

# 宝盈新锐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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国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。

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。

普华永道中天会计师事务所(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，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 宝盈新锐混合          |
| 基金主代码      | 001543          |
| 交易代码       | 001543          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2015 年 11 月 4 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 | 88,878,649.07 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金以超越业绩比较基准为目标，在严格控制下行风险的基础上进行有效的资产配置与投资标的精选，力争实现 |
|------|--|

|        |   |
|--------|---|
|        | 资产的稳定增值。  |
| 投资策略   | <p>本基金将实施积极主动的投资策略，运用多种方法进行资产配置。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个部分组成。</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>本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式构建备选股票库。</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、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略，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 | 沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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 | 中国银行股份有限公司 |

|         |      |                    |                      |
|---------|------|--------------------|----------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张瑾                 | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 0755-83276688      | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | zhangj@byfunds.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-300       | 95566                |
| 传真      |      | 0755-83515599      | 010-66594942         |

## 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          | 基金管理人办公场所、基金托管人住所 |

## § 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 11 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|---|
| 本期已实现收益       | 4,226,284.83  | 2,058,192.65                              |
| 本期利润          | -3,871,736.26 | 10,408,095.74                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0234       | 0.0256                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.58%        | 3.00%                                     |
| 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  | 0.0242        | 0.0084                                    |
| 期末基金资产净值      | 91,025,683.83 | 279,998,752.58                            |
| 期末基金份额净值      | 1.024         | 1.030                                     |

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。

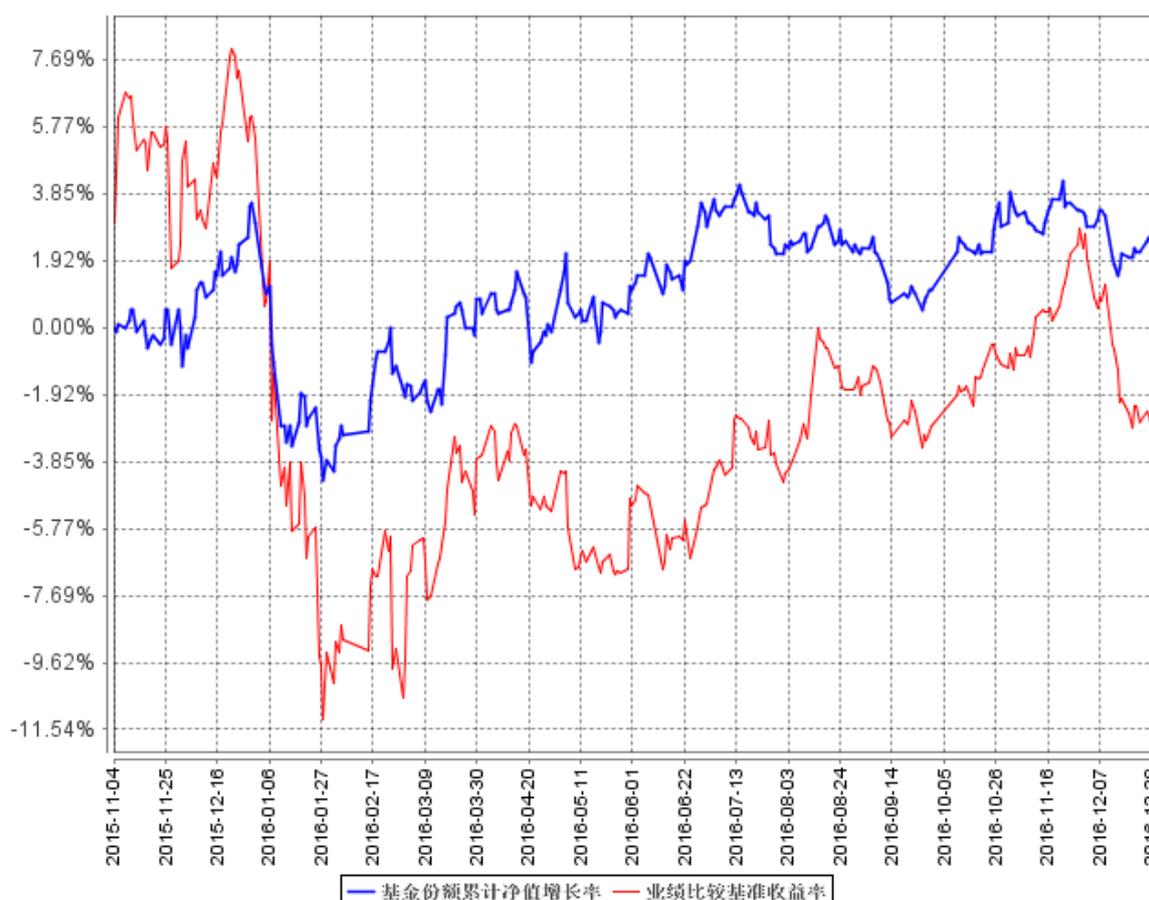
## 3.2 基金净值表现

### 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      | 1.29%    | 0.34%       | 0.34%      | 0.48%         | 0.95%  | -0.14% |
| 过去六个月      | -0.87%   | 0.32%       | 2.75%      | 0.50%         | -3.62% | -0.18% |
| 过去一年       | -0.58%   | 0.47%       | -7.51%     | 0.91%         | 6.93%  | -0.44% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.40%    | 0.47%       | -2.47%     | 0.94%         | 4.87%  | -0.47% |

### 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

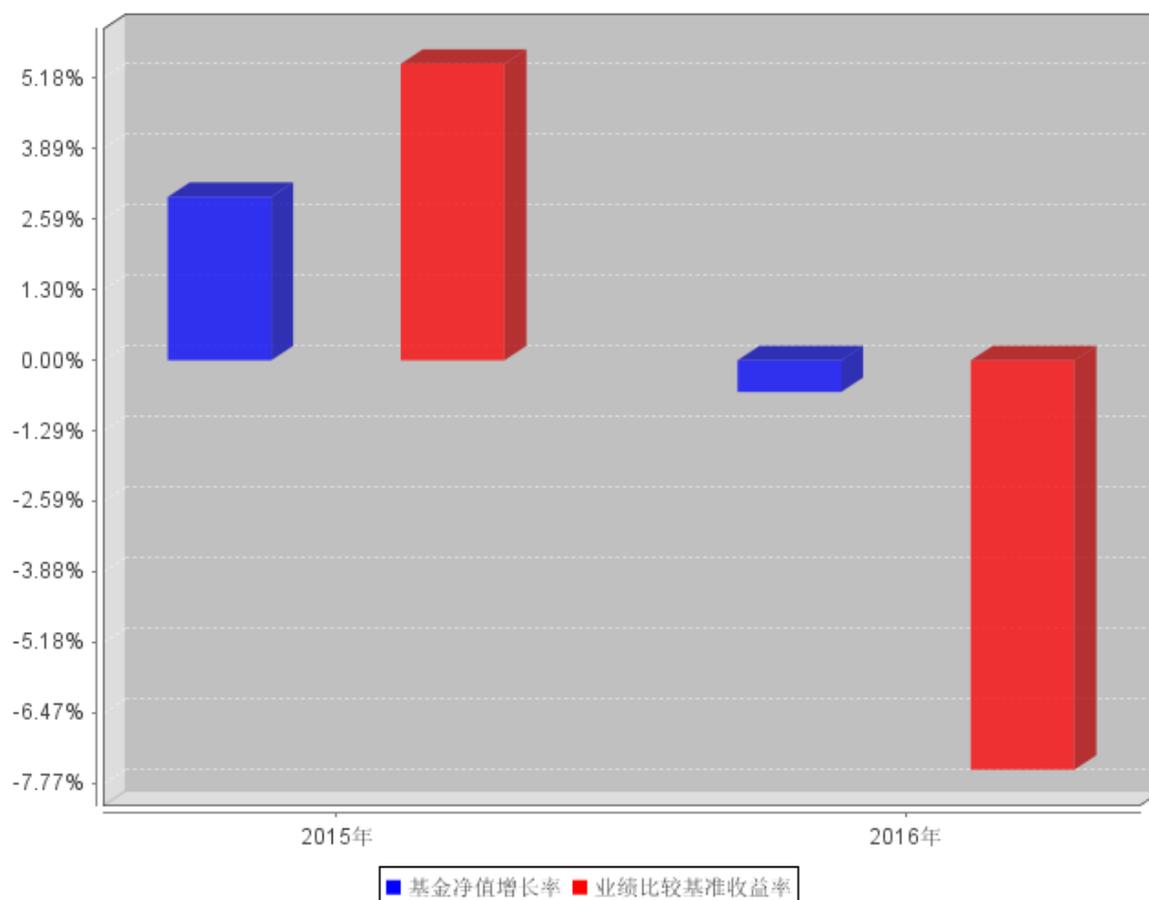


注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

2、本基金合同生效日为 2015 年 11 月 4 日。

### 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



注：本基金合同生效日为 2015 年 11 月 4 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为 2015 年 11 月 4 日，本基金自合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## § 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（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
|     |   | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 盖俊龙 | 本基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 | 2015年11月4日      | -    | 11年    | 盖俊龙先生，经济学硕士。2005年8月至2011年5月，在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011年6月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

注：1、本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

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，上证指数涨跌幅-12.31%、沪深 300 涨跌幅为-11.28%、深成指涨跌幅为-19.64%，同期，创业板指数涨跌幅为-27.71%、中小板指数涨跌幅为-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和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轨交信息化、先进制造、新能源汽车等方向。

#### 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-0.58%，同期业绩比较基准收益率是-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

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，2017 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈新锐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遵规守信、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 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20372 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：宝盈新锐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       | 74,826,216.84           | 199,832,045.92           |
| 结算备付金      | 43,741.35               | 4,364,945.56             |
| 存出保证金      | 38,913.62               | 42,167.28                |
| 交易性金融资产    | 16,438,760.96           | 83,970,787.79            |
| 其中：股票投资    | 16,438,760.96           | 53,967,787.79            |
| 基金投资       | -                       | -                        |
| 债券投资       | -                       | 30,003,000.00            |
| 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    | -                       | 5,232,454.13             |
| 应收利息       | 16,466.01               | 1,780,404.08             |
| 应收股利       | -                       | -                        |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 应收申购款           | 2,007.49           | 1,098,244.15       |
| 递延所得税资产         | -                  | -                  |
| 其他资产            | -                  | -                  |
| 资产总计            | 91,366,106.27      | 296,321,048.91     |
| <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           | 5,059.98           | 15,595,634.87      |
| 应付管理人报酬         | 117,437.34         | 467,728.56         |
| 应付托管费           | 19,572.89          | 77,954.75          |
| 应付销售服务费         | -                  | -                  |
| 应付交易费用          | 78,348.43          | 161,386.52         |
| 应交税费            | -                  | -                  |
| 应付利息            | -                  | -                  |
| 应付利润            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债         | -                  | -                  |
| 其他负债            | 120,003.80         | 19,591.63          |
| 负债合计            | 340,422.44         | 16,322,296.33      |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |                    |
| 实收基金            | 88,878,649.07      | 271,849,159.72     |
| 未分配利润           | 2,147,034.76       | 8,149,592.86       |
| 所有者权益合计         | 91,025,683.83      | 279,998,752.58     |
| 负债和所有者权益总计      | 91,366,106.27      | 296,321,048.91     |

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.024 元，基金份额总额 88,878,649.07

份。于 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 271,849,159.72 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年度和 2015 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈新锐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11月4日(基<br>金合同生效日)至<br>2015年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--|
| 一、收入                   | 265,508.90                      | 11,785,426.00                                      |
| 1. 利息收入                | 1,115,972.17                    | 773,817.49   |
| 其中：存款利息收入              | 1,007,198.32                    | 283,042.87   |
| 债券利息收入                 | 9,534.25                        | 162,082.19   |
| 资产支持证券利息收入             | -                               | -  |
| 买入返售金融资产收入             | 99,239.60                       | 328,692.43   |
| 其他利息收入                 | -                               | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 6,918,699.83                    | 1,939,414.67                                       |
| 其中：股票投资收益              | 6,958,229.58                    | 1,939,414.67                                       |
| 基金投资收益                 | -                               | -  |
| 债券投资收益                 | -117,266.10                     | -  |
| 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                   | 77,736.35                       | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -8,098,021.09                   | 8,349,903.09                                       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                               | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 328,857.99                      | 722,290.75   |

|                            |               |               |
|----------------------------|---------------|---------------|
| <b>减：二、费用</b>              | 4,137,245.16  | 1,377,330.26  |
| 1. 管理人报酬                   | 2,517,731.97  | 957,769.28    |
| 2. 托管费                     | 419,621.94    | 159,628.20    |
| 3. 销售服务费                   | -             | -             |
| 4. 交易费用                    | 852,465.62    | 244,058.43    |
| 5. 利息支出                    | -             | 12,949.90     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -             | 12,949.90     |
| 6. 其他费用                    | 347,425.63    | 2,924.45      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | -3,871,736.26 | 10,408,095.74 |
| 减：所得税费用                    | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | -3,871,736.26 | 10,408,095.74 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新锐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                               |               |                 |
|------------------------------------|----------------------------------|---------------|-----------------|
|                                    | 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）                    | 271,849,159.72                   | 8,149,592.86  | 279,998,752.58  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）           | -                                | -3,871,736.26 | -3,871,736.26   |
| 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）  | -182,970,510.65                  | -2,130,821.84 | -185,101,332.49 |
| 其中：1. 基金申购款                        | 16,872,242.08                    | 136,362.35    | 17,008,604.43   |
| 2. 基金赎回款                           | -199,842,752.73                  | -2,267,184.19 | -202,109,936.92 |
| 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）                        | 88,878,649.07  | 2,147,034.76  | 91,025,683.83   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31<br>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）               | -  | 10,408,095.74 | 10,408,095.74   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 271,849,159.72   | -2,258,502.88 | 269,590,656.84  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 462,079,975.17   | 78,172.96     | 462,158,148.13  |
| 2. 基金赎回款                               | -190,230,815.45  | -2,336,675.84 | -192,567,491.29 |
| 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）                        | 271,849,159.72   | 8,149,592.86  | 279,998,752.58  |

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：

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>李文众</u> | <u>胡坤</u> | <u>何瑜</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

宝盈新锐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[2015]第 1240 号《关于准予宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《宝盈新锐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 458,848,086.17 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道验字(2015)第 1241 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 458,895,271.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 47,185.55 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

#### 7.4.2 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》、《宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度和 2015 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度和 2015 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累

计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

#### 7.4.7 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（以下简称“宝盈基金公司”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 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交易单元进行交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 11 月 4 日(基金合同<br>生效日)至 2015 年 12 月 31 |
|----|---|---|
|    |   |   |

|                 |              | 日          |
|-----------------|--------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,517,731.97 | 957,769.28 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,082,921.17 | 258,870.53 |

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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 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11月4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 | 419,621.94            | 159,628.20                      |

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。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度及上年度未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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11月4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 |
|       |                       |        |                                 |        |

|      |               |              |                |            |
|------|---------------|--------------|----------------|------------|
| 中国银行 | 74,826,216.84 | 1,000,356.74 | 199,832,045.92 | 277,092.31 |
|------|---------------|--------------|----------------|------------|

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 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<br>估值<br>单价 | 复牌<br>日期   | 复牌<br>开盘<br>单价 | 数量<br>(股) | 期末<br>成本总额   | 期末估值总<br>额   | 备注 |
|--------|------|-------------|------|----------------|------------|----------------|-----------|--------------|--------------|----|
| 300450 | 先导智能 | 2016年11月15日 | 重大事项 | 31.21          | 2017年2月8日  | 33.00          | 100,000   | 3,473,651.00 | 3,121,000.00 | -  |
| 300537 | 广信材料 | 2016年10月12日 | 重大事项 | 48.79          | 2017年1月13日 | 43.91          | 1,024     | 9,410.56     | 49,960.96    | -  |

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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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余额。

###### 7.4.9.3.2 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余额。

## § 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 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 16,438,760.96 | 17.99         |
|    | 其中：股票             | 16,438,760.96 | 17.99         |
| 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      | 74,869,958.19 | 81.95         |
| 7  | 其他各项资产            | 57,387.12     | 0.06          |
| 8  | 合计                | 91,366,106.27 | 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              | 16,438,760.96 | 18.06         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -             | -     |
| J | 金融业             | -             | -     |
| K | 房地产业            | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -             | -     |
| P | 教育              | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -             | -     |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 16,438,760.96 | 18.06 |

### 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  | 300097 | 智云股份 | 130,000 | 7,125,300.00 | 7.83         |
| 2  | 000925 | 众合科技 | 250,000 | 6,142,500.00 | 6.75         |
| 3  | 300450 | 先导智能 | 100,000 | 3,121,000.00 | 3.43         |
| 4  | 300537 | 广信材料 | 1,024   | 49,960.96    | 0.05         |

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  | 300342 | 天银机电 | 31,300,700.08 | 11.18          |
| 2  | 600702 | 沱牌舍得 | 15,230,152.03 | 5.44           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 3  | 002355 | 兴民智通 | 14,310,214.56 | 5.11 |
| 4  | 300097 | 智云股份 | 14,057,427.00 | 5.02 |
| 5  | 000925 | 众合科技 | 11,250,133.59 | 4.02 |
| 6  | 002746 | 仙坛股份 | 10,992,088.17 | 3.93 |
| 7  | 300081 | 恒信移动 | 10,689,420.00 | 3.82 |
| 8  | 603023 | 威帝股份 | 10,187,577.90 | 3.64 |
| 9  | 002350 | 北京科锐 | 9,675,350.85  | 3.46 |
| 10 | 600761 | 安徽合力 | 8,348,847.39  | 2.98 |
| 11 | 300375 | 鹏翎股份 | 8,064,308.72  | 2.88 |
| 12 | 002546 | 新联电子 | 7,588,894.00  | 2.71 |
| 13 | 002341 | 新纶科技 | 7,568,608.94  | 2.70 |
| 14 | 002339 | 积成电子 | 7,039,457.50  | 2.51 |
| 15 | 600576 | 万家文化 | 6,738,918.00  | 2.41 |
| 16 | 300206 | 理邦仪器 | 6,346,975.12  | 2.27 |
| 17 | 300429 | 强力新材 | 6,187,883.00  | 2.21 |
| 18 | 300329 | 海伦钢琴 | 5,395,349.00  | 1.93 |
| 19 | 300389 | 艾比森  | 4,846,078.65  | 1.73 |
| 20 | 300202 | 聚龙股份 | 4,781,160.00  | 1.71 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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  | 300342 | 天银机电 | 33,647,310.16 | 12.02           |
| 2  | 300322 | 硕贝德  | 24,148,221.71 | 8.62            |
| 3  | 002546 | 新联电子 | 22,177,734.99 | 7.92            |
| 4  | 002355 | 兴民智通 | 15,645,679.52 | 5.59            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 600702 | 沱牌舍得 | 15,335,517.40 | 5.48 |
| 6  | 002746 | 仙坛股份 | 10,949,371.90 | 3.91 |
| 7  | 603023 | 威帝股份 | 10,674,858.49 | 3.81 |
| 8  | 002350 | 北京科锐 | 10,008,494.72 | 3.57 |
| 9  | 300097 | 智云股份 | 9,173,243.00  | 3.28 |
| 10 | 300375 | 鹏翎股份 | 9,061,203.72  | 3.24 |
| 11 | 300081 | 恒信移动 | 9,016,150.00  | 3.22 |
| 12 | 600865 | 百大集团 | 8,331,011.75  | 2.98 |
| 13 | 600761 | 安徽合力 | 7,874,023.00  | 2.81 |
| 14 | 002341 | 新纶科技 | 7,395,128.23  | 2.64 |
| 15 | 300429 | 强力新材 | 6,884,009.00  | 2.46 |
| 16 | 002339 | 积成电子 | 6,826,356.00  | 2.44 |
| 17 | 300206 | 理邦仪器 | 6,088,740.00  | 2.17 |
| 18 | 600576 | 万家文化 | 6,036,000.00  | 2.16 |
| 19 | 300329 | 海伦钢琴 | 5,622,270.00  | 2.01 |
| 20 | 000925 | 众合科技 | 5,449,435.65  | 1.95 |

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。

#### 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 | 260,223,307.86 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 296,498,277.08 |

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投资。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

## 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

本基金所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   | 38,913.62 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 16,466.01 |
| 5  | 应收申购款   | 2,007.49  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 57,387.12 |

#### 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  | 300450 | 先导智能 | 3,121,000.00 | 3.43          | 重大事项     |
| 2  | 300537 | 广信材料 | 49,960.96    | 0.05          | 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 |
| 1,207        | 73,636.00     | -     | -          | 88,878,649.07 | 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持有本基金 | 296,321.25 | 0.3334%  |

**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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 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11月4日）基金份额总额 | 458,895,271.72 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 271,849,159.72 |
| 本报告期基金总申购份额               | 16,872,242.08  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 199,842,752.73 |
| 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              | 88,878,649.07  |

**§ 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重大人事变动情况如下:

2016 年 12 月, 郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费 40,000 元, 目前事务所为第 1 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|        | 数量 | 成交金额           | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 |   |
|--------|----|----------------|----------------------|------------|----------------|---|
| 平安证券   | 1  | 450,355,938.51 | 81.00%               | 410,409.88 | 81.00%         | - |
| 华创证券   | 1  | 105,608,759.57 | 19.00%               | 96,242.43  | 19.00%         | - |
| 中投证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 广州证券   | 2  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 中银国际证券 | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 浙商证券   | 2  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 华泰证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 中泰证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 兴业证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 瑞银证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 招商证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 申万宏源证券 | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 国泰君安证券 | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 安信证券   | 2  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 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  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 中信证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 天风证券   | 2  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 长城证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 渤海证券   | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 海通证券   | 3  | -              | -                    | -          | -              | - |

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、本基金本报告期内新租广州证券、天风证券、海通证券、浙商证券、中信证券上海交易单元各一个，新租广州证券、天风证券、海通证券、兴业证券、浙商证券、国泰君安证券、华泰证券深圳交易单元各一个。

#### 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

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   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华创证券   | -    | -            | 150,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 中投证券   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 广州证券   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中银国际证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 浙商证券   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中泰证券   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 兴业证券   | -    | -            | -              | -              | -    | -            |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银证券   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 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   | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券   | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券   | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券   | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券   | - | - | - | - | - | - |

宝盈基金管理有限公司

2017年3月27日