

宝盈优势产业灵活配置混合型  
证券投资基金  
2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者仔细阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 宝盈优势产业混合         |
| 基金主代码      | 001487           |
| 交易代码       | 001487           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2015 年 8 月 25 日  |
| 基金管理人      | 宝盈基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 118,875,705.76 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金将通过积极的大类资产配置，重点关注我国的优势产业，深入研究行业个股，在严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 | <p>本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和金融衍生品投资策略四部分组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金遵循重点投资优势产业与行业内精选个股相结合的股票投资策略，包括行业配置策略和个股投资策略。</p> <p>（三）固定收益类资产投资策略</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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。</p> <p>（四）金融衍生品投资策略</p> <p>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×65% + 中证综合债券指数收益率×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         | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张瑾                 | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 0755-83276688      | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | zhangj@byfunds.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-300       | 95588               |
| 传真      |      | 0755-83515599      | 010-66105798        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人处    |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2016 年         | 2015 年 8 月 25 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|---|
| 本期已实现收益       | 2,341,515.60   | 68,214,436.40                             |
| 本期利润          | -19,993,803.53 | 86,115,830.25                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1395        | 0.2295                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -14.91%        | 22.34%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末        | 2015 年末                                   |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0865        | 0.0728                                    |
| 期末基金资产净值      | 108,587,232.37 | 148,133,164.06                            |
| 期末基金份额净值      | 0.913          | 1.073                                     |

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括份额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。

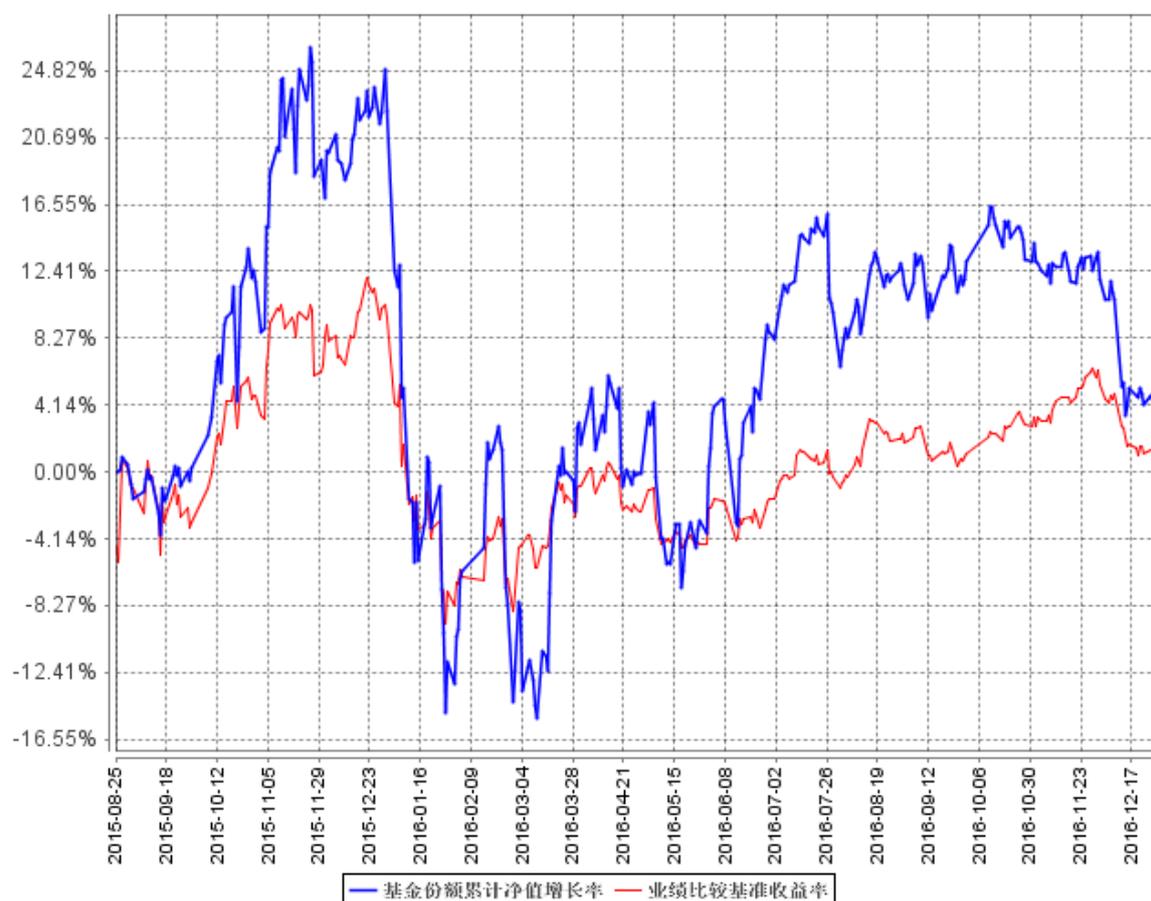
### 3.2 基金净值表现

#### 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -7.87%   | 0.96%       | 0.12%      | 0.47%         | -7.99% | 0.49% |
| 过去六个月      | -4.10%   | 1.09%       | 2.95%      | 0.51%         | -7.05% | 0.58% |
| 过去一年       | -14.91%  | 2.13%       | -7.56%     | 0.99%         | -7.35% | 1.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.10%    | 2.07%       | 1.26%      | 1.11%         | 2.84%  | 0.96% |

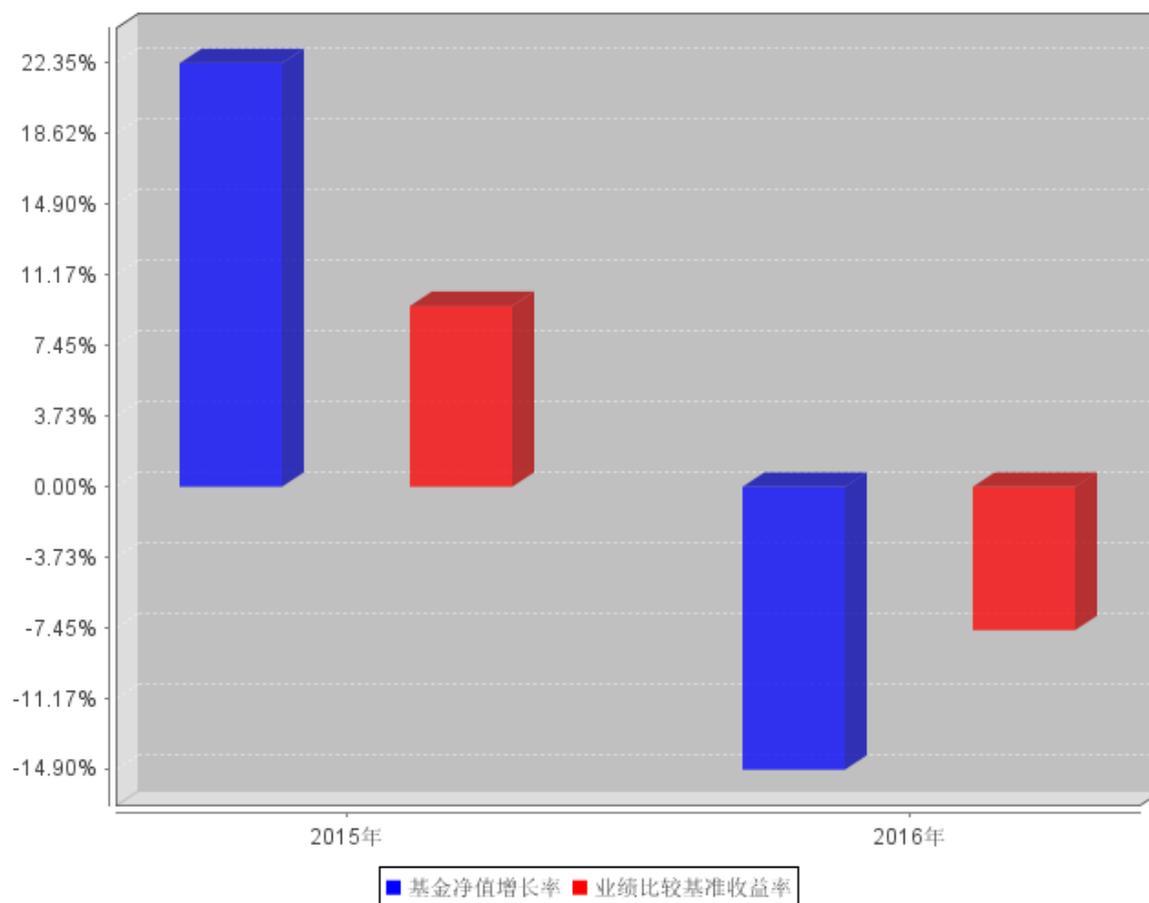
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额分<br>红数 | 现金形式发放<br>总额  | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2016 | -               | -             | -             | -             |    |
| 2015 | 1.5000          | 16,994,155.67 | 3,037,302.49  | 20,031,458.16 |    |
| 合计   | 1.5000          | 16,994,155.67 | 3,037,302.49  | 20,031,458.16 |    |

## § 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。公司目前管理基金鸿阳、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、宝盈祥瑞养老混合、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、宝盈祥泰养老混合、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二十二只基金，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<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|-----|---|----------------------|------|------------|--|
|     |   | 任职日期                 | 离任日期 |            |  |
| 段鹏程 | 本基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、鸿阳证券投资基金基金经理；研究部总监 | 2016 年 8 月 20 日      | -    | 12 年       | 段鹏程先生，厦门大学生物学硕士。曾就职于厦门国际信托投资有限公司和天同证券。2004 年 5 月至 2007 年 3 月任职于宝盈基金管理有限公司，担任行业研究员。2007 年 3 月至 2008 年 3 月任职于诺安基金管理有限公司，曾任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理（2007 年 6 月 16 日至 2008 年 1 月 10 日）、专户部总监。2008 年 4 月起任职于宝盈基金管理有限公司，历任特定客户资产管理部投资经理，特定客户资产 |

|    |   |                 |                  |      |  |
|----|---|-----------------|------------------|------|--|
|    |   |                 |                  |      | 管理部副总监、总监，研究部核心研究员、副总监，现任宝盈基金管理有限公司研究部总监。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。  |
| 杨凯 | 本基金基金经理、鸿阳证券投资基金基金经理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、副总经理 | 2015 年 8 月 25 日 | 2016 年 8 月 20 日  | 12 年 | 杨凯先生，中山大学岭南学院工商管理硕士。2003 年 7 月至今在宝盈基金管理有限公司工作，先后担任产品设计师、市场部总监，特定客户资产管理部投资经理、总监，研究部总监，总经理助理等职务。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格 |
| 李进 | 本基金、鸿阳证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理                | 2015 年 8 月 25 日 | 2016 年 10 月 15 日 | 6 年  | 李进先生，武汉大学金融学硕士。历任中国农业银行深圳市分行信贷审批员、华泰联合证券研究所研究员，2014 年 8 月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。                             |

注：1、杨凯为首任基金经理，其“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

- 2、段鹏程为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；
- 3、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 2016 年 12 月 31 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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的投资组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2016 年股票市场经历了开年熔断，整体前低后高。从全年来看，主板走势要好于中小创指数走势，上证指数涨幅-12.31%、沪深 300 涨幅为-11.28%、深成指涨幅为-19.64%，同期，创业板指数涨幅为-27.71%、中小板指数涨幅为-22.89%。从全年来看，1-2 月为快熊，3 月至年末的赚钱效应较强，市场并非是单边下跌的熊市。

回顾市场，全年呈现出快熊+慢牛。本基金在板块选择上坚持选择高景气 and 稳定成长的细分行业及个股，整体来看取得了一定的投资效果，但是需要时间来消化市场整体的负面情绪，耐心等待收获时期。本年度主要持仓集中在 TMT、医药、先进制造、建筑装饰、大消费等方向。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是-14.91%，同期业绩比较基准收益率是-7.56%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为，2017 年中国的宏观经济仍然处于复苏的过程，逆全球化的趋势仍要关注。不可忽视的是，经过近几年的去产能及 2016 年供给侧改革，部分传统行业已有一定改善，加上改革和创新的持续推进，向好的力量渐有积蓄，我们要坚定看好本届政府对经济转型的决心，并在这背景下把握好 2017 年的投资机会。

从市场分析看，经过过去一年多的市场的下行，估值泡沫得到一定消化。特别重要的是，一系列的证券市场改革使得主流资金的投资理念发生改变。1) 2016 年新证监会主席上台后，主要任务是稳市场和疏通 IPO 堰塞湖，17 年发行量或至 450 家，虽然某种程度消纳了市场的资金，但长远来看，更有利于专业投资者挑选更加优秀的上市公司；2) 目前监管方向趋严，对概念炒作及此前资本运作型的并购监管加强，再融资监管将更加严格，这将使得概念的炒作难度增加，也将使得投资者回归基本面，那么稳健成长的股票也将受到投资者更多的重视；3) A 股目前投资者结构在进行变化，此前 80%的交易由个人投资者贡献，随着保险公司、养老金等入市，机构投资者的话语权将逐步上升，这些长期资金将利于市场的稳定，在配置上也将给一些稳定的股票带来估值溢价。

当然我们也需要看到市场未来的一些主要风险因素：1) 美国加息趋势下国内货币政策与汇率

稳定的关系；2) 房地产调控的逐步加强对经济的负面冲击。

目前来看，市场的悲观因素经过一年多的时间已大部分 price in，再次大幅波动的概率较小，市场积极的因素在累积，如接下来的“一路一带峰会”、十九大的召开、国家以供给侧改革为核心的国有企业改革措施的落实等等。从价值投资的角度来看，目前自下而上选股可投资的股票越来越多，有相当一部分股票进入合理的价值投资区间。

本基金将继续秉承中观行业高景气+自下而上精选高成长个股的策略，坚持价值投资的理念，为投资者追求较高的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、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。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责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工作小组，由权益投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。权益投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了德师报(审)字(17)第 P01054 号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 资产         | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产:</b> |                         |                          |
| 银行存款       | 7,986,778.87            | 9,890,861.14             |
| 结算备付金      | 102,525.05              | 211,163.70               |
| 存出保证金      | 34,762.37               | 300,218.23               |
| 交易性金融资产    | 100,926,996.25          | 136,674,515.81           |
| 其中: 股票投资   | 100,926,996.25          | 136,674,515.81           |
| 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    | -                       | 1,773,883.60             |
| 应收利息       | 1,881.50                | 6,778.71                 |
| 应收股利       | -                       | -                        |
| 应收申购款      | 32,518.21               | 758,949.12               |
| 递延所得税资产    | -                       | -                        |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 其他资产            | -                  | -                  |
| 资产总计            | 109,085,462.25     | 149,616,370.31     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2016年12月31日</b> | <b>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |                    |                    |
| 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         | -                  | -                  |
| 应付赎回款           | 104,210.38         | 343,540.43         |
| 应付管理人报酬         | 144,016.19         | 217,561.59         |
| 应付托管费           | 24,002.70          | 36,260.26          |
| 应付销售服务费         | -                  | -                  |
| 应付交易费用          | 55,787.47          | 785,045.39         |
| 应交税费            | -                  | -                  |
| 应付利息            | -                  | -                  |
| 应付利润            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债         | -                  | -                  |
| 其他负债            | 170,213.14         | 100,798.58         |
| 负债合计            | 498,229.88         | 1,483,206.25       |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |                    |
| 实收基金            | 118,875,705.76     | 138,085,671.17     |
| 未分配利润           | -10,288,473.39     | 10,047,492.89      |
| 所有者权益合计         | 108,587,232.37     | 148,133,164.06     |
| 负债和所有者权益总计      | 109,085,462.25     | 149,616,370.31     |

注: 报告截止日 2016 年 12 月 31 日, 基金份额净值人民币 0.913 元, 基金份额总额 118,875,705.76 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 8 月 25 日(基金合<br>同生效日)至 2015 年 12 月<br>31 日 |
|------------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            | -16,500,552.11                            | 90,808,614.79  |
| 1. 利息收入                | 100,406.01                                | 612,967.04   |
| 其中：存款利息收入              | 100,406.01                                | 612,967.04   |
| 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）      | 5,231,568.21                              | 69,976,829.10  |
| 其中：股票投资收益              | 4,732,246.16                              | 69,976,829.10  |
| 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                   | 499,322.05                                | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -22,335,319.13                            | 17,901,393.85  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 502,792.80                                | 2,317,424.80   |
| <b>减：二、费用</b>          | 3,493,251.42                              | 4,692,784.54   |
| 1. 管理人报酬               | 1,979,400.01                              | 2,178,481.06   |

|                            |                       |                      |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|
| 2. 托管费                     | 329,900.07            | 363,080.20           |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                    |
| 4. 交易费用                    | 840,126.22            | 2,013,715.98         |
| 5. 利息支出                    | -                     | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                     | -                    |
| 6. 其他费用                    | 343,825.12            | 137,507.30           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-19,993,803.53</b> | <b>86,115,830.25</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-19,993,803.53</b> | <b>86,115,830.25</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）                   | 138,085,671.17                         | 10,047,492.89  | 148,133,164.06  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | -19,993,803.53 | -19,993,803.53  |
| 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） | -19,209,965.41                         | -342,162.75    | -19,552,128.16  |
| 其中：1. 基金申购款                       | 121,277,279.68                         | -9,045,551.11  | 112,231,728.57  |
| 2. 基金赎回款                          | -140,487,245.09                        | 8,703,388.36   | -131,783,856.73 |

|  |  |                |                 |
|--|--|----------------|-----------------|
| 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）                        | 118,875,705.76                             | -10,288,473.39 | 108,587,232.37  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015年8月25日(基金合同生效日)至2015年12月31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）                        | -  | -              | -               |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 86,115,830.25  | 86,115,830.25   |
| 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）      | 138,085,671.17                             | -56,036,879.20 | 82,048,791.97   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 712,500,426.98                             | 4,251,690.05   | 716,752,117.03  |
| 2. 基金赎回款                               | -574,414,755.81                            | -60,288,569.25 | -634,703,325.06 |
| 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） | -  | -20,031,458.16 | -20,031,458.16  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 138,085,671.17                             | 10,047,492.89  | 148,133,164.06  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

李文众

基金管理人负责人

胡坤

主管会计工作负责人

何瑜

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.2.3 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差错更正。

### 7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.4 关联方关系

| 关联方名称          | 与本基金的关系               |
|----------------|-----------------------|
| 宝盈基金管理有限公司     | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司   | 基金托管人、基金代销机构          |
| 中铁信托有限责任公司     | 基金管理人的股东              |
| 中国对外经济贸易信托有限公司 | 基金管理人的股东              |
| 中铁宝盈资产管理有限公司   | 基金管理人的子公司             |

注：1. 本基金本报告期内无存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行交易(2015 年度：无)。

##### 7.4.5.2 关联方报酬

###### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               | 上年度可比期间                                    |
|-----------------|----------------------------------|--|
|                 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,979,400.01                     | 2,178,481.06                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 973,805.66                       | 960,322.91                                 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                                      |
|----------------|----------------------------------|--|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 8 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 329,900.07                       | 363,080.20                                   |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易(2015 年度：无)。

#### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况(2015 年度：无)。

## 7.4.5.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况(2015 年度：无)。

## 7.4.5.5 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                               |           | 上年度可比期间                                    |            |
|--------|----------------------------------|-----------|--|------------|
|        | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |           | 2015 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |            |
|        | 期末余额                             | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入     |
| 中国工商银行 | 7,986,778.87                     | 92,697.11 | 9,890,861.14                               | 603,875.60 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

## 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券(2015 年度：无)。

## 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

## 7.4.6 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券(2015 年 12 月 31 日：无)。

## 7.4.6.2 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 |
|--------|------|-----------------|------|--------|----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 300047 | 天源迪科 | 2016 年 8 月 15 日 | 重大事项 | 18.36  | 2017 年 1 月 6 日 | 19.00  | 300,000 | 6,315,570.00 | 5,508,000.00 | -  |
| 300065 | 海兰信  | 2016 年 12 月 8 日 | 重大事项 | 35.89  | -              | -      | 100,000 | 2,940,967.92 | 3,589,000.00 | -  |

|        |      |                    |      |        |                    |        |     |           |           |   |
|--------|------|--------------------|------|--------|--------------------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| 603986 | 兆易创新 | 2016 年 9<br>月 19 日 | 重大事项 | 177.97 | 2017 年 3<br>月 13 日 | 195.77 | 453 | 10,536.78 | 80,620.41 | - |
|--------|------|--------------------|------|--------|--------------------|--------|-----|-----------|-----------|---|

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券(2015 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券(2015 年 12 月 31 日：无)。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 100,926,996.25 | 92.52            |
|    | 其中：股票             | 100,926,996.25 | 92.52            |
| 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      | 8,089,303.92   | 7.42             |
| 7  | 其他各项资产            | 69,162.08      | 0.06             |
| 8  | 合计                | 109,085,462.25 | 100.00           |

### 8.2 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          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 60,919,951.71 | 56.10         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | 8,412,033.54  | 7.75          |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 3,648,000.00   | 3.36  |
| 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 | 16,004,000.00  | 14.74 |
| J | 金融业             | -              | -     |
| K | 房地产业            | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | 6,258,011.00   | 5.76  |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 5,685,000.00   | 5.24  |
| 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              | 100,926,996.25 | 92.95 |

### 8.3 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  | 000070 | 特发信息 | 300,000 | 7,587,000.00 | 6.99         |
| 2  | 000058 | 深赛格  | 565,000 | 6,231,950.00 | 5.74         |
| 3  | 002007 | 华兰生物 | 160,000 | 5,720,000.00 | 5.27         |
| 4  | 000978 | 桂林旅游 | 500,000 | 5,685,000.00 | 5.24         |
| 5  | 300047 | 天源迪科 | 300,000 | 5,508,000.00 | 5.07         |
| 6  | 002675 | 东诚药业 | 382,400 | 5,468,320.00 | 5.04         |
| 7  | 000971 | 高升控股 | 200,000 | 4,730,000.00 | 4.36         |
| 8  | 002482 | 广田集团 | 501,750 | 4,641,187.50 | 4.27         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 9  | 000810 | 创维数字 | 300,000 | 4,221,000.00 | 3.89 |
| 10 | 300363 | 博腾股份 | 201,700 | 4,044,085.00 | 3.72 |

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> 网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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  | 002019 | 亿帆医药   | 24,000,765.00 | 16.20           |
| 2  | 300047 | 天源迪科   | 10,384,989.14 | 7.01            |
| 3  | 000070 | 特发信息   | 8,642,193.83  | 5.83            |
| 4  | 000058 | 深赛格    | 8,604,519.21  | 5.81            |
| 5  | 300409 | 道氏技术   | 8,488,559.25  | 5.73            |
| 6  | 000021 | 深科技    | 7,551,752.08  | 5.10            |
| 7  | 002456 | 欧菲光    | 7,387,504.00  | 4.99            |
| 8  | 300467 | 迅游科技   | 7,219,124.00  | 4.87            |
| 9  | 000971 | 高升控股   | 7,108,785.32  | 4.80            |
| 10 | 300076 | GQY 视讯 | 7,086,005.25  | 4.78            |
| 11 | 300301 | 长方集团   | 6,652,865.28  | 4.49            |
| 12 | 002675 | 东诚药业   | 6,385,080.00  | 4.31            |
| 13 | 300327 | 中颖电子   | 6,331,144.48  | 4.27            |
| 14 | 002565 | 上海绿新   | 6,192,516.53  | 4.18            |
| 15 | 600549 | 厦门钨业   | 5,963,414.46  | 4.03            |
| 16 | 300322 | 硕贝德    | 5,740,300.34  | 3.88            |
| 17 | 300049 | 福瑞股份   | 5,372,242.90  | 3.63            |
| 18 | 600559 | 老白干酒   | 5,288,783.00  | 3.57            |
| 19 | 000810 | 创维数字   | 5,243,500.78  | 3.54            |
| 20 | 603788 | 宁波高发   | 4,988,234.00  | 3.37            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 21 | 300363 | 博腾股份  | 4,753,670.00 | 3.21 |
| 22 | 002047 | 宝鹰股份  | 4,601,956.00 | 3.11 |
| 23 | 002007 | 华兰生物  | 4,575,944.00 | 3.09 |
| 24 | 000069 | 华侨城 A | 4,457,751.44 | 3.01 |
| 25 | 000978 | 桂林旅游  | 4,449,285.13 | 3.00 |
| 26 | 002235 | 安妮股份  | 4,355,384.50 | 2.94 |
| 27 | 300213 | 佳讯飞鸿  | 4,240,390.30 | 2.86 |
| 28 | 300131 | 英唐智控  | 4,216,270.00 | 2.85 |
| 29 | 300059 | 东方财富  | 4,079,840.00 | 2.75 |
| 30 | 300219 | 鸿利智汇  | 3,793,387.79 | 2.56 |
| 31 | 603808 | 歌力思   | 3,545,365.51 | 2.39 |
| 32 | 300199 | 翰宇药业  | 3,463,193.00 | 2.34 |
| 33 | 600584 | 长电科技  | 3,454,867.57 | 2.33 |
| 34 | 600682 | 南京新百  | 3,261,578.50 | 2.20 |
| 35 | 300128 | 锦富新材  | 3,228,000.00 | 2.18 |
| 36 | 002170 | 芭田股份  | 3,181,147.00 | 2.15 |
| 37 | 002177 | 御银股份  | 3,166,922.15 | 2.14 |
| 38 | 600589 | 广东榕泰  | 3,145,504.62 | 2.12 |
| 39 | 300246 | 宝莱特   | 3,076,702.00 | 2.08 |
| 40 | 000401 | 冀东水泥  | 3,025,153.30 | 2.04 |
| 41 | 002425 | 凯撒文化  | 2,992,314.00 | 2.02 |

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。

#### 8.4.2 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  | 002019 | 亿帆医药 | 22,499,746.91 | 15.19          |

|    |        |        |               |       |
|----|--------|--------|---------------|-------|
| 2  | 000810 | 创维数字   | 15,483,642.00 | 10.45 |
| 3  | 300322 | 硕贝德    | 14,588,382.42 | 9.85  |
| 4  | 300409 | 道氏技术   | 11,717,453.04 | 7.91  |
| 5  | 600715 | 文投控股   | 10,344,824.00 | 6.98  |
| 6  | 300076 | GQY 视讯 | 9,878,603.89  | 6.67  |
| 7  | 300395 | 菲利华    | 9,376,868.60  | 6.33  |
| 8  | 002456 | 欧菲光    | 8,493,220.00  | 5.73  |
| 9  | 601908 | 京运通    | 7,929,147.01  | 5.35  |
| 10 | 600892 | 大晟文化   | 7,430,315.46  | 5.02  |
| 11 | 300327 | 中颖电子   | 7,394,142.46  | 4.99  |
| 12 | 600549 | 厦门钨业   | 7,147,929.99  | 4.83  |
| 13 | 002665 | 首航节能   | 7,035,419.79  | 4.75  |
| 14 | 000021 | 深科技    | 6,760,419.00  | 4.56  |
| 15 | 603788 | 宁波高发   | 6,631,087.00  | 4.48  |
| 16 | 600559 | 老白干酒   | 6,201,899.00  | 4.19  |
| 17 | 300049 | 福瑞股份   | 5,887,484.00  | 3.97  |
| 18 | 300467 | 迅游科技   | 5,861,169.50  | 3.96  |
| 19 | 300250 | 初灵信息   | 5,842,242.45  | 3.94  |
| 20 | 300048 | 合康变频   | 5,802,686.94  | 3.92  |
| 21 | 000988 | 华工科技   | 5,162,228.00  | 3.48  |
| 22 | 300301 | 长方集团   | 4,815,172.00  | 3.25  |
| 23 | 300219 | 鸿利智汇   | 4,239,126.32  | 2.86  |
| 24 | 000069 | 华侨城 A  | 4,221,866.40  | 2.85  |
| 25 | 300213 | 佳讯飞鸿   | 4,207,889.20  | 2.84  |
| 26 | 002717 | 岭南园林   | 4,197,251.00  | 2.83  |
| 27 | 300246 | 宝莱特    | 3,923,367.14  | 2.65  |
| 28 | 002177 | 御银股份   | 3,903,163.40  | 2.63  |
| 29 | 600584 | 长电科技   | 3,725,060.85  | 2.51  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 30 | 002235 | 安妮股份 | 3,641,879.00 | 2.46 |
| 31 | 002425 | 凯撒文化 | 3,506,621.00 | 2.37 |
| 32 | 300047 | 天源迪科 | 3,464,519.04 | 2.34 |
| 33 | 000978 | 桂林旅游 | 3,402,077.58 | 2.30 |
| 34 | 600682 | 南京新百 | 3,235,380.00 | 2.18 |
| 35 | 300365 | 恒华科技 | 3,105,029.00 | 2.10 |
| 36 | 002170 | 芭田股份 | 3,096,241.00 | 2.09 |

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。

#### 8.4.3 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 | 267,500,070.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 285,644,517.19 |

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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投资股指期货。

##### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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未受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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   | 34,762.37 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 1,881.50  |
| 5  | 应收申购款   | 32,518.21 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 69,162.08 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 300047 | 天源迪科 | 5,508,000.00 | 5.07          | 重大事项     |

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 2,966        | 40,079.47     | -     | -          | 118,875,705.76 | 100.00%    |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 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<br>持有本基金 | 397,235.42 | 0.3342%  |

### 9.3 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                                 | 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015年8月25日）基金份额总额 | 683,476,202.80 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 138,085,671.17 |
| 本报告期基金总申购份额               | 121,277,279.68 |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 140,487,245.09 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 118,875,705.76 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

(1) 2016 年 4 月 27 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十一临时会议，同意储诚忠辞去副总经理职务。本基金管理人已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局以及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) 2016 年 8 月 4 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十二次临时会议，同意杨凯辞去副总经理职务。本基金管理人已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局以及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。

(3) 2016 年 12 月 3 日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，葛俊杰先生任宝盈基金管理有限公司副总经理。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。

(4) 2016 年 9 月 27 日，宝盈基金管理有限公司董事马宏变更为张栋，本基金管理人已按规定报中国证监会备案。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 40,000 元，目前事务所为第 2 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会《关于对宝盈基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停办理公募基金产品注册申请 3 个月，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，针对性的制定、实施整改措施，并向中国证监会及深圳证监局提交整改报告，深圳证监局已完成现场整改验收。

2、2016 年 9 月中国证券业协会发布公告，本基金由于提供有效报价但未参与申购，被列入首次公开发行股票配售对象黑名单，黑名单起止日期为 2016 年 9 月 8 日至 2017 年 3 月 7 日。事件发生后，公司及时就相关问题进行了自查并制定了整改措施，以确保不再发生类似事件。

除上述情况外，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罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |    |
| 广发证券 | 1      | 236,458,649.30 | 42.81%       | 215,484.43 | 42.63%     | -  |
| 方正证券 | 1      | 210,904,399.24 | 38.18%       | 192,197.86 | 38.02%     | -  |
| 国泰君安 | 1      | 105,011,573.36 | 19.01%       | 97,795.80  | 19.35%     | -  |
| 浙商证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 第一创业 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 信达证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国联证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 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单元租用协议。

2、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。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

- (1) 本报告期内新租中信证券深圳交易单元一个。
- (2) 本报告期内无退租交易单元。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

宝盈基金管理有限公司

2017年3月27日