

# 宝盈国家安全战略沪港深股票型 证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金
基金简称	宝盈国家安全沪港深股票
基金主代码	001877
交易代码	001877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 20 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	138,077,710.95 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
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，并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服务；（3）信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算</p>

	<p>机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。</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	<p>沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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。</p> <p>本基金除了投资于 A 股市场，还可以在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港股票市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

### 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
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区 报业大厦 1501	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市福田区福华 一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518034	100818
法定代表人	李文众	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-28,510,480.12
本期利润	-18,943,785.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1260
本期加权平均净值利润率	-12.01%
本期基金份额净值增长率	-11.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,624,664.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0118
期末基金资产净值	136,453,046.03



期末基金份额净值	0.988
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.20%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

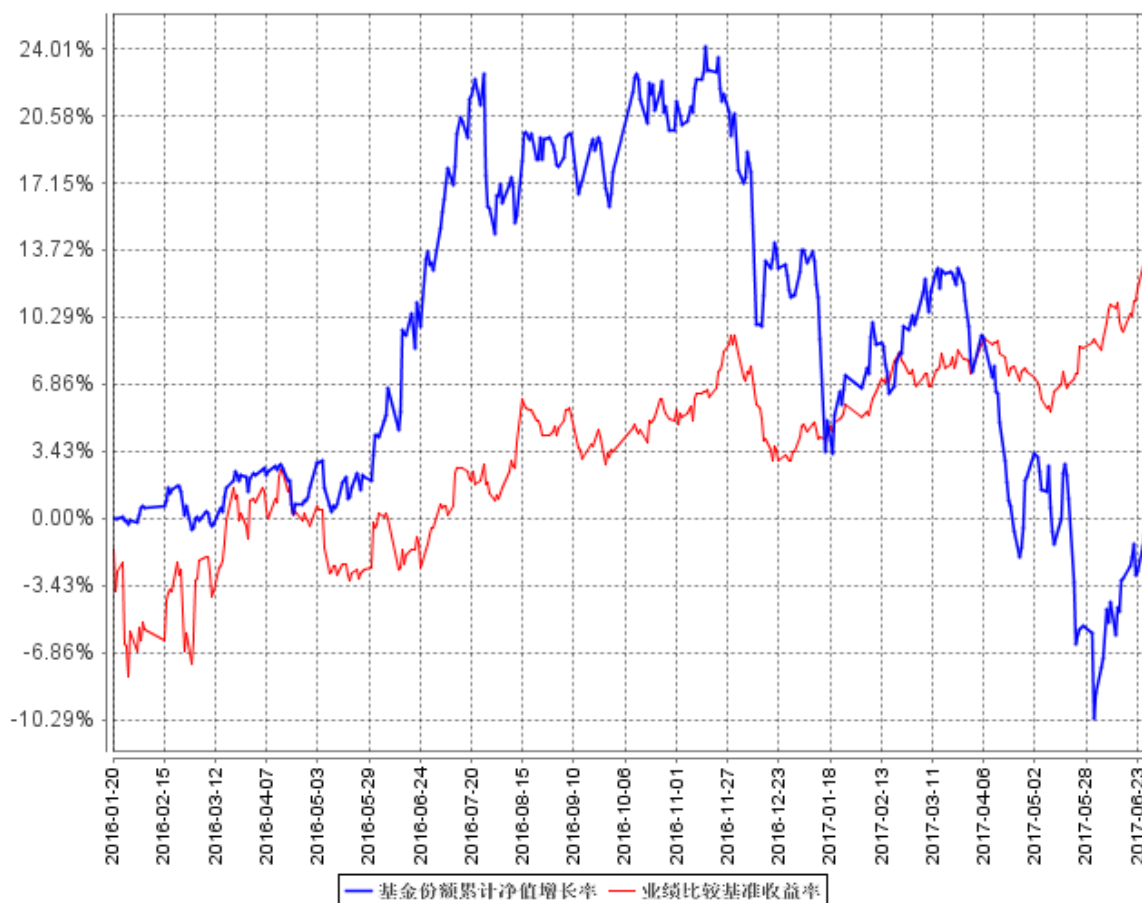
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.99%	1.53%	3.57%	0.49%	1.42%	1.04%
过去三个月	-8.09%	1.44%	4.77%	0.45%	-12.86%	0.99%
过去六个月	-11.31%	1.28%	9.14%	0.42%	-20.45%	0.86%
过去一年	-12.64%	1.21%	13.46%	0.50%	-26.10%	0.71%
自基金合同生效起至今	-1.20%	1.09%	12.87%	0.75%	-14.07%	0.34%

### 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：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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞养老混合、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、宝盈消费主题混合（由

原基金鸿阳转型而来)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		
易祚兴	本基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选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、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	2016年 6月30 日	-	6年	易祚兴先生,浙江大学计算机应用硕士。曾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,自2014年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部研究员;宝盈策略增长混合型证券投资基金、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、宝盈新价值灵活配置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基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
张小仁	本基金基金经理、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金	2016年 1月20 日	2017 年3月 8日	10年	张小仁先生,中山大学经济学硕士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

	基金经理				
--	------	--	--	--	--

注：1. 张小仁为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2. 易祚兴非首任基金经理，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 2017 年 6 月 30 日。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年市场整体向好，上证指数涨幅为 2.86%、沪深 300 涨幅为 10.78%、深成指涨幅为 3.46%，同期，创业板指跌幅为 7.34%，中小板指数涨幅为 7.33%；整体来看除了创业板指数较为疲软以外，整体指数走势较为强劲。

本基金管理人认为，市场一直按照其内在的逻辑规律运行，虽然短期会被各种噪音所干扰，但中长期来看，市场运行规律还是源自其所处的宏观和政策环境。本基金管理人在一季度就提到，每年的第一季度往往代表着全年的参与热情，整体出现了多个板块走势强劲局面，白酒、家电、

建材、钢铁、电子板块走势不错。过去的二季度，白酒、家电及电子白马龙头依然加速向上，而其他近 3000 只个股处于下行通道之中，看不到企稳反弹迹象。因此本基金管理人需要重新审视市场的内在逻辑发生了哪些变化！

首先，可以回顾上一轮中小创辉煌时候的宏观政策环境：有 4 万亿的政策刺激，国内经济快速触底反弹，GDP 增速基本维持在 9% 的均值区间。但本届政府上台后，反腐败、调结构，GDP 增速有所放缓，2012 年只有 7.65% 的增速，而且此后一路缓慢下滑。一句话概括，实际 GDP 增速从 9% 这个平台逐步回落至 6.5% 的新平台，并且伴随着 PPI（去产能）与 CPI（反三公消费）的不断走低，以及市场利率在 2012-2013 年走高并触及 4% 的高位。这种大环境下，以周期板块为主的大盘蓝筹业绩不断回落，产能过剩，资产贬值，负债走高，因此估值不断降低，形成了戴维斯双杀。

同时，当时市场的中小创情况则截然不同，第一，创业板指自 2009 年成立以来一直下跌，腰斩至 600 点，估值从也得到了合理修复；第二，整体性市值偏低；第三，2012 年底 IPO 暂停，使得市场供给受限；第四，政策极力推崇并购重组转型，借壳上市、双主业、业绩对赌经典案例层出不穷；第五，国内形成“大众创业、万众创新”的大宏观氛围，同时结合全球科技创新大周期传导至国内的背景（苹果等智能手机更新迭代加速、4G 普及、云计算等）；第六，银行资金通过配资大量涌入 A 股、涨停板敢死队及锁仓模式形成娴熟完善的操作模式。因此，当时蓝筹业绩总是不达预期，资金不断抽离主板，趋利性的选择中小创的股票，形成了当时市场的运行规律。

既然市场规律必然是宏观经济规律，那么近半年内在驱动规律又发生了哪些变化呢？本基金管理人痛定思痛，再次梳理了去年四季度至今年上半年的宏观经济变化和市场板块走势，发现宏观经济层面，出现了大反转。首先，传统大宗价格企稳反弹（煤炭、钢铁等），得益于过去供给侧改革落到实处；其次，出口、地产、PPI 数据等持续超出市场一致预期，2017 年一季度实际/名义 GDP 增速为 6.9%/11.8%，4 月份 CPI 同比增长 1.2%，PPI 同比增长 6.4%。这类数据表明企业盈利的改善和补库存需求提升，这些都是基本经济学规律中典型的经济回暖初期特征。市场层面，IPO 发行速度已经常态化，退市制度落到实处、市场真正实现了优胜劣汰。行业层面，过去几年经济底部震荡，金融加速去杠杆等，驱使大多数行业洗牌加剧，一些行业集中度在提升，利润加速向行业龙头企业集中，行业马太效应出现了。这类行业的典型代表是白酒、家电、钢铁、煤炭、地产等龙头公司，业绩明显回升、负债率稳步下降。资金层面，金融产品去杠杆化、打击配资、减持新规等等，市场基本处于存量博弈过程，中小创流动性泛滥已经过去。

本基金管理人认为，市场的规律已经发生了与过去四年截然不同的变化，市场规则也顺应了全球的变化，深港通之后逐渐的市场人心也发生了变化，投资理念快速向国际接轨，第二季度，聪明的市场参与者都在快速向优质龙头公司配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.988 元, 本基金在本报告期内净值增长率是-11.31%, 同期业绩比较基准收益率是 9.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来, 本基金管理人认为, 首先下半年市场无需悲观, 可以积极布局秋季行情, 预计下半年流动性和监管政策将边际改善, 同时 MSCI 落地, 十九大的召开等, 第三季度的秋季行情值得期待。行业方向上, 以中小创为主的成长性板块依然还是整体性偏贵, 但令人欣喜的是可以发掘很多估值处于历史底部的 TMT 个股, 长期成长性不错, 但需要耐心布局; 同时, 很多周期行业(煤炭、钢铁、航运等)受宏观经济回暖, 板块业绩存在超预期可能; 另外, 大消费是永恒的价值投资区域, 白酒、家电等代表着 A 股资本市场的全球竞争力, 历史估值依然不贵, 值得加强配置; 最后, 还需要重视国内金融格局变化中保险、银行和券商的新机遇, 尤其是保险随着牌照限制、利好政策不断、行业回归本源等, 竞争格局在向着优质龙头汇聚。

本基金管理人上半年未能及时的调整到大盘优质蓝筹中去, 一方面由于国家安全基金本身是主题性质基金, 需要在 TMT、新能源、国防军工等相关板块占配置比例 80%以上; 另一方面, 也是本基金管理人对整个宏观经济大环境判断滞后, 接下来会及时调整投资思路, 紧跟市场脉络, 拥抱优质成长龙头公司。虽然短期未能产生正收益, 但国家安全基金依然会坚持积极布局龙头优质公司, 努力为持有人获取较好的收益。

#### 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各方之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

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

## **§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）**

### **6.1 资产负债表**

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,071,404.72	8,505,418.49
结算备付金		743,860.04	1,927,274.83
存出保证金		110,080.27	176,450.43
交易性金融资产	6.4.7.2	128,976,374.97	168,285,416.77
其中：股票投资		128,904,596.97	168,212,189.77
基金投资		-	-
债券投资		71,778.00	73,227.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,271,614.10	3,125,019.05
应收利息	6.4.7.5	4,833.07	7,302.05
应收股利		-	-
应收申购款		169,495.60	206,177.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		139,347,662.77	182,233,058.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,043,464.75	1,873,739.98



应付赎回款		896,828.82	929,617.91
应付管理人报酬		163,206.17	233,469.65
应付托管费		27,201.04	38,911.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	499,262.41	1,053,932.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	264,653.55	116,116.49
负债合计		2,894,616.74	4,245,787.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	138,077,710.95	159,724,523.33
未分配利润	6.4.7.10	-1,624,664.92	18,262,747.47
所有者权益合计		136,453,046.03	177,987,270.80
负债和所有者权益总计		139,347,662.77	182,233,058.64

注：报告截止 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.988 元，基金份额总额 138,077,710.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 20 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-14,923,923.13	33,115,222.96
1.利息收入		57,495.22	790,650.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,468.02	568,789.38
债券利息收入		2,027.20	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	221,861.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,714,623.00	19,116,876.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-25,017,774.59	18,702,392.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	303,151.59	414,483.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,566,694.86	12,575,017.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	166,509.79	632,678.37
<b>减：二、费用</b>		4,019,862.13	3,368,671.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,175,211.73	1,762,924.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	195,868.60	293,820.87
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,465,296.86	1,151,790.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	183,484.94	160,134.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,943,785.26	29,746,551.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,943,785.26	29,746,551.49

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	159,724,523.33	18,262,747.47	177,987,270.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,943,785.26	-18,943,785.26
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)	-21,646,812.38	-943,627.13	-22,590,439.51
其中：1.基金申购款	46,258,231.82	1,935,318.94	48,193,550.76
2.基金赎回款	-67,905,044.20	-2,878,946.07	-70,783,990.27
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)	138,077,710.95	-1,624,664.92	136,453,046.03
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	291,448,737.30	-	291,448,737.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,746,551.49	29,746,551.49
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)	-126,186,688.38	-8,176,671.50	-134,363,359.88
其中：1.基金申购款	70,079,466.62	2,048,320.58	72,127,787.20
2.基金赎回款	-196,266,155.00	-10,224,992.08	-206,491,147.08
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)	165,262,048.92	21,569,879.99	186,831,928.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_张啸川\_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_丁宁\_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_何瑜\_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（以下简称“宝盈国家安全沪港深股票”）。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】1995号《关于准予宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的批复》，由宝盈基金管理有限公司根据经批准的《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》和《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金招募说明书》向社会公开募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，并出具普华永道中天验字（2016）第075号验资报告。经向中国证监会备案，《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》于2016年1月20日正式生效。本基金为

契约开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2015 年 12 月 21 日至 2016 年 1 月 15 日止，首次发售募集有效认购金额为人民币 291,375,943.50 元，折合 291,375,943.50 份基金份额；有效资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 72,793.80 元，折合 72,793.80 份基金份额；以上收到的资金共计人民币 291,448,737.30 元，折合 291,448,737.30 份基金份额。本基金管理人为宝盈基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，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》、《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括：本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，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核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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。

基金的投资组合比例为：股票（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票）投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈国家安全沪港深股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.1 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.2.2 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。

##### 6.4.2.3 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。

### 6.4.3 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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) 对于内地投资者持有的基金类别，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)对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(5)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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,071,404.72
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,071,404.72

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	132,082,589.60	128,904,596.97	-3,177,992.63

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	75,618.00	71,778.00	-3,840.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	75,618.00	71,778.00	-3,840.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		132,158,207.60	128,976,374.97	-3,181,832.63

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,439.41
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	334.73
应收债券利息	2,004.80
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.39
应收黄金合约拆借孳息	-



其他	49.74
合计	4,833.07

#### 6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	499,262.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	499,262.41

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付赎回费	1,090.84
预提费用	263,562.71
合计	264,653.55

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	159,724,523.33	159,724,523.33
本期申购	46,258,231.82	46,258,231.82
本期赎回(以“-”号填列)	-67,905,044.20	-67,905,044.20
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	138,077,710.95	138,077,710.95

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,901,247.23	-17,638,499.76	18,262,747.47
本期利润	-28,510,480.12	9,566,694.86	-18,943,785.26
本期基金份额交易产生的变动数	-2,549,864.19	1,606,237.06	-943,627.13
其中：基金申购款	5,775,504.65	-3,840,185.71	1,935,318.94
基金赎回款	-8,325,368.84	5,446,422.77	-2,878,946.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,840,902.92	-6,465,567.84	-1,624,664.92

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	39,905.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,223.66
其他	1,339.35
合计	55,468.02

#### 6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	818,250,633.45
减：卖出股票成本总额	843,268,408.04
买卖股票差价收入	-25,017,774.59

#### 6.4.4.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.4.14 贵金属投资收益

本基金报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.4.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	303,151.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	303,151.59

#### 6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,566,694.86
——股票投资	9,568,143.86
——债券投资	-1,449.00
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,566,694.86

#### 6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	134,841.90
基金转换费收入	31,667.89
合计	166,509.79

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,465,137.22
银行间市场交易费用	-
港股通证券组合费	159.64
合计	2,465,296.86

#### 6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
----	----------------------------

审计费用	24,795.19
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	9,922.23
合计	183,484.94

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

本基金无需披露的或有事项。

##### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.7.2 关联方报酬

###### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月20日(基金合同生效日)至2016年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	1,175,211.73	1,762,924.97
其中：支付销售机构的客户维护费	577,453.93	741,389.32

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 1.50%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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月20日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	195,868.60	293,820.87

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.7.3 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通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内以及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	8,071,404.72	39,905.01	16,756,650.82	558,311.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.7.7 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。

#### 6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户参与认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 6.4.9.2 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
300364	中文在线	2017年2月13日	重大事项	33.43	-	-	357,396	13,139,298.94	11,947,748.28	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

#### 6.4.10 金融工具风险及管理

##### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票（包括港股通标的股票）、以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程



中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

#### 6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.10.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,071,404.72	-	-	-	8,071,404.72
结算备付金	743,860.04	-	-	-	743,860.04

存出保证金	110,080.27	-	-	-	110,080.27
交易性金融资产	-	71,778.00	-	-128,904,596.97	128,976,374.97
应收证券清算款	-	-	-	1,271,614.10	1,271,614.10
应收利息	-	-	-	4,833.07	4,833.07
应收申购款	-	-	-	169,495.60	169,495.60
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,925,345.03	71,778.00	-	-130,350,539.74	139,347,662.77
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,043,464.75	1,043,464.75
应付赎回款	-	-	-	896,828.82	896,828.82
应付管理人报酬	-	-	-	163,206.17	163,206.17
应付托管费	-	-	-	27,201.04	27,201.04
应付交易费用	-	-	-	499,262.41	499,262.41
其他负债	-	-	-	264,653.55	264,653.55
负债总计	-	-	-	2,894,616.74	2,894,616.74
利率敏感度缺口	8,925,345.03	71,778.00	-	-127,455,923.00	136,453,046.03
上年度末					
2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,505,418.49	-	-	-	8,505,418.49
结算备付金	1,927,274.83	-	-	-	1,927,274.83
存出保证金	176,450.43	-	-	-	176,450.43
交易性金融资产	-	73,227.00	-	-168,212,189.77	168,285,416.77
应收证券清算款	-	-	-	3,125,019.05	3,125,019.05
应收利息	-	-	-	7,302.05	7,302.05
应收申购款	-	-	-	206,177.02	206,177.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,609,143.75	73,227.00	-	-171,550,687.89	182,233,058.64
负债					

应付证券清算款	-	-	-	1,873,739.98	1,873,739.98
应付赎回款	-	-	-	929,617.91	929,617.91
应付管理人报酬	-	-	-	233,469.65	233,469.65
应付托管费	-	-	-	38,911.58	38,911.58
应付交易费用	-	-	-	1,053,932.23	1,053,932.23
其他负债	-	-	-	116,116.49	116,116.49
负债总计	-	-	-	4,245,787.84	4,245,787.84
利率敏感度缺口	10,609,143.75	73,227.00	-	167,304,900.05	177,987,270.80

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

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.05%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中，股票（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票）投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战

略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	128,904,596.97	94.47	168,212,189.77	94.51
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	128,904,596.97	94.47	168,212,189.77	94.51

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2017 年 6 月 30 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	4,365,012.01	2,973,387.00
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-4,365,012.01	-2,973,387.00

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入

基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	128,904,596.97	92.51
	其中：股票	128,904,596.97	92.51
2	固定收益投资	71,778.00	0.05
	其中：债券	71,778.00	0.05
	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	8,815,264.76	6.33
7	其他各项资产	1,556,023.04	1.12
8	合计	139,347,662.77	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	59,042,516.29	43.27
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	44,882,776.58	32.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,848,181.42	6.48
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	11,947,748.28	8.76
S	综合	-	-
	合计	124,721,222.57	91.40

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	4,183,374.40	3.07

合计	4,183,374.40	3.07
----	--------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300188	美亚柏科	757,024	13,088,944.96	9.59
2	300038	梅泰诺	308,600	13,069,210.00	9.58
3	002745	木林森	345,300	12,910,767.00	9.46
4	300545	联得装备	170,000	12,291,000.00	9.01
5	300364	中文在线	357,396	11,947,748.28	8.76
6	300456	耐威科技	255,000	9,506,400.00	6.97
7	300058	蓝色光标	1,131,481	8,848,181.42	6.48
8	300212	易华录	350,000	8,830,500.00	6.47
9	300613	富瀚微	48,800	8,355,048.00	6.12
10	300315	掌趣科技	1,005,900	8,208,144.00	6.02
11	002555	三七互娱	250,000	6,392,500.00	4.68
12	600990	四创电子	70,000	4,339,300.00	3.18
13	H02333	长城汽车	500,000	4,183,374.40	3.07
14	300241	瑞丰光电	322,900	4,126,662.00	3.02
15	300219	鸿利智汇	200,000	2,652,000.00	1.94
16	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
17	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
18	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
19	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
20	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
21	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
22	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01



23	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
----	--------	------	-----	----------	------

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300613	富瀚微	31,917,012.00	17.93
2	002174	游族网络	29,145,370.44	16.37
3	600373	中文传媒	23,759,355.79	13.35
4	300188	美亚柏科	23,625,461.37	13.27
5	300545	联得装备	21,502,274.45	12.08
6	603816	顾家家居	17,402,476.84	9.78
7	300315	掌趣科技	16,852,000.43	9.47
8	300456	耐威科技	15,858,450.24	8.91
9	600293	三峡新材	15,833,785.09	8.90
10	300212	易华录	14,722,395.95	8.27
11	002555	三七互娱	14,546,892.69	8.17
12	603703	盛洋科技	14,276,664.00	8.02
13	300075	数字政通	13,838,008.12	7.77
14	300170	汉得信息	13,613,736.58	7.65
15	002745	木林森	13,579,363.97	7.63
16	300120	经纬电材	13,310,959.03	7.48
17	300364	中文在线	13,139,298.94	7.38
18	300473	德尔股份	13,072,451.52	7.34
19	300207	欣旺达	12,755,734.38	7.17
20	601118	海南橡胶	12,625,728.58	7.09
21	300619	金银河	12,489,245.00	7.02
22	300097	智云股份	12,149,607.14	6.83

23	601900	南方传媒	12,135,007.32	6.82
24	002522	浙江众成	11,729,814.10	6.59
25	002496	辉丰股份	11,530,158.00	6.48
26	600598	北大荒	11,477,913.27	6.45
27	300298	三诺生物	10,868,590.43	6.11
28	H00400	科通芯城	10,480,240.68	5.89
29	300589	江龙船艇	10,310,308.11	5.79
30	300236	上海新阳	10,212,256.25	5.74
31	603444	吉比特	9,799,777.00	5.51
32	H02333	长城汽车	9,588,282.87	5.39
33	300113	顺网科技	9,531,973.41	5.36
34	600995	文山电力	9,289,416.00	5.22
35	603377	东方时尚	9,288,875.90	5.22
36	300038	梅泰诺	9,247,868.40	5.20
37	300058	蓝色光标	8,960,245.42	5.03
38	600104	上汽集团	8,807,189.78	4.95
39	600108	亚盛集团	8,242,694.00	4.63
40	000630	铜陵有色	8,037,841.00	4.52
41	002439	启明星辰	7,917,572.90	4.45
42	000157	中联重科	7,725,663.81	4.34
43	601628	中国人寿	7,565,947.90	4.25
44	000581	威孚高科	7,357,537.00	4.13
45	002833	弘亚数控	6,917,439.00	3.89
46	300334	津膜科技	6,749,409.00	3.79
47	600029	南方航空	6,607,488.00	3.71
48	002340	格林美	6,519,688.00	3.66
49	300605	恒锋信息	6,445,390.54	3.62
50	600021	上海电力	6,413,826.64	3.60

51	002373	千方科技	6,269,770.74	3.52
52	601009	南京银行	6,068,200.00	3.41
53	002440	闰土股份	6,042,689.01	3.40
54	600819	耀皮玻璃	5,977,749.00	3.36
55	600894	广日股份	5,368,227.00	3.02
56	601111	中国国航	4,836,437.00	2.72
57	H00604	深圳控股	4,805,965.19	2.70
58	600068	葛洲坝	4,741,204.00	2.66
59	603336	宏辉果蔬	4,683,134.00	2.63
60	603337	杰克股份	4,668,401.40	2.62
61	000797	中国武夷	4,573,673.12	2.57
62	300525	博思软件	4,402,538.00	2.47
63	600990	四创电子	4,371,942.58	2.46
64	600262	北方股份	4,264,352.00	2.40
65	300308	中际装备	4,238,521.06	2.38
66	600782	新钢股份	4,203,000.00	2.36
67	600581	八一钢铁	4,083,882.00	2.29
68	300588	熙菱信息	4,081,764.00	2.29
69	300241	瑞丰光电	3,997,562.00	2.25
70	000063	中兴通讯	3,973,753.45	2.23
71	600893	航发动力	3,718,569.00	2.09

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

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002174	游族网络	33,263,250.41	18.69

2	300613	富瀚微	23,982,478.40	13.47
3	600373	中文传媒	23,938,373.75	13.45
4	300236	上海新阳	22,343,905.70	12.55
5	300525	博思软件	20,529,407.60	11.53
6	603816	顾家家居	17,556,585.91	9.86
7	300118	东方日升	16,779,974.08	9.43
8	000058	深赛格	16,555,942.99	9.30
9	002655	共达电声	15,709,333.74	8.83
10	300071	华谊嘉信	15,195,827.02	8.54
11	603703	盛洋科技	14,954,443.79	8.40
12	300456	耐威科技	14,697,690.16	8.26
13	600293	三峡新材	14,161,192.57	7.96
14	300075	数字政通	13,790,041.27	7.75
15	300170	汉得信息	13,539,255.38	7.61
16	300207	欣旺达	13,113,639.80	7.37
17	002522	浙江众成	13,075,146.61	7.35
18	300473	德尔股份	13,025,963.33	7.32
19	601118	海南橡胶	12,390,469.78	6.96
20	300038	梅泰诺	12,362,269.29	6.95
21	601900	南方传媒	11,859,392.68	6.66
22	300120	经纬电材	11,701,952.30	6.57
23	002496	辉丰股份	11,649,601.70	6.55
24	600598	北大荒	11,563,782.18	6.50
25	300450	先导智能	11,409,946.00	6.41
26	300298	三诺生物	11,361,533.16	6.38
27	300097	智云股份	11,218,558.00	6.30
28	300589	江龙船艇	11,135,226.05	6.26
29	002617	露笑科技	10,568,169.98	5.94

30	300619	金银河	10,543,580.00	5.92
31	300188	美亚柏科	9,926,953.62	5.58
32	300545	联得装备	9,835,293.72	5.53
33	600995	文山电力	9,667,738.00	5.43
34	300113	顺网科技	9,507,014.87	5.34
35	603444	吉比特	9,275,934.00	5.21
36	603377	东方时尚	9,030,067.00	5.07
37	600104	上汽集团	8,644,159.01	4.86
38	002439	启明星辰	8,635,965.25	4.85
39	600108	亚盛集团	8,380,000.00	4.71
40	002555	三七互娱	8,003,023.00	4.50
41	000157	中联重科	7,998,916.76	4.49
42	300315	掌趣科技	7,914,200.00	4.45
43	000630	铜陵有色	7,907,926.14	4.44
44	601628	中国人寿	7,474,302.00	4.20
45	002833	弘亚数控	7,406,413.40	4.16
46	H00400	科通芯城	7,220,084.02	4.06
47	000581	威孚高科	7,181,038.72	4.03
48	600029	南方航空	6,816,233.00	3.83
49	002340	格林美	6,772,500.00	3.81
50	600267	海正药业	6,671,089.00	3.75
51	300334	津膜科技	6,503,739.00	3.65
52	002373	千方科技	6,466,663.79	3.63
53	300605	恒锋信息	6,446,421.88	3.62
54	600021	上海电力	6,419,180.28	3.61
55	002440	闰土股份	6,161,548.69	3.46
56	601009	南京银行	6,103,911.78	3.43
57	600819	耀皮玻璃	5,600,303.00	3.15

58	601111	中国国航	5,103,198.00	2.87
59	600894	广日股份	4,872,248.14	2.74
60	603337	杰克股份	4,806,589.92	2.70
61	H00604	深圳控股	4,777,423.82	2.68
62	600262	北方股份	4,661,258.00	2.62
63	300308	中际装备	4,573,954.04	2.57
64	600068	葛洲坝	4,523,860.60	2.54
65	H02333	长城汽车	4,506,565.28	2.53
66	000797	中国武夷	4,411,249.35	2.48
67	300348	长亮科技	4,402,861.00	2.47
68	600581	八一钢铁	4,378,565.00	2.46
69	300588	熙菱信息	4,245,365.00	2.39
70	603336	宏辉果蔬	4,081,666.00	2.29
71	600782	新钢股份	3,936,000.00	2.21
72	000063	中兴通讯	3,735,784.40	2.10
73	600893	航发动力	3,728,548.00	2.09
74	603881	数据港	3,651,561.99	2.05

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	794,392,671.38
卖出股票收入（成交）总额	818,250,633.45

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,778.00	0.05
	其中：政策性金融债	71,778.00	0.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	71,778.00	0.05

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开 1302	700	71,778.00	0.05

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	110,080.27
2	应收证券清算款	1,271,614.10
3	应收股利	-
4	应收利息	4,833.07
5	应收申购款	169,495.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,556,023.04



### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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	300364	中文在线	11,947,748.28	8.76	重大事项

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
6,612	20,882.90	2,482,682.72	1.80%	135,595,028.23	98.20%

### 8.2 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	20,713.40	0.0150%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月20日）基金份额总额	291,448,737.30
本报告期期初基金份额总额	159,724,523.33
本报告期基金总申购份额	46,258,231.82
减：本报告期基金总赎回份额	67,905,044.20
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	138,077,710.95

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

（1）根据宝盈基金管理有限公司第四届董事会第六次现场会议决议，同意张新元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，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

（2）根据宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十六次临时会议决议，同意汪钦辞去总经理职务，在新聘总经理聘任到位之前，暂由公司董事长李文众先生代为履行公司总经理相关职责。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报告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）根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第一次现场会议决议，同意张啸川先生任宝盈基金管理有限公司总经理，丁宁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，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

（4）宝盈基金管理有限公司原独立董事贺颖奇、屈文洲先生任职届满，不再担任公司独立董事。根据宝盈基金管理有限公司股东会 2017 年第一次现场会议，同意张苏彤、廖振中和王艳艳担任宝盈基金管理有限公司独立董事，拟任公司总经理张啸川先生担任宝盈基金管理有限公司经营管理层董事，同意刘郁飞担任宝盈基金管理有限公司股东监事、魏玲玲和汪兀担任宝盈基金管理有限公司职工监事。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报告以及向中国证券投资基金业协会报备。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	546,679,776.08	33.92%	498,190.30	33.82%	-
天风证券	2	484,067,857.14	30.04%	441,133.48	29.95%	-
华泰证券	1	249,381,222.42	15.48%	227,260.72	15.43%	-
兴业证券	1	145,239,515.35	9.01%	132,356.78	8.99%	-
招商证券	1	50,562,288.58	3.14%	46,076.30	3.13%	-
长城证券	1	50,257,217.14	3.12%	50,257.44	3.41%	-
中泰证券	1	40,679,012.83	2.52%	37,070.69	2.52%	-
国泰君安证券	1	32,341,106.92	2.01%	29,472.58	2.00%	-
广州证券	2	12,244,623.57	0.76%	11,158.35	0.76%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

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、本基金本报告期新增中泰证券上海交易单元 1 个、东兴证券深圳交易单元 1 个。

4、本报告期末退租证券公司交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于新增深圳新华信通资产管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 1 月 4 日
2	宝盈基金管理有限公司关于高级管	中国证券报 证券时	2017 年 1 月 10 日

	理人员变更的公告	报 上海证券报 证 券日报	
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 1 月 13 日
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 1 月 17 日
5	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 1 月 26 日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 2 月 7 日
7	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 2 月 23 日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 3 月 2 日
9	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报	2017 年 3 月 8 日
10	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 3 月 8 日
11	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时 报 上海证券报 证 券日报	2017 年 3 月 16 日

12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年3月25日
13	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年3月31日
14	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月12日
15	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月14日
16	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月14日
17	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月22日
18	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年5月9日
19	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年5月11日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年5月17日
21	宝盈基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报 证券时	2017年6月24日

	金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	报 上海证券报 证 券日报	
--	---------------------------	------------------	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

### 12.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日