金申购款	85, 973, 717. 88	-1, 697, 953. 94	84, 275, 763. 94
2. 基金赎回款	-198, 264, 374. 10	-291, 408. 36	-198, 555, 782. 46
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）	-	-32, 721, 085. 53	-32, 721, 085. 53
五、期末所有者权益（基金净值）	1, 115, 012, 531. 01	-121, 299, 850. 03	993, 712, 680. 98
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）	1, 644, 279, 865. 39	105, 762, 308. 33	1, 750, 042, 173. 72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-107, 429, 464. 45	-107, 429, 464. 45
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）	-64, 446, 181. 14	-733, 699. 49	-65, 179, 880. 63
其中：1.基金申购款	132, 415, 062. 29	2, 974, 124. 69	135, 389, 186. 98
2. 基金赎回款	-196, 861, 243. 43	-3, 707, 824. 18	-200, 569, 067. 61
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）	-	-48, 823, 965. 60	-48, 823, 965. 60
五、期末所有者权益（基金净值）	1, 579, 833, 684. 25	-51, 224, 821. 21	1, 528, 608, 863. 04

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 基金基本情况

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 5 号《关于核准宝盈核心优势灵活配置混合型证

券投资基金募集的批复》核准，由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 776,417,611.14 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报验字(09)第 0003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 776,687,900.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 270,289.02 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《关于宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金增加收费模式并修改基金合同的公告》，本基金自 2013 年 8 月 1 日起实施分级。根据申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的，为本基金 A 类基金份额；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，为本基金 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产占基金总资产的比例为 30%-80%；债券为 15%-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 X65%+上证国债指数 X35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	36,275,861.79
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	36,275,861.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		835,583,520.85	787,704,329.77	-47,879,191.08
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	150,838,229.55	150,010,507.80	-827,721.75
	银行间市场	10,000,000.00	10,144,000.00	144,000.00
	合计	160,838,229.55	160,154,507.80	-683,721.75
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		996,421,750.40	947,858,837.57	-48,562,912.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,460.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,683.90
应收债券利息	953,663.69
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	50.28
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	200.00
合计	963,058.00

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,797,034.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,797,034.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付赎回费	1,476.86
预提费用	298,356.09

合计	299,832.95
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈核心优势混合 A		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,208,561,435.15	1,208,561,435.15
本期申购	82,559,429.65	82,559,429.65
本期赎回(以“-”号填列)	-192,224,171.10	-192,224,171.10
本期末	1,098,896,693.70	1,098,896,693.70

金额单位：人民币元

宝盈核心优势混合 C		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,741,752.08	18,741,752.08
本期申购	3,414,288.23	3,414,288.23
本期赎回(以“-”号填列)	-6,040,203.00	-6,040,203.00
本期末	16,115,837.31	16,115,837.31

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈核心优势混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	142,876,348.69	-136,545,775.73	6,330,572.96
本期利润	-17,427,709.08	-73,600,300.61	-91,028,009.69
本期基金份额交易产生的变动数	-13,517,783.84	11,515,743.63	-2,002,040.21
其中：基金申购款	8,953,951.63	-10,492,918.67	-1,538,967.04
基金赎回款	-22,471,735.47	22,008,662.30	-463,073.17
本期已分配利润	-32,721,085.53	-	-32,721,085.53
本期末	79,209,770.24	-198,630,332.71	-119,420,562.47

单位：人民币元

宝盈核心优势混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,593,107.32	-2,075,598.95	-482,491.63
本期利润	-355,855.69	-1,053,618.15	-1,409,473.84
本期基金份额交易产生的变动数	-242,888.27	255,566.18	12,677.91
其中：基金申购款	278,476.65	-437,463.55	-158,986.90
基金赎回款	-521,364.92	693,029.73	171,664.81

本期已分配利润	-	-	-
本期末	994,363.36	-2,873,650.92	-1,879,287.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	154,513.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	37,854.71
其他	4,136.55
合计	196,505.01

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,523,422,880.37
减：卖出股票成本总额	2,505,971,739.75
买卖股票差价收入	17,451,140.62

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	457,948,829.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	477,257,308.67
减：应收利息总额	2,724,730.40
买卖债券差价收入	-22,033,209.26

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,651,291.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,651,291.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-74,653,918.76
——股票投资	-88,856,201.68
——债券投资	14,202,282.92
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-74,653,918.76

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	71,853.13
基金转换费收入	5,813.32
合计	77,666.45

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,602,163.17
银行间市场交易费用	-
合计	7,602,163.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
其他	600.00
银行汇划费用	9,449.52
银行间帐户维护费	9,000.00
上清所帐户维护费	9,000.00
合计	226,405.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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（“宝盈基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 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进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 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
----	---------------------------------------	--

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,350,698.83	12,271,003.63
其中：支付销售机构的客户维护费	1,710,326.92	2,277,758.58

注：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 1.5%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

6.4.10.2.2 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	1,391,783.14	2,045,167.30

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	合计
宝盈基金管理有限公司	-	75,792.60	75,792.60
中国银行	-	-	-
合计	-	75,792.60	75,792.60
获得销售服务费的 各关联方名称	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销售服务费		
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	合计
宝盈基金管理有限公司	-	127,311.88	127,311.88
中国银行	-	-	-
合计	-	127,311.88	127,311.88

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×1.5% / 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
基金合同生效日（2009 年 3 月 17 日）持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	4,300,645.16	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	4,300,645.16	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.39%	—

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
基金合同生效日（2009 年 3 月 17 日）持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	4,300,645.16	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	4,300,645.16	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.27%	—

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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
中国银行	36,275,861.79	154,513.75	122,149,842.00	466,973.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

宝盈核心优势混合 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2018 年 6 月 1 日	2018 年 6 月 1 日	0.1000	6,563,044.18	4,342,827.00	10,905,871.18	
2	2018 年 5 月 21 日	2018 年 5 月 21 日	0.1000	6,570,830.16	4,313,532.50	10,884,362.66	
3	2018 年 4 月 27 日	2018 年 4 月 27 日	0.1000	6,608,960.04	4,321,891.65	10,930,851.69	
合计	-	-	0.3000	19,742,834.38	12,978,251.15	32,721,085.53	

注：本报告期宝盈核心优势混合 C 未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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 成本总额	期末估值总 额	备注
603693	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	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
603690	至纯科技	2018 年 3 月 12 日	重大事项	16.25	2018 年 7 月 10 日	20.12	2,376,254	40,211,887.77	38,614,127.50	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于保本基金和债券型基金。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险预算范围内追求收益最大化。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为：13.41%(2017 年 12 月 31 日：无)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家公司上市公司发行的可流通股票不得超过该上

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,275,861.79	-	-	-	36,275,861.79
结算备付金	3,741,946.40	-	-	-	3,741,946.40
存出保证金	444,386.69	-	-	-	444,386.69
交易性金融资产	26,859,945.00	10,144,000.00	123,150,562.80	787,704,329.77	947,858,837.57
应收证券清算款	-	-	-	11,748,287.94	11,748,287.94
应收利息	-	-	-	963,058.00	963,058.00
应收申购款	-	-	-	658,721.22	658,721.22
资产总计	67,322,139.88	10,144,000.00	123,150,562.80	801,074,396.93	1,001,691,099.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,582,337.00	3,582,337.00
应付赎回款	-	-	-	718,253.21	718,253.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,279,041.25	1,279,041.25
应付托管费	-	-	-	213,173.52	213,173.52
应付销售服务费	-	-	-	18,029.79	18,029.79
应付交易费用	-	-	-	1,797,034.38	1,797,034.38
应交税费	-	-	-	70,716.53	70,716.53
其他负债	-	-	-	299,832.95	299,832.95
负债总计	-	-	-	7,978,418.63	7,978,418.63
利率敏感度缺口	67,322,139.88	10,144,000.00	123,150,562.80	793,095,978.30	993,712,680.98
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	102,220,005.71	-	-	-	102,220,005.71
结算备付金	2,713,839.35	-	-	-	2,713,839.35
存出保证金	397,658.04	-	-	-	397,658.04
交易性金融资产	-	215,871,718.60	-	837,682,024.95	1,053,553,743.55
买入返售金融资产	50,000,145.00	-	-	-	50,000,145.00
应收证券清算款	-	-	-	29,383,128.78	29,383,128.78
应收利息	-	-	-	8,255,066.19	8,255,066.19
应收申购款	3,969.28	-	-	458,155.14	462,124.42
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	155,335,617.38	215,871,718.60	-	875,778,375.06	1,246,985,711.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,720,469.61	7,720,469.61

应付赎回款	-	-	-	1,765,753.96	1,765,753.96
应付管理人报酬	-	-	-	1,565,600.49	1,565,600.49
应付托管费	-	-	-	260,933.41	260,933.41
应付销售服务费	-	-	-	23,817.30	23,817.30
应付交易费用	-	-	-	2,224,706.87	2,224,706.87
应交税费	-	-	-	70,261.60	70,261.60
其他负债	-	-	-	202,899.24	202,899.24
负债总计	-	-	-	13,834,442.48	13,834,442.48
利率敏感度缺口	155,335,617.38	215,871,718.60	-	861,943,932.58	1,233,151,268.56

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 16.12%（2017 年 12 月 31 日：17.88%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 30%-80%，债券为 15%-65%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	787,704,329.77	79.27	837,682,024.95	67.93
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	787,704,329.77	79.27	837,682,024.95	67.93

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	35,967,784.23	33,518,591.59
	沪深 300 指数下降 5%	-35,967,784.23	-33,518,591.59

6.4.14 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	787,704,329.77	78.64
	其中：股票	787,704,329.77	78.64
2	固定收益投资	160,154,507.80	15.99
	其中：债券	160,154,507.80	15.99
	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	40,017,808.19	4.00

7	其他各项资产	13,814,453.85	1.38
8	合计	1,001,691,099.61	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	729,654,834.04	73.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
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	45,307,385.74	4.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,589,324.00	1.27
M	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	0.01
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	787,704,329.77	79.27

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002273	水晶光电	7,187,162	92,498,774.94	9.31
2	603008	喜临门	4,255,789	84,179,506.42	8.47
3	002456	欧菲科技	4,209,656	67,901,751.28	6.83
4	300296	利亚德	3,969,468	51,126,747.84	5.15
5	300450	先导智能	1,638,632	49,552,231.68	4.99
6	002832	比音勒芬	1,315,279	48,665,323.00	4.90
7	300308	中际旭创	781,878	46,943,955.12	4.72
8	002439	启明星辰	2,065,767	43,835,575.74	4.41
9	300232	洲明科技	4,164,425	41,144,519.00	4.14

10	300420	五洋停车	9,309,620	40,869,231.80	4.11
11	300319	麦捷科技	5,267,836	39,877,518.52	4.01
12	603690	至纯科技	2,376,254	38,614,127.50	3.89
13	300476	胜宏科技	2,219,384	34,178,513.60	3.44
14	002384	东山精密	1,115,000	26,760,000.00	2.69
15	600702	舍得酒业	600,000	21,654,000.00	2.18
16	002669	康达新材	699,988	14,818,745.96	1.49
17	300178	腾邦国际	895,400	12,589,324.00	1.27
18	002402	和而泰	1,500,776	12,456,440.80	1.25
19	300558	贝达药业	168,500	9,380,395.00	0.94
20	000977	浪潮信息	200,000	4,770,000.00	0.48
21	002709	天赐材料	105,646	4,071,596.84	0.41
22	300348	长亮科技	53,000	1,471,810.00	0.15
23	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
24	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
25	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
26	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
27	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
28	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

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	002273	水晶光电	146,468,549.24	11.88
2	300476	胜宏科技	123,363,233.87	10.00
3	002456	欧菲科技	94,898,062.16	7.70
4	603008	喜临门	93,244,647.58	7.56
5	000960	锡业股份	75,026,868.08	6.08
6	001979	招商蛇口	73,899,766.98	5.99
7	300420	五洋停车	66,066,599.61	5.36
8	600585	海螺水泥	62,622,763.96	5.08
9	300232	洲明科技	59,856,116.27	4.85
10	603626	科森科技	57,508,862.16	4.66
11	600038	中直股份	57,168,416.04	4.64
12	300450	先导智能	56,453,976.53	4.58
13	600760	中航沈飞	55,914,035.88	4.53

14	300178	腾邦国际	53,921,977.76	4.37
15	002439	启明星辰	53,845,009.29	4.37
16	002832	比音勒芬	53,645,706.59	4.35
17	601636	旗滨集团	52,279,266.84	4.24
18	300308	中际旭创	51,028,263.60	4.14
19	603690	至纯科技	50,335,306.15	4.08
20	002402	和而泰	47,448,478.00	3.85
21	002244	滨江集团	46,710,634.11	3.79
22	300373	扬杰科技	45,345,127.40	3.68
23	300296	利亚德	45,242,745.92	3.67
24	000333	美的集团	44,965,438.92	3.65
25	300170	汉得信息	44,769,093.02	3.63
26	002920	德赛西威	40,755,563.30	3.30
27	000002	万科 A	40,479,726.07	3.28
28	300059	东方财富	40,234,051.84	3.26
29	002045	国光电器	39,997,096.88	3.24
30	300558	贝达药业	34,999,604.03	2.84
31	300319	麦捷科技	31,085,014.10	2.52
32	000568	泸州老窖	31,074,898.81	2.52
33	000977	浪潮信息	30,304,438.20	2.46
34	000001	平安银行	30,030,553.80	2.44
35	002241	歌尔股份	28,044,941.52	2.27
36	300567	精测电子	26,955,586.80	2.19

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”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。

7.4.2 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	300476	胜宏科技	106,071,977.58	8.60
2	300373	扬杰科技	88,361,189.81	7.17
3	001979	招商蛇口	76,808,287.17	6.23
4	000063	中兴通讯	66,781,317.17	5.42
5	600585	海螺水泥	65,794,952.78	5.34
6	000960	锡业股份	63,668,553.45	5.16

7	002709	天赐材料	60,820,128.10	4.93
8	600760	中航沈飞	58,508,831.90	4.74
9	002439	启明星辰	58,393,804.58	4.74
10	600388	龙净环保	56,061,701.47	4.55
11	300232	洲明科技	55,235,802.97	4.48
12	300671	富满电子	54,572,226.04	4.43
13	000001	平安银行	52,274,094.78	4.24
14	601636	旗滨集团	52,117,940.62	4.23
15	600038	中直股份	52,111,325.99	4.23
16	002045	国光电器	51,410,287.42	4.17
17	002573	清新环境	50,794,997.48	4.12
18	603626	科森科技	50,504,493.51	4.10
19	300308	中际旭创	47,946,813.41	3.89
20	002244	滨江集团	47,737,470.28	3.87
21	000333	美的集团	46,543,809.57	3.77
22	300203	聚光科技	46,037,535.89	3.73
23	002402	和而泰	45,858,562.75	3.72
24	300170	汉得信息	43,617,702.55	3.54
25	300059	东方财富	43,019,295.02	3.49
26	002273	水晶光电	42,233,783.79	3.42
27	300178	腾邦国际	40,605,081.33	3.29
28	000002	万科A	38,836,477.68	3.15
29	603993	洛阳钼业	38,463,806.25	3.12
30	002920	德赛西威	38,304,080.56	3.11
31	603008	喜临门	34,493,640.58	2.80
32	300567	精测电子	31,974,001.00	2.59
33	600036	招商银行	28,161,852.86	2.28
34	601600	中国铝业	27,873,834.36	2.26
35	002241	歌尔股份	27,236,274.37	2.21
36	000568	泸州老窖	26,912,160.70	2.18
37	000977	浪潮信息	26,850,586.90	2.18
38	603197	保隆科技	26,829,188.47	2.18
39	000661	长春高新	26,752,561.70	2.17
40	002833	弘亚数控	26,104,667.62	2.12
41	300296	利亚德	25,767,648.86	2.09

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	2,544,850,246.25
卖出股票收入（成交）总额	2,523,422,880.37

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	37,003,945.00	3.72
	其中：政策性金融债	26,859,945.00	2.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	123,150,562.80	12.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	160,154,507.80	16.12

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	123006	东财转债	804,880	96,802,917.60	9.74
2	018002	国开 1302	264,630	26,859,945.00	2.70
3	123008	康泰转债	138,526	26,347,645.20	2.65
4	1820009	18 宁波银行 01	100,000	10,144,000.00	1.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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。

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投资明细

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。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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除利亚德外未受到公开谴责、处罚。

2018 年 5 月 4 日，深圳证券交易所出具了《关于对利亚德光电股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分决定》（以下简称“本次处分”），决定对公司给予通报批评的处分；对公司董事长兼总经理李军，董事兼财务总监沙丽，副总经理兼董事会秘书李楠楠给予通报批评的处分。

本次处分主要系证监会查明公司及相关当事人存在以下违规行为：2015 年 7 月 2 日，公司取得中国证监会《关于核准利亚德光电股份有限公司向周利鹤等发行股份购买资产并募集配套资金的批复》（证监许可(2015) 1452 号），同意公司以发行股份和支付现金方式购买周利鹤等 10 名交易对方合计持有的广州励丰文化科技股份有限公司 100%股权以及兰侠等 9 名交易对方合计持有的北京金立翔艺彩科技股份有限公司 99%股权，并向公司员工持股计划发行不超过 22,456,843 股新股募集配套资金用于支付该次交易的现金对价部分，剩余部分配套资金将用于支付本次交易中介机构费用及补充流动资金。配套募集资金到位前，公司先行以自有资金向交易对方支付了部分现金对价，合计 9,128.43 万元。配套募集资金到位后，2015 年 12 月 24 日公司未经董事会审议将 9,128.43 万元募集资金由募集资金专户汇至公司其它账户，以募集资金置换了先期投入的自有资

金。公司直至 2017 年 4 月 20 日才补充履行了董事会审议程序及相关信息披露义务。

本基金管理人认为本次通报批评在于上市公司对于定增配套募集资金的合规使用存在程序瑕疵，对于公司的行业地位和投资价值没有影响。

7.12.2

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	444,386.69
2	应收证券清算款	11,748,287.94
3	应收股利	-
4	应收利息	963,058.00
5	应收申购款	658,721.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,814,453.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	96,802,917.60	9.74

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝盈核心优势混合 A	73,711	14,908.18	83,304,510.59	7.58%	1,015,592,183.11	92.42%

宝盈核心优势混合 C	1,248	12,913.33	-	-	16,115,837.31	100.00%
合计	74,959	14,874.97	83,304,510.59	7.47%	1,031,708,020.42	92.53%

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝盈核心优势混合 A	24,247.22	0.0022%
	宝盈核心优势混合 C	-	-
	合计	24,247.22	0.0022%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈核心优势混合 A	0~10
	宝盈核心优势混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈核心优势混合 A	0
	宝盈核心优势混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
基金合同生效日（2009 年 3 月 17 日）基金份额总额	776,687,900.16	-
本报告期期初基金份额总额	1,208,561,435.15	18,741,752.08
本报告期基金总申购份额	82,559,429.65	3,414,288.23
减：本报告期基金总赎回份额	192,224,171.10	6,040,203.00
本报告期期末基金份额总额	1,098,896,693.70	16,115,837.31

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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动

1、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第五次临时会议决议，同意张新元辞去副总经理职务。该变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

2、报告期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、基金托管业务的诉讼。

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《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

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况。

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

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	1,833,761,471.55	36.20%	1,671,108.33	36.20%	—
海通证券	3	1,529,837,023.15	30.20%	1,394,142.66	30.20%	—
天风证券	2	1,440,919,997.95	28.44%	1,313,108.07	28.44%	—
中信证券	1	257,547,340.11	5.08%	234,701.90	5.08%	—
中泰证券	1	3,903,246.01	0.08%	3,557.20	0.08%	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源证	1	—	—	—	—	—

券						
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

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，并能为本基金提供全面的信息服。
- （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单元租用协议。

应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单独指股票交易佣金。

2、交易单元变更情况

本基金本报告期内无租用交易单元，退租瑞银证券深圳交易单元（一个）。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	195,415,739.20	22.91%	-	-	-	-
海通证券	103,246,738.75	12.10%	-	-	-	-
天风证券	381,541,838.73	44.73%	-	-	-	-
中信证券	172,756,221.30	20.25%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 1 月 10 日
2	宝盈基金管理有限公司关于电子直销平台汇付天下渠道升级及费率优惠的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 1 月 12 日
3	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变	中国证券报 证券时报	2018 年 1 月 20 日

	更公告	上海证券报 证券日报	
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 2 月 2 日
5	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 2 月 7 日
6	宝盈基金管理有限公司关于修订公司旗下基金基金合同、托管协议有关条款并调整部分基金赎回费率的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 3 月 23 日
7	关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 3 月 31 日
8	关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司开展的基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 4 月 2 日
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 4 月 18 日
10	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 4 月 19 日
11	宝盈基金管理有限公司关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 4 月 24 日
12	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第五十四次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 4 月 25 日
13	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金摘要	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 4 月 27 日
14	宝盈基金管理有限公司关于新增济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 5 月 10 日
15	宝盈基金管理有限公司关于新增喜鹊财富基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 5 月 11 日
16	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第五十五次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 5 月 17 日
17	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加银河证券股份有限公司开展的基金费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 5 月 18 日
18	关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 5 月 18 日
19	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第五十六次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 5 月 30 日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基	中国证券报 证券时报	2018 年 6 月 7 日

	金调整定期定额投资金额限制的公告	上海证券报 证券日报	
21	宝盈基金管理有限公司关于新增国金证券股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 6 月 8 日
22	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 6 月 9 日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 6 月 14 日
24	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 6 月 16 日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 6 月 21 日
26	宝盈基金有限公司关于调整网上直销系统货币基金“T+0 赎回提现业务”限额的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2018 年 6 月 28 日
27	关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2018 年 6 月 29 日

§ 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%的情况

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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

12.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

12.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2018 年 8 月 29 日