

宝盈新价值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：招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。

基金托管人招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。

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	宝盈新价值混合
基金主代码	000574
交易代码	000574
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 10 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,715,339,955.36 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	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权证投资策略四个部分组成。 （一）大类资产配置策略 本基金大类资产配置的策略目标是一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。 （二）股票投资策略 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。 （三）固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、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。 （四）权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	张燕
	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201

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	2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-88,562,519.98	530,409,028.83	37,616,617.64
本期利润	-564,084,492.44	767,452,288.03	84,579,417.33
加权平均基金份额本期利润	-0.2632	0.6404	0.1630
本期基金份额净值增长率	-18.36%	123.09%	15.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3622	0.4103	0.0708
期末基金资产净值	2,394,694,187.32	3,555,795,531.41	695,402,344.25
期末基金份额净值	1.396	1.710	1.153

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

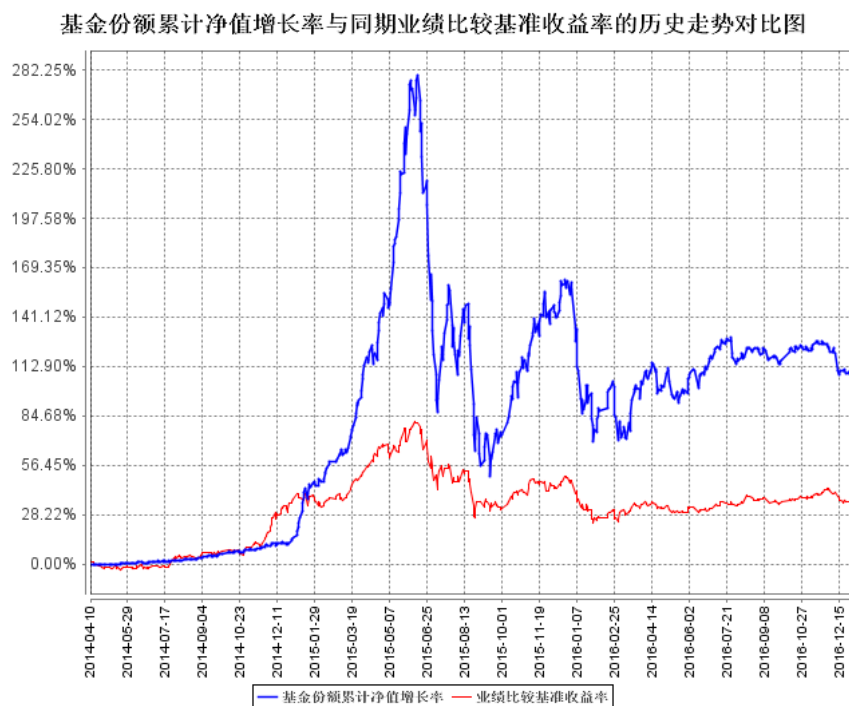
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.92%	0.85%	0.34%	0.48%	-3.26%	0.37%
过去六个月	-3.99%	0.89%	2.75%	0.50%	-6.74%	0.39%
过去一年	-18.36%	2.08%	-7.51%	0.91%	-10.85%	1.17%

自基金合同 生效起至今	109.99%	2.36%	35.77%	1.19%	74.22%	1.17%
----------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

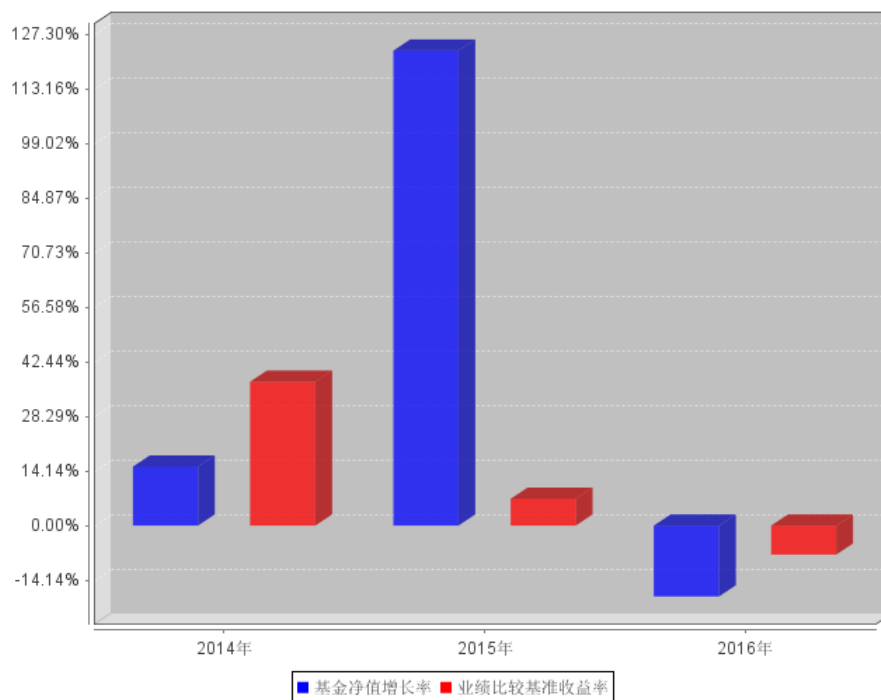
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：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。

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份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	6.8800	165,193,811.95	250,902,679.51	416,096,491.46	
2014	-	-	-	-	
合计	6.8800	165,193,811.95	250,902,679.51	416,096,491.46	

§ 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		
彭敢	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；总经理助理；权益投资部总监	2014年4月10日	—	15年	彭敢先生，金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司权益投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝	2015年1月30日	2016年3月26日	5年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。历任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员，2014年11月起加入宝

	盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理				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、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。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易有 2 次，为不同投资组合因投资策略不同而发生的反向交易，相关投资组合经理按规定履行了审批程序。

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 年度，A 股市场开年第一个月快速、深幅下跌，此后全年呈现为逐步震荡筑底、企稳盘升的态势。报告期内，上证指数涨跌幅-12.31%、沪深 300 涨跌幅-11.28%、中小板指数涨跌幅-22.89%、创业板指数涨跌幅-27.71%。

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。在行业配置上，以规避下行风险、降低组合波动率为目标，主要关注行业周期属性、行业景气度指标等。在选股策略上，对投资股票主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行定量考量，并从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行定性精选。

结合我国经济的宏观基本面，考虑到以“国企改革”为代表的系列改革措施的深化实施，认为 2017 年 A 股市场将震荡走强，整体机会大于 2016 年。

本基金未来对股票的配置基于以下三个标准：第一，行业发展潜力大，相关产业即将或者已经步入景气周期；第二、上市公司业绩确定性高，估值和业绩增速匹配；第三，投资标的具备稀缺属性。

基于上述考虑，本基金将继续坚持本基金将继续重点以个股投资价值判断为主，继续采取自下而上的投资策略。基金管理人将坚持价值投资的理念，现阶段，相对看好大消费、军工、医药、PPP 以及受益于国企改革、经济转型等主题的个股。

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-18.36%，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

当下我国已是全球第二大经济体，全球经济再平衡、人口老龄化到来、劳动力成本持续上升等众多因素都在驱使我国宏观经济的潜在增长率下台阶、都在驱使我们进行产业升级和经济增长模型的调整。我国经济的“新常态”将会持续一个时期，这是事物发展的客观规律，因此我们无需对这一阶段的经济增速过度担忧。相反，经过这一阶段的调整与基础夯实之后，我们相信国家的经济将进入新的健康、持续增长期。

就 2017 年而言，经济将呈现前高后低的格局，房地产与制造业投资预计先稳后下，基建继续稳定较高增速，CPI 中枢上移，通胀压力较大。货币政策保持中性稳健，无风险利率底部震荡。

特朗普在基建、减税、贸易等领域政策有望提振美国增长与通胀，美元进入更快节奏的加息通道。中国面临更大的战略伸展空间和更多的贸易摩擦问题。欧元区国家的政治风险在时间和区域分布上都更广泛，持续的事件冲击不断。

在资产泡沫转移的过程中估值合理的权益类资产将成为首选，港股和 A 股均具有较佳的配置价值。

A 股市场分子端企业盈利向好，分母端改革提升风险偏好，2017 年 A 股有走强的基本面，但由于宏观经济仍处调整阶段，并不支持“系统性牛市”的到来。周期类企业未来两个季度仍受益于低基数效应，工业价格指数上扬带来的利润改善，创业板公司并购活跃，外延式增长可持续。供给侧改革进入新阶段，国企改革以点带面，产权保护促进民间投资，土改激活农业现代化生产，释放城市经济新动能，改革提升风险偏好。业绩成为 2016 年及未来行业投资最主要线索，股市异常波动之后市场风险偏好显著降低，资金集中于估值低、成长稳定的行业，对于景气度高的行业也要关注。

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及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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 20386 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：宝盈新价值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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	131,178,186.98	284,167,357.38
结算备付金	2,999,419.65	14,612,298.10
存出保证金	1,095,933.08	2,535,985.31
交易性金融资产	2,267,360,733.11	3,317,176,999.83
其中：股票投资	2,267,360,733.11	3,289,174,199.83
基金投资	-	-
债券投资	-	28,002,800.00
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	-	-
应收利息	31,094.24	1,676,212.94
应收股利	-	-
应收申购款	763,187.08	33,087,758.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,403,428,554.14	3,653,256,611.71
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	58,333,654.38
应付赎回款	3,446,390.68	26,931,805.32
应付管理人报酬	3,179,571.38	4,188,677.22
应付托管费	529,928.54	698,112.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,322,532.46	7,088,270.01
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	255,943.76	220,560.50
负债合计	8,734,366.82	97,461,080.30
所有者权益：		
实收基金	1,715,339,955.36	2,079,633,886.89
未分配利润	679,354,231.96	1,476,161,644.52
所有者权益合计	2,394,694,187.32	3,555,795,531.41
负债和所有者权益总计	2,403,428,554.14	3,653,256,611.71

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.396 元，基金份额总额 1,715,339,955.36 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈新价值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	上年度可比期间
-----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-492,925,306.08	831,257,615.35
1. 利息收入	2,503,067.55	3,097,202.40
其中：存款利息收入	2,463,890.67	1,338,771.00
债券利息收入	8,898.63	1,758,431.40
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	30,278.25	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-29,781,492.74	555,648,893.20
其中：股票投资收益	-39,869,791.19	553,390,717.68
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-769,490.90	160,309.40
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	10,857,789.35	2,097,866.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-475,521,972.46	237,043,259.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	9,875,091.57	35,468,260.55
减：二、费用	71,159,186.36	63,805,327.32
1. 管理人报酬	44,799,934.52	27,354,815.97
2. 托管费	7,466,655.74	4,559,136.01
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	18,590,048.96	31,434,612.47
5. 利息支出	-	150,872.42
其中：卖出回购金融资产支出	-	150,872.42
6. 其他费用	302,547.14	305,890.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-564,084,492.44	767,452,288.03

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-564,084,492.44	767,452,288.03

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新价值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）	2,079,633,886.89	1,476,161,644.52	3,555,795,531.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-564,084,492.44	-564,084,492.44
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）	-364,293,931.53	-232,722,920.12	-597,016,851.65
其中：1. 基金申购款	1,858,983,124.42	670,059,227.32	2,529,042,351.74
2. 基金赎回款	-2,223,277,055.95	-902,782,147.44	-3,126,059,203.39
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）	1,715,339,955.36	679,354,231.96	2,394,694,187.32
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 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）	602,925,189.87	92,477,154.38	695,402,344.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	767,452,288.03	767,452,288.03
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）	1,476,708,697.02	1,032,328,693.57	2,509,037,390.59
其中：1. 基金申购款	5,783,042,576.89	2,980,602,735.82	8,763,645,312.71
2. 基金赎回款	-4,306,333,879.87	-1,948,274,042.25	-6,254,607,922.12
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）	-	-416,096,491.46	-416,096,491.46
五、期末所有者权益（基金净值）	2,079,633,886.89	1,476,161,644.52	3,555,795,531.41

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	胡坤	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

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》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，股权的股息、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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

7.4.4 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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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：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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,799,934.52	27,354,815.97
其中：支付销售机构的客户维护费	15,380,547.69	8,094,833.44

注：支付基金管理人宝盈基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,466,655.74	4,559,136.01

注：支付基金托管人招商银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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**

份额单位：份

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 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	5,658,743.63	—
期间申购/买入总份额	—	5,658,743.63
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	5,658,743.63	5,658,743.63
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.3300%	0.2700%

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 1 月 1 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
招商银行	131,178,186.98	2,329,072.64	284,167,357.38	1,108,399.98

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.5.7 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。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
300364	中文在线	2016 年 8 月 12 日	2017 年 8 月 15 日	非公开发行流通受限	46.80	39.52	1,434,573	67,138,016.40	56,694,324.96	-
300005	探路者	2016 年 6 月 2 日	2017 年 6 月 6 日	非公开发行流通受限	15.88	16.35	2,700,000	42,876,000.00	44,145,000.00	-
300301	长方集团	2016 年 5 月 17 日	2017 年 5 月 20 日	非公开发行流通受限	7.60	8.24	3,125,000	23,750,000.00	25,750,000.00	-

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	重大资产重组	18.36	2017 年 1 月 6 日	19.00	5,095,146	107,090,414.01	93,546,880.56	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大资产重组	20.04	-	-	3,462,342	87,132,811.30	69,385,333.68	-
002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	重大资产重组	36.49	-	-	1,274,497	41,415,789.05	46,506,395.53	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	15.80	-	-	2,614,861	34,007,787.78	41,314,803.80	-
603308	应流股份	2016 年 11 月 24 日	重大资产重组	21.92	2017 年 2 月 14 日	21.92	1,538,769	38,066,186.15	33,729,816.48	-
300450	先导智能	2016 年 11 月 15 日	重大资产重组	31.21	2017 年 2 月 8 日	33.00	644,300	21,766,384.00	20,108,603.00	-
600711	盛屯矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项停牌	7.02	2017 年 1 月 11 日	7.38	2,845,500	22,354,462.84	19,975,410.00	-
300005	探路者	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	16.69	2017 年 2 月 6 日	15.02	742,516	14,167,294.32	12,392,592.04	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月	重大资产重组	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	440,300	7,498,203.00	6,842,262.00	-

		22 日								
--	--	------	--	--	--	--	--	--	--	--

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

无。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

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 (%)
1	权益投资	2,267,360,733.11	94.34
	其中：股票	2,267,360,733.11	94.34
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	134,177,606.63	5.58
7	其他各项资产	1,890,214.40	0.08
8	合计	2,403,428,554.14	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	40,043,141.72	1.67
B	采矿业	42,727,608.00	1.78

C	制造业	1,640,173,514.49	68.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,703,549.80	0.91
E	建筑业	26,500,000.00	1.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,715,343.54	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,674,090.87	12.51
J	金融业	14,925,000.00	0.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,114,683.55	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	71,486,571.80	2.99
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	80,297,229.34	3.35
S	综合	-	-
	合计	2,267,360,733.11	94.68

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	300252	金信诺	4,732,470	140,601,683.70	5.87
2	002773	康弘药业	2,174,316	123,479,405.64	5.16
3	002368	太极股份	3,370,131	103,159,709.91	4.31
4	300047	天源迪科	5,095,146	93,546,880.56	3.91
5	603589	口子窖	2,884,813	92,689,041.69	3.87
6	603456	九洲药业	3,872,581	83,531,572.17	3.49

7	002522	浙江众成	4,253,506	76,520,572.94	3.20
8	300476	胜宏科技	3,316,611	75,784,561.35	3.16
9	002549	凯美特气	7,043,012	71,486,571.80	2.99
10	600518	康美药业	3,957,100	70,634,235.00	2.95

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	300005	探路者	188,477,040.27	5.30
2	300364	中文在线	145,590,190.91	4.09
3	000558	莱茵体育	138,954,233.59	3.91
4	300367	东方网力	114,785,183.32	3.23
5	300420	五洋科技	113,239,043.76	3.18
6	600887	伊利股份	112,812,937.99	3.17
7	603589	口子窖	103,612,427.55	2.91
8	002368	太极股份	101,558,700.13	2.86
9	600597	光明乳业	100,192,368.76	2.82
10	002675	东诚药业	95,881,659.51	2.70
11	300476	胜宏科技	89,364,860.49	2.51
12	300088	长信科技	88,151,745.25	2.48
13	600338	西藏珠峰	86,042,918.28	2.42
14	600990	四创电子	85,734,941.92	2.41
15	600518	康美药业	84,449,866.80	2.37
16	600458	时代新材	83,244,509.40	2.34
17	600382	广东明珠	78,666,851.88	2.21
18	300322	硕贝德	76,362,941.74	2.15

19	600057	象屿股份	74,477,566.77	2.09
20	002445	中南文化	73,986,155.58	2.08
21	002341	新纶科技	72,411,585.12	2.04

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	300005	探路者	159,747,995.37	4.49
2	300420	五洋科技	147,000,950.69	4.13
3	000558	莱茵体育	139,748,628.24	3.93
4	002445	中南文化	137,018,997.28	3.85
5	300326	凯利泰	122,089,189.93	3.43
6	002341	新纶科技	120,366,717.62	3.39
7	600057	象屿股份	113,324,004.20	3.19
8	600597	光明乳业	103,025,480.15	2.90
9	300463	迈克生物	102,518,493.00	2.88
10	300367	东方网力	100,509,496.00	2.83
11	600382	广东明珠	98,477,886.58	2.77
12	600975	新五丰	94,830,899.18	2.67
13	300322	硕贝德	91,675,980.55	2.58
14	002053	云南能投	87,751,029.23	2.47
15	300071	华谊嘉信	86,919,339.79	2.44
16	600990	四创电子	83,572,902.69	2.35
17	300486	东杰智能	81,586,652.02	2.29
18	002373	千方科技	79,053,144.00	2.22
19	000681	视觉中国	78,459,186.64	2.21

20	600198	大唐电信	78,304,976.62	2.20
21	300364	中文在线	75,908,703.45	2.13
22	002047	宝鹰股份	75,063,374.59	2.11
23	600358	国旅联合	74,927,041.62	2.11
24	002587	奥拓电子	72,513,047.28	2.04

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	5,905,676,335.71
卖出股票收入（成交）总额	6,411,331,347.88

注：买入股票成本（成交）总额与卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，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	1,095,933.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,094.24
5	应收申购款	763,187.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,890,214.40

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	93,546,880.56	3.91	重大资产重组

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 (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
58,408	29,368.24	186,167,328.43	10.85%	1,529,172,626.93	89.15%

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	1,135,142.06	0.0662%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2014 年 4 月 10 日) 基金份额总额	433,920,136.81
本报告期期初基金份额总额	2,079,633,886.89
本报告期基金总申购份额	1,858,983,124.42
减:本报告期基金总赎回份额	2,223,277,055.95
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	1,715,339,955.36
-------------	------------------

§ 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。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 90,000 元，目前事务所已连续 3 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	
安信证券	2	1,859,136,373.11	15.27%	1,694,235.32	15.27%	—
光大证券	2	1,847,731,329.45	15.17%	1,683,841.95	15.17%	—
申万宏源	2	1,803,940,936.82	14.81%	1,643,940.20	14.81%	—
中信证券	1	1,756,331,177.33	14.42%	1,600,545.02	14.42%	—
方正证券	2	1,599,396,061.74	13.13%	1,457,532.41	13.13%	—
国信证券	2	1,437,505,137.57	11.80%	1,309,998.42	11.80%	—
海通证券	2	750,808,067.72	6.16%	684,212.32	6.16%	—
中银国际	1	676,527,291.80	5.56%	616,522.56	5.56%	—
招商证券	2	233,104,926.21	1.91%	212,428.90	1.91%	—
兴业证券	1	214,115,300.00	1.76%	195,123.91	1.76%	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (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席
位租用协议。

2、席位变更情况

(1) 租用交易单元情况

本基金本报告期内无租用交易单元。

(2) 退租交易单元情况

本基金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

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司

2017 年 3 月 27 日