

宝盈消费主题灵活配置混合型
证券投资基金
(原鸿阳证券投资基金转型)
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金由鸿阳证券投资基金转型而来。2016 年 11 月 3 日至 2016 年 12 月 2 日鸿阳证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议于 2016 年 12 月 5 日表决通过了鸿阳证券投资基金转型议案，内容包括鸿阳证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、投资范围和投资策略、调整收益分配原则等条款以及相应修订《鸿阳证券投资基金基金合同》等。本次持有人大会决议自表决通过之日 2016 年 12 月 5 日起生效，并报中国证监会备案。依据持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请鸿阳证券投资基金于 2017 年 1 月 4 日终止上市。自基金终止上市之日起，原《鸿阳证券投资基金基金合同》终止，《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，鸿阳证券投资基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，对基金投资目标、投资范围和投资策略、收益分配原则等予以调整，同时基金更名为“宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

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。原鸿阳证券投资基金的报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 1 月 3 日止，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2017 年 1 月 4 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 7 |
| 2.1 基金基本情况（转型前）..... | 7 |
| 2.1 基金基本情况（转型后）..... | 7 |
| 2.2 基金产品说明（转型前）..... | 7 |
| 2.2 基金产品说明（转型后）..... | 8 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 10 |
| 2.4 信息披露方式..... | 10 |
| 2.5 其他相关资料..... | 11 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 11 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 11 |
| 3.2 基金净值表现（转型前）..... | 12 |
| 3.2 基金净值表现（转型后）..... | 13 |
| §4 管理人报告 | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 16 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| §5 托管人报告 | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 18 |
| 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..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前) | 19 |

| | |
|---|-----------|
| 6.1 资产负债表(转型前)..... | 19 |
| 6.2 利润表..... | 21 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 22 |
| 6.4 报表附注..... | 24 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)..... | 41 |
| 6.1 资产负债表（转型后）..... | 41 |
| 6.2 利润表..... | 43 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 44 |
| 6.4 报表附注..... | 45 |
| §7 投资组合报告(转型前)..... | 67 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 67 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 68 |
| 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..... | 69 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 70 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 70 |
| 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..... | 71 |
| 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..... | 71 |
| 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..... | 71 |
| 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..... | 71 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 71 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 71 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 72 |
| §7 投资组合报告(转型后)..... | 73 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 73 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 73 |
| 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(转型后)..... | 74 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 76 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 78 |
| 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..... | 78 |
| 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..... | 78 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 78 |
| 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 | 78 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 78 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 78 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 78 |
| §8 基金份额持有人信息(转型前)..... | 80 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 80 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 80 |
| §8 基金份额持有人信息(转型后)..... | 81 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 81 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 81 |
| 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 | 81 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 81 |
| §10 重大事件揭示..... | 82 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 82 |
| 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 | 82 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 83 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 83 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 83 |
| 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 | 83 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后) | 83 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) | 85 |
| 10.8 其他重大事件 (转型后) | 86 |
| 10.8 其他重大事件 (转型前) | 89 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 90 |
| 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 | 90 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 90 |
| §12 备查文件目录..... | 90 |
| 12.1 备查文件目录 | 90 |
| 12.2 存放地点 | 90 |

| | |
|----------------|----|
| 12.3 查阅方式..... | 90 |
|----------------|----|

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

| | |
|------------------|--------------------|
| 基金名称 | 鸿阳证券投资基金 |
| 基金简称 | 宝盈鸿阳封闭 |
| 场内简称 | 基金鸿阳 |
| 基金主代码 | 184728 |
| 交易代码 | 184728 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 2001 年 12 月 10 日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,000,000,000.00 份 |
| 基金合同存续期（若有） | 15 年 |
| 基金份额上市的证券交易所（若有） | 深圳证券交易所 |
| 上市日期（若有） | 2001 年 12 月 18 日 |

2.1 基金基本情况（转型后）

| | |
|-------------|---------------------|
| 基金名称 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 宝盈消费主题混合 |
| 基金主代码 | 003715 |
| 交易代码 | 003715 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 1 月 4 日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 456,815,782.32 份 |
| 基金合同存续期（若有） | 不定期 |

2.2 基金产品说明（转型前）

| | |
|------|---------------------------------|
| 投资目标 | 本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良 |
|------|---------------------------------|

| | |
|------------|---|
| | 而稳定的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险，在保持基金资产良好的流动性的基础上，实现基金资产的稳定增长，为基金持有人谋求长期最佳利益。 |
| 投资策略 | 本基金股票投资包括两部分：一部分为成长型投资，另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整，但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的 30%，最高均不得高于股票投资总额的 70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则，在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合，分散和降低投资风险，确保基金资产安全，谋求基金长期稳定的收益。 |
| 业绩比较基准（若有） | 无。 |
| 风险收益特征（若有） | 风险水平和期望收益适中。 |

2.2 基金产品说明（转型后）

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生品投资策略和参与融资业务的投资策略组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面尽力规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够跟踪某类资产的上行趋势。</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>1、消费主题的界定</p> <p>随着社会经济、文化的发展、技术进步、人口结构的变化，消费主题在国民经济发展不同阶段将体现不同的内涵和外延。本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司，包括有形商品消费行业和以生活服务业为代表的新型泛消费行业，具体界定如下：</p> <p>（1）有形商品消费：指提供实物消费商品的行业，如食品饮料、纺织服</p> |

装、家电、汽车、家用轻工等。

(2) 生活服务消费：指不以实物形式而以劳务形式作为消费载体，为居民生活提供服务的泛消费行业，具体包括餐饮旅游、医疗健康、家政服务、金融服务、教育、通信、影视传媒、文化出版、体育休闲、商贸零售等。基于本基金对消费主题的界定，本基金可投资的行业包括：建筑装饰、汽车、家用电器、纺织服装、轻工制造、商业贸易、农林牧渔、食品饮料、休闲服务、医疗保健、传媒、通信、金融服务等。

未来如果由于经济发展、生活方式变化或政策调整造成消费主题行业的覆盖范围发生变动，基金管理人有权对上述界定进行调整和修订。

2、主题投资策略

在可投资行业的基础上，本基金重点关注消费行业的两类投资机会：

(1) 由于社会人口构成、消费偏好或需求变化带来增长的消费主题行业公司；

(2) 消费行业间的融合或与其他技术、商业模式相结合衍生出的新兴消费行业蕴含的投资机会，如互联网融合、科技进步所带来的新兴消费形态，或国内人口结构变化带来的消费行业融合发展机会等。

3、个股精选策略

本基金在主题筛选的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选上市公司进行投资。

(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、可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略，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。

(四) 金融衍生品投资策略

1、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。

2、股指期货投资策略

| | |
|--------|---|
| | <p>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。</p> <p>（五）参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证消费服务领先指数收益率×70% +中证综合债券指数收益率×30% |
| 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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张瑾 | 林葛 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | zhangj@byfunds.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-8888-300 | 95599 |
| 传真 | | 0755-83515599 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501 | 北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | | 518034 | 100031 |
| 法定代表人 | | 李文众 | 周慕冰 |

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 |

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、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 | 转型前 报告期(2017年1月1日—2017年 1月3日(基金合同终止日)) | 转型后 报告期(2017年1月4日(基金 合同生效日)—2017年6月30日) |
|---------------|--|---|
| 本期已实现收益 | 116,243.12 | -16,320,514.34 |
| 本期利润 | 991,491.23 | -18,947,428.27 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0005 | -0.0184 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.05% | -1.84% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.05% | -1.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 2017年1月3日(基金合同终止日) | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 1,444,261.55 | -21,290,567.82 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0007 | -0.0466 |
| 期末基金资产净值 | 2,019,432,510.69 | 459,245,480.22 |
| 期末基金份额净值 | 1.0097 | 1.0053 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 2017年1月3日(基金合同终止日) | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 238.85% | -1.04% |

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。
- 5、本基金已于 2017 年 1 月 19 日对原鸿阳证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为 0.993916887。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

| 转型前 | | | | | | |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| 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 | -2.13% | 0.76% | - | - | - | - |
| 过去三个月 | -2.22% | 0.70% | - | - | - | - |
| 过去六个月 | 1.61% | 1.17% | - | - | - | - |
| 过去一年 | -16.03% | 3.52% | - | - | - | - |
| 过去三年 | 46.97% | 4.27% | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 238.85% | 3.07% | - | - | - | - |

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、本基金自 2017 年 1 月 4 日起，由《鸿阳证券投资基金基金合同》修订而成的《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《鸿阳证券投资基金基金合同》同日起失效。

3.2 基金净值表现（转型后）

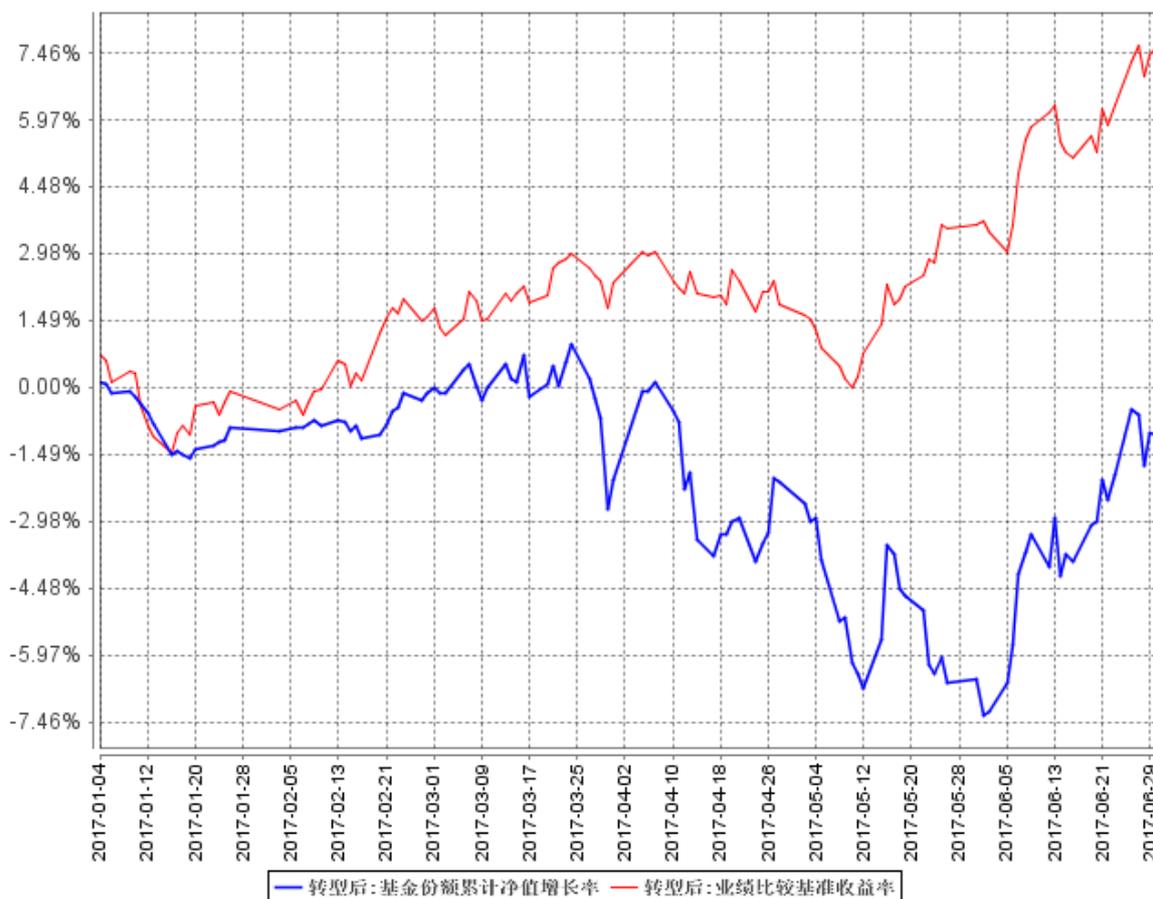
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 转型后 | | | | | | |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 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 | 5.85% | 0.82% | 3.82% | 0.51% | 2.03% | 0.31% |
| 过去三个月 | 1.05% | 0.85% | 5.13% | 0.45% | -4.08% | 0.40% |
| 自基金合同 | -1.04% | 0.67% | 7.60% | 0.42% | -8.64% | 0.25% |

| | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|

3.2.2 自基金转型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、本基金由鸿阳证券投资基金转型而来，转型生效日期为 2017 年 1 月 4 日。

2、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，本报告期处于建仓期内。

§ 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 | | |
| 段鹏程 | 本基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈优势产业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基金经理；权益投资部总监 | 2016年8月20日 | - | 13年 | 段鹏程先生，厦门大学生物学硕士。曾任职于厦门国际信托投资公司，天同证券深圳中心营业部总经理助理、副总经理，诺安基金管理有限公司基金经理，特定客户资产管理部总监。2004年5月加入宝盈基金管理有限公司，历任特定客户资产管理部投资经理、副总监，研究部核心研究员、副总监、总监，现任宝盈基金管理有限公司权益投资部总监。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

注：1、本基金由“鸿阳证券投资基金”转型而来，转型日期为 2017 年 1 月 4 日，转型前后基金经理均为段鹏程；

2、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

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，A 股市场行业分化及风格分化明显，投资机会主要集中在以各行业龙头为代表的大市值企业里，反映了市场对企业成长持续性与确定性的追求。与之相反，大量的小市值企业近半年来始终处于消化估值压力的过程中，表现不尽人意。具体表现上，上半年沪深 300 和创业板指的收益率分别为 10.78%、-7.34%。行业上（以中信一级行业指数为准），表现最好的家电和食品饮料分别上涨 29.7%和 19.1%，表现最差的行业为农林牧渔和军工分别下跌 15.4%和 10.8%。本基金转型前（2017 年 1 月 1 日-2017 年 1 月 3 日）收益为 0.05%，转型后（2017 年 1 月 4 日-2017 年 6 月 30 日）收益为-1.04%，整体优于创业板指数，但负于上证指数和沪深 300 指数同期表现。

本基金属大消费领域投资基金，按照基金契约与法规规定，在本报告期内，重点投资行业限定于以医疗健康产业、新能源汽车产业链、消费电子、保险、纺织服务等行业为代表的大消费领域，并基于行业的发展前景分析，投资了部分环保企业。报告期内业绩不理想的原因在于：基于长期成长性判断而持有的部分小市值股票表现不佳，拖累了组合。

报告期内，宏观经济运行平稳且超市场预期，二季度 GDP 增速 6.9%与一季度持平。从行业数

据来看，社会消费品零售总额数据从年初底部反弹后保持稳定运行态势，对线下零售更具代表性的 50 家数据自 2016 年 9 月份转正起持续改善，5 月份同比增长 4.1%。分品类看，高端消费自 2016 年 Q3 起出现复苏态势且近期呈现加速态势，化妆品类和金银珠宝类销售额 5 月份分别同比增长 9.6%和 12.9%，均创回暖以来新高。同时复苏结构出现新变化，即高端消费复苏蔓延至中档消费开始回暖，5 月份商超主要品类增速环比显著加快：粮油、食品类同比增速 14.4%，家电类同比增速 13.6%。

“消费升级”是大消费领域未来较长一段时间内的投资主线，到 2025 年我国的居民消费率将从目前的 45%上升到 60%。从中、短期来看，投资的重点在于：高端化、国产化以及高科技商业化进程较快的领域，诸如：3D 面部识别、智能驾驶、医疗健康、新能源汽车以及以“保险股”为代表的受益于消费升级的行业及企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）基金鸿阳份额净值为 1.0097 元，本报告期（2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 1 月 3 日止）基金份额净值增长率为 0.05%。

截至本报告期末（2017 年 6 月 30 日）消费主题基金份额净值为 1.0053 元；本报告期（2017 年 1 月 4 日起至 2017 年 6 月 30 日止）基金份额净值增长率为-1.04%，业绩比较基准收益率为 7.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，2 季度 GDP 同比增长 6.9%，与 1 季度增速持平，超出市场 6.7%的一致预期。更能反映企业利润变化的名义 GDP 增速为 11.1%，从高位小幅回落。6 月工业增加值同比增长 7.6%，前值 6.5%，大幅超过市场 6.5%的一致预期。我国先行指数的峰谷平均领先一致指数的峰谷 6-7 个月，从此角度分析下一阶段宏观经济的演化趋势，可以看到：该指数在 2015 年 11 月触底后不断抬升，最新 4 月份数据为 99.48，预示着到 3 季度（以 GDP、工业增加值等为指标）的经济仍然处于上升期。

最新的消费数据进一步提振市场信心，6 月社会消费品零售总额同比增长 11%，再创近期新高，这主要是由于今年以来居民收入增速持续扩张。上半年全国居民人均可支配收入实际同比增长 7.3%，增速较 1 季度加快 0.3 个百分点。

就证券市场而言，综合考虑货币政策从“中性”重回“稳健”，较之前会有所宽松；去杠杆的核心是控制地方政府和国有企业的投融资冲动，金融去杠杆进程进入平稳期；人民币汇率风险下降以及股市发行速度不会太慢等因素，认为下半年市场机会或好于上半年，上游周期品行业、新能源汽车产业链和消费升级等领域需要重点关注。

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、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一宝盈基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体：鸿阳证券投资基金

报告截止日：2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 1 月 3 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-----------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 212,689,873.98 | 11,980,813.02 |
| 结算备付金 | | 4,466,464.53 | 4,466,464.53 |
| 存出保证金 | | 536,922.87 | 536,922.87 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,746,518,830.38 | 1,745,643,582.27 |
| 其中：股票投资 | | 507,055,635.98 | 503,552,507.57 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,239,463,194.40 | 1,242,091,074.70 |
| 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 | 240,000,000.00 | 240,070,500.11 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 20,064,248.92 | 20,292,949.36 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,224,276,340.68 | 2,022,991,232.16 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年1月3日 | 上年度末 2016年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 200,000,000.00 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 3,025,719.90 | 2,776,865.94 |
| 应付托管费 | | 504,286.65 | 462,810.99 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,060,535.77 | 1,060,535.77 |
| 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 | 253,287.67 | 250,000.00 |
| 负债合计 | | 204,843,829.99 | 4,550,212.70 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |

| | | | |
|------------|----------|------------------|------------------|
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 19,432,510.69 | 18,441,019.46 |
| 所有者权益合计 | | 2,019,432,510.69 | 2,018,441,019.46 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,224,276,340.68 | 2,022,991,232.16 |

注：本基金合同终止日为 2017 年 1 月 3 日，本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至基金合同终止日 2017 年 1 月 3 日止，报告截止日 2017 年 1 月 3 日，基金份额净值 1.0097，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鸿阳证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------|---|---|
| 一、收入 | | 1,290,108.52 | -477,879,556.09 |
| 1. 利息收入 | | 414,860.41 | 8,097,262.53 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 5,408.49 | 206,382.59 |
| 债券利息收入 | | 314,285.27 | 7,890,879.94 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 95,166.65 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | - | 46,585,413.41 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | 37,259,248.00 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | 5,105,241.19 |
| 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 | - | 4,220,924.22 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以 | 6.4.7.17 | 875,248.11 | -532,562,232.03 |

| | | | |
|----------------------------|------------|------------|-----------------|
| “-”号填列) | | | |
| 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 | - | - |
| 减：二、费用 | | 298,617.29 | 21,827,095.24 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 248,853.96 | 16,580,967.16 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 41,475.66 | 2,763,494.52 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | - | 2,065,021.15 |
| 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 | 8,287.67 | 417,612.41 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列) | | 991,491.23 | -499,706,651.33 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) | | 991,491.23 | -499,706,651.33 |

注：本基金合同终止日为 2017 年 1 月 3 日，本期是指 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日，上年度可比期间是指 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鸿阳证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|-----------------|--------------------------------|---------------|------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 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) | 2,000,000,000.00 | 18,441,019.46 | 2,018,441,019.46 |

| | | | |
|--|----------------------|-----------------|------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 991,491.23 | 991,491.23 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 2,000,000,000.00 | 19,432,510.69 | 2,019,432,510.69 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2016年1月1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） | 2,000,000,000.00 | 867,217,083.35 | 2,867,217,083.35 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -499,706,651.33 | -499,706,651.33 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | - | -220,000,000.00 | -220,000,000.00 |

| | | | |
|-----------------|------------------|----------------|------------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,000,000,000.00 | 147,510,432.02 | 2,147,510,432.02 |
|-----------------|------------------|----------------|------------------|

注：本基金合同终止日为 2017 年 1 月 3 日，本期是指 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日，上年度可比期间是指 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|---------------|--------------|--------------|
| _____张啸川_____ | _____丁宁_____ | _____何瑜_____ |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鸿阳证券投资基金(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”)证监基金字[2001]第 51 号《关于同意鸿飞证券投资基金上市、扩募并续期及鸿阳证券投资基金设立的批复》核准，由宝盈基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《鸿阳证券投资基金基金契约》(后更名为《鸿阳证券投资基金基金合同》)发起，并于 2001 年 12 月 10 日募集成立。本基金为契约型封闭式，发起人为中国对外经济贸易信托投资有限公司(后更名为：中国对外经济贸易信托有限公司)、联合证券有限责任公司(后更名为：华泰联合证券有限责任公司)、重庆国际信托投资有限公司(后更名为：重庆国际信托有限公司)、天津信托投资有限责任公司，山东省国际信托投资有限公司(后更名为：山东省国际信托有限公司)及宝盈基金管理有限公司，存续期限为 15 年，发行规模为 20 亿份基金份额，共计人民币 20 亿元，业经大华会计师事务所有限公司华业字[2001]1198 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鸿阳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良好流动性和收益性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。基金的投资组合为：投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。本基金无业绩比较基准。

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》、《鸿阳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1月3日(基金合同终止日)的财务状况以及2017年1月1日至2017年1月3日(基金合同终止日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期2017年1月1日至2017年1月3日(基金合同终止日)所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----------------|--------------------------|
| | 2017 年 1 月 3 日 (基金合同终止日) |
| 活期存款 | 212,689,873.98 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 212,689,873.98 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | |
|-----------|--------------------------|----------------|---------------|
| | 2017 年 1 月 3 日 (基金合同终止日) | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 481,531,695.24 | 507,055,635.98 | 25,523,940.74 |
| 贵金属投资-金交所 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|------------------|------------------|---------------|
| 黄金合约 | | | | |
| 债券 | 交易所市场 | 646,964,076.00 | 639,778,194.40 | -7,185,881.60 |
| | 银行间市场 | 600,034,810.00 | 599,685,000.00 | -349,810.00 |
| | 合计 | 1,246,998,886.00 | 1,239,463,194.40 | -7,535,691.60 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,728,530,581.24 | 1,746,518,830.38 | 17,988,249.14 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | |
|--------|-------------------------|-----------|
| | 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日） | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 240,000,000.00 | - |
| 合计 | 240,000,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----------|-------------------------|
| | 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日） |
| 应收活期存款利息 | 15,717.29 |
| 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 | 2,813.86 |
| 应收债券利息 | 19,969,475.64 |
| 应收买入返售证券利息 | 75,903.89 |
| 应收申购款利息 | — |
| 应收黄金合约拆借孳息 | — |
| 其他 | 338.24 |
| 合计 | 20,064,248.92 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2017年1月3日（基金合同终止日））未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|-------------|--------------------|
| | 2017年1月3日（基金合同终止日） |
| 交易所市场应付交易费用 | 1,056,685.66 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,850.11 |
| 合计 | 1,060,535.77 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|------|--------------------|
| | 2017年1月3日（基金合同终止日） |
| 预提费用 | 253,287.67 |
| 合计 | 253,287.67 |

6.4.7.9 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1月3日（基金合同终止日） | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| - 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 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |

注：本基金为封闭式基金，不进行申购和赎回交易，基金份额总额为 2,000,000,000.00 份。其中发起人持有基金份额- 非流通部分为 10,000,000.00 份，发起人持有基金份额- 可流通部分为 10,000,000.00 份，社会公众持有份额为 1,980,000,000.00。按照《鸿阳证券投资基金基金合同》的规定，全部基金发起人认购基金份额不得低于基金规模的 1%，发起人在基金存续期内持有的基金单位不得低于基金规模的 0.5%。

6.4.7.10 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 | 1,328,018.43 | 17,113,001.03 | 18,441,019.46 |
| 本期利润 | 116,243.12 | 875,248.11 | 991,491.23 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,444,261.55 | 17,988,249.14 | 19,432,510.69 |

6.4.7.11 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 1 月 3 日（基金合同终止日） |
| 活期存款利息收入 | 4,733.04 |

| | |
|-----------|----------|
| 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 | 602.97 |
| 其他 | 72.48 |
| 合计 | 5,408.49 |

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无股利收益。

6.4.7.17 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 1 月 3 日（基金合同终止日） |
| 1. 交易性金融资产 | 875,248.11 |
| ——股票投资 | 3,503,128.41 |

| | |
|------------|---------------|
| ——债券投资 | -2,627,880.30 |
| ——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 | 875,248.11 |

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内（2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日））无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内（2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日））无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------|------------------------------|
| | 2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日） |
| 审计费用 | 821.91 |
| 信息披露费 | 2,465.76 |
| 上市年费 | 5,000.00 |
| 合计 | 8,287.67 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至2017年1月3日（基金合同终止日），本基金无需披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据深交所《终止上市通知书》（深证上[2016]998号），基金鸿阳于2017年1月4日起终止上市，转型为“宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金”。《鸿阳证券投资基金基金合同》失效的同时《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。“宝盈消费主题灵活配

置混合型证券投资基金”于基金合同生效后自 2017 年 1 月 4 日至 2017 年 1 月 17 日期间内开放集中申购，2017 年 1 月 19 日进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值 1.0000 元。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）），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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|-------------|
| 宝盈基金管理有限公司 | 基金发起人、基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------------|---|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日） | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 248,853.96 | 16,580,967.16 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 ¹ | - | - |

注：1、支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金

资产净值 $\times 1.5\% \div$ 当年天数。

2、报告期自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）。

6.4.10.2.2 基金托管费

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 1 月 3 日（基金合同终止日） | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 41,475.66 | 2,763,494.52 |

注：1、支付基金托管人中国农业银行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 $\times 0.25\% \div$ 当年天数。

2、报告期自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）未通过关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日） | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| 期末持有的基金份额 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.25% | 0.25% |

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2017年1月3日（基金合同终止日） | | 上年度末 2016年12月31日 | |
|----------------|---------------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%） |
| 中国对外经济贸易信托有限公司 | 3,000,000.00 | 0.15% | 3,000,000.00 | 0.15% |
| 华泰联合证券有限责任公司 | 3,000,000.00 | 0.15% | 3,000,000.00 | 0.15% |
| 重庆国际信托股份有限公司 | 3,000,000.00 | 0.15% | 3,000,000.00 | 0.15% |
| 天津信托有限责任公司 | 3,000,000.00 | 0.15% | 3,000,000.00 | 0.15% |
| 山东省国际信托股份有限公司 | 3,000,000.00 | 0.15% | 3,000,000.00 | 0.15% |

注：1、本基金以上各关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

2、以上各关联方均为本基金发起人。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日） | | 上年度可比期间 2016年1月1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 |

| | | | | |
|--------|----------------|----------|---------------|------------|
| 中国农业银行 | 212,689,873.98 | 4,733.04 | 36,228,261.55 | 175,810.28 |
|--------|----------------|----------|---------------|------------|

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2016年1月1日至2016年6月30日）未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期（2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2016年1月1日至2016年6月30日）无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期（2017年1月1日至2017年1月3日（基金合同终止日））未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年1月3日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末（2017年1月3日（基金合同终止日）），无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 002675 | 东诚药业 | 2017年1月3日 | 重大事项 | 14.30 | 2017年7月17日 | 12.84 | 2,244,303 | 37,289,941.48 | 32,093,532.90 | - |
| 603986 | 兆易创新 | 2016年9月19日 | 重大事项 | 177.97 | 2017年3月13日 | 97.62 | 1,133 | 26,353.58 | 201,640.01 | - |
| 300526 | 中潜股份 | 2016年12月7日 | 重大事项 | 107.03 | 2017年5月25日 | 48.09 | 984 | 10,332.00 | 105,317.52 | - |

注：本基金截至2017年1月3日（本报告期末，基金合同终止日）止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的证券投资基金，属于中高风险品种。本基金主要投资于具有良好流动性和收益性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所

进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末 2017年1月3日 (基金合同终止日) | 1个月 以内 | 1-3个 月 | 3个月 -1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------------|-----------|-----------|------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - | - | - | 212,689,873.98 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | 4,466,464.53 |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - | 536,922.87 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 319,108,936.80 | 306,680,257.60 | 507,055,635.98 | 1,746,518,830.38 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | 240,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 20,064,248.92 | 20,064,248.92 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | - | - | - | 319,108,936.80 | 306,680,257.60 | 527,119,884.90 | 2,224,276,340.68 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 200,000,000.00 | 200,000,000.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,025,719.90 | 3,025,719.90 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 504,286.65 | 504,286.65 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,060,535.77 | 1,060,535.77 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 253,287.67 | 253,287.67 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 204,843,829.99 | 204,843,829.99 |
| 利率敏感度缺口 | - | - | - | 319,108,936.80 | 306,680,257.60 | 322,276,054.91 | 2,019,432,510.69 |
| 上年度末 2016年12月31日 | 1个月 以内 | 1-3个 月 | 3个月 -1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----------|---|---|-----------------|----------------|----------------|---------------|-------------------|
| 银行存款 | - | - | - | - | - | - | 11,980,813.02 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | 4,466,464.53 |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - | 536,922.87 |
| 交易性金融资产 | - | - | -320,234,702.50 | 308,225,170.00 | 503,552,507.57 | - | 1,745,643,582.27 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | 240,070,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 20,292,949.36 | 20,292,949.36 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 500.11 | 500.11 |
| 资产总计 | - | - | -320,234,702.50 | 308,225,170.00 | 523,845,957.04 | - | 42,022,991,232.16 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 2,776,865.94 | 2,776,865.94 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 462,810.99 | 462,810.99 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,060,535.77 | 1,060,535.77 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 4,550,212.70 | 4,550,212.70 |
| 利率敏感度缺口 | - | - | -320,234,702.50 | 308,225,170.00 | 519,295,744.34 | - | 42,018,441,019.46 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|--------|--------------------|---------------------------------|-------------------|
| 假 设 | 除市场利率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1月3日（基 金合同终止日）） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | - | 7,753,703.00 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | - | -7,637,320.00 |

注：本基金于 2017 年 1 月 4 日由封闭式基金转为开放式基金。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及债券投资比例不低于基金总资产的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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。

本基金于 2017 年 1 月 4 日由封闭式基金转为开放式基金。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | 上年度末 | |
|---------------|-------------------------|----------------------|------------------|-----------------------|
| | 2017 年 1 月 3 日(基金合同终止日) | | 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 | 507,055,635.98 | 25.11 | 503,552,507.57 | 24.95 |
| 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 | 507,055,635.98 | 25.11 | 503,552,507.57 | 24.95 |

注：本基金于 2017 年 1 月 4 日由封闭式基金转为开放式基金。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 1 月 4 日由封闭式基金转为开放式基金。

6.4.14 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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金

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 |
|------------|---------|------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 56,713,102.48 |
| 结算备付金 | | 494,819.82 |
| 存出保证金 | | 468,351.05 |

| | | |
|-----------------|------------|-----------------|
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 414,163,897.88 |
| 其中：股票投资 | | 414,163,897.88 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | 217,085.81 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 12,105.41 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 159,822.57 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 472,229,185.02 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 转型后至报告期末 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 11,395,274.07 |
| 应付管理人报酬 | | 588,349.50 |
| 应付托管费 | | 98,058.21 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 475,170.82 |
| 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 | 426,852.20 |
| 负债合计 | | 12,983,704.80 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 459,608,004.76 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -362,524.54 |
| 所有者权益合计 | | 459,245,480.22 |
| 负债和所有者权益总计 | | 472,229,185.02 |

注：本基金合同生效日为 2017 年 1 月 4 日，本报告期自基金合同生效日 2017 年 1 月 4 日起至 2017 年 6 月 30 日止，报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0053 元，基金份额总额 456,815,782.32 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|-------------------|----------|--|
| | | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日） 至 2017 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | -7,149,110.65 |
| 1. 利息收入 | | 5,504,637.40 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,155,411.43 |
| 债券利息收入 | | 988,657.33 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 3,360,568.64 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -19,068,386.80 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -10,789,674.14 |
| 基金投资收益 | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|----------------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -10,165,663.90 |
| 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 | 1,886,951.24 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -2,626,913.93 |
| 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 | 9,041,552.68 |
| 减：二、费用 | | 11,798,317.62 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 7,708,158.29 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,284,692.96 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 2,575,237.24 |
| 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 | 230,229.13 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -18,947,428.27 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -18,947,428.27 |

注：本基金合同生效日为 2017 年 1 月 4 日，本期是指 2017 年 1 月 4 日起至 2017 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）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） | 2,000,000,000.00 | 19,432,510.69 | 2,019,432,510.69 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -18,947,428.27 | -18,947,428.27 |
| 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） | -1,540,391,995.24 | -847,606.96 | -1,541,239,602.20 |
| 其中：1. 基金申购款 | 483,222,223.32 | -2,992,250.50 | 480,229,972.82 |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列） | -2,023,614,218.56 | 2,144,643.54 | -2,021,469,575.02 |
| 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） | 459,608,004.76 | -362,524.54 | 459,245,480.22 |

注：1、本基金合同生效日为 2017 年 1 月 4 日，本期是指 2017 年 1 月 4 日起至 2017 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

2、本期（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）起至 2017 年 6 月 30 日）所有者权益（基金净值）变动表中基金申购款含封转开集中申购基金权益（净值），基金赎回款含基金拆分变动权益（净值）。

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

宝盈消费主题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

会（以下简称“中国证监会”）《关于准予鸿阳证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2016]2472号）准予，根据原鸿阳证券投资基金（以下简称“基金鸿阳”）基金份额持有人大会于2016年11月3日至2016年12月2日决议通过的《关于鸿阳证券投资基金转型有关事项的议案》，由原基金鸿阳转型而来。原基金鸿阳为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限至2017年1月3日止。根据深交所《终止上市通知书》（深证上[2016]998号），原基金鸿阳于2017年1月4日起终止上市。原基金鸿阳更名为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金，《鸿阳证券投资基金基金合同》失效的同时《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

原基金鸿阳于基金合同失效前基金资产净值为2,019,432,510.69元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于原鸿阳证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于2017年1月19日进行了基金份额拆分，拆分比例为0.993916887，并于2017年1月19日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自2017年1月4日至2017年1月17日期间内开放集中申购，共募集469,526,783.14元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息29,755.64元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2017)第066号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2017年1月19日基金份额折算后的基金份额净值1.0000元折合为469,526,783.14份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的29,755.64份基金份额，并于2017年1月19日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良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、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。本基金可参与融资业务。

基金的投资组合比例为：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）投资占基金资产的比例为0% - 95%，其中投资于消费主题行业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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率×70% + 中证综合债券指数收益率×30%

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》、《宝盈消费主题灵活配置混合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 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间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 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----------------|-----------------|
| | 2017 年 6 月 30 日 |
| 活期存款 | 56,713,102.48 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 56,713,102.48 |

6.4.7.2 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 | 估值增值 |
| 股票 | 398,802,562.67 | 414,163,897.88 | 15,361,335.21 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |

| | | | |
|----|----------------|----------------|---------------|
| 合计 | 398,802,562.67 | 414,163,897.88 | 15,361,335.21 |
|----|----------------|----------------|---------------|

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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 | 11,670.78 |
| 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 | 222.70 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 1.13 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 210.80 |
| 合计 | 12,105.41 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）未持有其他资产。

6.4.7.7 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 | 475,170.82 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 475,170.82 |

6.4.7.8 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 | 28,496.11 |
| 预提费用 | 398,356.09 |
| 合计 | 426,852.20 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 | |
|--------------------------------|--|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| 2017 年 1 月 19 日基金份额折算调整 | -12,166,226.51 | - |
| 2017 年 1 月 19 日未领取红利份额折算调整（若有） | - | - |
| 2017 年 1 月 19 日集中申购募集资金本金及利息 | 469,526,783.14 | 472,400,448.57 |
| 2017 年 1 月 19 日基金拆分和集中申购完成后 | - | - |
| 本期申购 | 10,755,927.00 | 10,821,774.75 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,011,300,701.31 | -2,023,614,218.56 |
| 本期末 | 456,815,782.32 | 459,608,004.76 |

注：1、根据《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于鸿阳证券投资基

金转型所得宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额折算的公告》等相关规定，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金有效集中申购款项验资结束之日，即 2017 年 1 月 19 日为原鸿阳证券投资基金的基金份额折算基准日，经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为 0.9939 元，精确到小数点后第 9 位为 0.993916887 元（小数点后第 10 位四舍五入），本基金管理人按 0.993916887 的折算比例对折算基准日登记在册的由原基金鸿阳转型而来的本基金基金份额进行折算，折算后的基金份额净值为 1.0000 元，折算后的基金份额数为折算前的基金份额数乘以折算比例，采用循环进位的方式保留到小数点后两位，由原鸿阳证券投资基金基金份额折算后的基金份额总额为 1,987,833,773.49 份。

2、根据《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金集中申购公告》的相关规定，2017 年 1 月 4 日至 2017 年 1 月 17 日为本基金的集中申购期，集中申购期结束后，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资，本基金最终确认的有效净申购金额为 469,497,027.50 元人民币，折合基金份额 469,497,027.50 份。有效申购申请确认金额产生的银行利息共计 29,755.64 元人民币，折合基金份额 29,755.64 份。以上实收基金合计 469,526,783.14 元，折合为 469,526,783.14 份宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日 | 1,444,261.55 | 17,988,249.14 | 19,432,510.69 |
| 本期利润 | -16,320,514.34 | -2,626,913.93 | -18,947,428.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,414,315.03 | 5,566,708.07 | -847,606.96 |
| 其中：基金申购款 | 3,554,490.00 | -6,546,740.50 | -2,992,250.50 |
| 基金赎回款 | -9,968,805.03 | 12,113,448.57 | 2,144,643.54 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -21,290,567.82 | 20,928,043.28 | -362,524.54 |

6.4.7.11 存款利息收入

| 项目 | 本期 |
|----------|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 1,095,190.96 |

| | |
|-----------|--------------|
| 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 | 54,603.60 |
| 其他 | 5,616.87 |
| 合计 | 1,155,411.43 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|-------------------------------|
| | 2017年1月4日（基金合同生效日）至2017年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 881,127,007.60 |
| 减：卖出股票成本总额 | 891,916,681.74 |
| 买卖股票差价收入 | -10,789,674.14 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|-------------------------------|
| | 2017年1月4日（基金合同生效日）至2017年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额 | 1,257,791,355.07 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,246,998,886.00 |
| 减：应收利息总额 | 20,958,132.97 |
| 买卖债券差价收入 | -10,165,663.90 |

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内（2017年1月4日（基金合同生效日）至2017年6月30日）无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内（2017年1月4日（基金合同生效日）至2017年6月30日）无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,886,951.24 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,886,951.24 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -2,626,913.93 |
| ——股票投资 | -10,162,605.53 |
| ——债券投资 | 7,535,691.60 |
| ——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 | -2,626,913.93 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |

| | |
|---------|--------------|
| 基金赎回费收入 | 8,816,762.52 |
| 基金转换费收入 | 224,790.16 |
| 合计 | 9,041,552.68 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------------|
| | 2017年1月4日（基金合同生效日）至2017年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 2,573,337.24 |
| 银行间市场交易费用 | 1,900.00 |
| 合计 | 2,575,237.24 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------------|
| | 2017年1月4日（基金合同生效日）至2017年6月30日 |
| 审计费用 | 48,766.66 |
| 信息披露费 | 146,301.76 |
| 银行汇划费用 | 16,960.71 |
| 债券帐户维护费 | 18,200.00 |
| 合计 | 230,229.13 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本开放式基金“宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金”由原封闭式基金“鸿阳证券投资基金”转型而来，原封闭式基金发起人与本基金不再存在关联方关系。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|-------------|
| 宝盈基金管理有限公司 | 基金发起人、基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期间（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）未通过关联方交易单元进行交易，无上年度可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期应支付的管理费 | 7,708,158.29 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 918,600.41 |

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期应支付的托管费 | 1,284,692.96 |

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

6.4.10.3 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（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）未通过关联方进行银行间市场交易，无上年可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目 | 本期 | |
|-----------------------|--|--|
| | 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 | |
| 期初持有的基金份额 | - | |
| 期间申购/买入总份额 | 4,969,584.44 | |
| 期间因拆分增加的份额 | - | |
| 期间赎回/卖出总份额 | - | |
| 期末持有的基金份额 | 4,969,584.44 | |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 1.09% | |

注：1、本基金由封闭式转为开放式，折算前基金管理人持有份额为 5,000,000.00 份，折算基准日折算比例为 0.993916887，折算后基金管理人持有份额为 4,969,584.44 份。

2、2017 年 2 月 21 日因确权增加份额 4,969,584.44 份，无费用。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 | |
|----------------|-----------------|----------------------|
| | 2017 年 6 月 30 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 |
| 中国对外经济贸易信托有限公司 | 2,981,750.66 | 0.65% |

注：1、本基金由封闭式转为开放式，折算前中国对外经济贸易信托有限公司持有份额为 3,000,000.00 份，折算基准日折算比例为 0.993916887，折算后基金管理人持有份额为 2,981,750.66 份。

2、报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率

结构。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 | |
|--------|--|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 56,713,102.48 | 1,095,190.96 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）在承销期内未参与关联方承销的证券，无上年可比期间数据。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 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 |
| 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 |
| 603933 | 睿能科技 | 2017 年 6 月 28 日 | 2017 年 7 月 6 日 | 新股流通受限 | 20.20 | 20.20 | 857 | 17,311.40 | 17,311.40 |

| | | | | | | | | | |
|--------|------|----------------|----------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|
| 603305 | 旭升股份 | 2017年6月 30日 | 2017年7月 10日 | 新股流通受限 | 11.26 | 11.26 | 1,351 | 15,212.26 | 15,212.26 |
| 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 |
| 603331 | 百达精工 | 2017年6月 27日 | 2017年7月 5日 | 新股流通受限 | 9.63 | 9.63 | 999 | 9,620.37 | 9,620.37 |
| 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 |
| 603617 | 君禾股份 | 2017年6月 23日 | 2017年7月 3日 | 新股流通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 |

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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 |
|--------|------|----------------|------|----------------|----------------|------------|-----------|---------------|---------------|--------|
| 002675 | 东诚药业 | 2017年1 月3日 | 重大事项 | 14.66 | 2017年7 月17日 | 12.84 | 2,244,303 | 37,289,941.48 | 32,901,481.98 | - |
| 300152 | 科融环境 | 2017年5 月12日 | 重大事项 | 7.89 | 2017年7 月12日 | 7.41 | 2,194,300 | 20,352,709.49 | 17,313,027.00 | - |

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末 2017年6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|---------------|-------|--------|------|------|-----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 56,713,102.48 | - | - | - | - | - | 56,713,102.48 |
| 结算备付金 | 494,819.82 | - | - | - | - | - | 494,819.82 |
| 存出保证金 | 468,351.05 | - | - | - | - | - | 468,351.05 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 414,163,897.88 | 414,163,897.88 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 217,085.81 | 217,085.81 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 12,105.41 | 12,105.41 |
| 应收申购款 | 994.04 | - | - | - | - | 158,828.53 | 159,822.57 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 57,677,267.39 | - | - | - | - | 414,551,917.63 | 472,229,185.02 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 11,395,274.07 | 11,395,274.07 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 588,349.50 | 588,349.50 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 98,058.21 | 98,058.21 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 475,170.82 | 475,170.82 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 426,852.20 | 426,852.20 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 12,983,704.80 | 12,983,704.80 |
| 利率敏感度缺口 | 57,677,267.39 | - | - | - | - | -401,568,212.83 | 459,245,480.22 |

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

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | |
|--------------|-----------------|---------------|
| | 2017 年 6 月 30 日 | |
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 414,163,897.88 | 90.18 |
| 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 | 414,163,897.88 | 90.18 |

6.4.13.4.3.2 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) |
| | 1. 中证消费服务领先指数上升 5% | 19,836,735.46 |
| | 2. 中证消费服务领先指数下降 5% | -19,836,735.46 |

6.4.14 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(转型前)

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 | 507,055,635.98 | 22.80 |
| | 其中：股票 | 507,055,635.98 | 22.80 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,239,463,194.40 | 55.72 |
| | 其中：债券 | 1,239,463,194.40 | 55.72 |
| | 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 | 240,000,000.00 | 10.79 |
| | 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 | 217,156,338.51 | 9.76 |
| 7 | 其他资产 | 20,601,171.79 | 0.93 |
| 8 | 合计 | 2,224,276,340.68 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 366,490,087.98 | 18.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 54,360,000.00 | 2.69 |
| 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 | 56,591,548.00 | 2.80 |
| 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 | 18,504,000.00 | 0.92 |
| 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 | 11,110,000.00 | 0.55 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 507,055,635.98 | 25.11 |

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 | 002366 | 台海核电 | 1,150,000 | 63,733,000.00 | 3.16 |
| 2 | 002368 | 太极股份 | 1,835,600 | 56,591,548.00 | 2.80 |
| 3 | 002482 | 广田集团 | 6,000,000 | 54,360,000.00 | 2.69 |
| 4 | 000070 | 特发信息 | 1,800,000 | 47,520,000.00 | 2.35 |
| 5 | 603808 | 歌力思 | 1,384,325 | 44,146,124.25 | 2.19 |
| 6 | 002007 | 华兰生物 | 999,956 | 35,798,424.80 | 1.77 |
| 7 | 300363 | 博腾股份 | 1,761,189 | 34,977,213.54 | 1.73 |
| 8 | 002675 | 东诚药业 | 2,244,303 | 32,093,532.90 | 1.59 |
| 9 | 002698 | 博实股份 | 2,000,000 | 31,320,000.00 | 1.55 |
| 10 | 300396 | 迪瑞医疗 | 664,400 | 25,061,168.00 | 1.24 |
| 11 | 300053 | 欧比特 | 1,500,000 | 21,480,000.00 | 1.06 |
| 12 | 002549 | 凯美特气 | 1,800,000 | 18,504,000.00 | 0.92 |
| 13 | 002097 | 山河智能 | 2,000,000 | 18,100,000.00 | 0.90 |
| 14 | 002085 | 万丰奥威 | 600,000 | 11,736,000.00 | 0.58 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 15 | 600715 | 文投控股 | 500,000 | 11,110,000.00 | 0.55 |
| 16 | 603986 | 兆易创新 | 1,133 | 201,640.01 | 0.01 |
| 17 | 603515 | 欧普照明 | 2,845 | 110,727.40 | 0.01 |
| 18 | 603658 | 安图生物 | 1,911 | 106,939.56 | 0.01 |
| 19 | 300526 | 中潜股份 | 984 | 105,317.52 | 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

本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细。

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

本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）），无买入股票的成本总额及卖出股票的收入。

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 | 639,778,194.40 | 31.68 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 599,685,000.00 | 29.70 |
| | 其中：政策性金融债 | 599,685,000.00 | 29.70 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,239,463,194.40 | 61.38 |

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 | 010107 | 21 国债(7) | 3,042,610 | 319,108,936.80 | 15.80 |
| 2 | 010303 | 03 国债(3) | 3,029,240 | 306,680,257.60 | 15.19 |
| 3 | 160401 | 16 农发 01 | 2,000,000 | 200,000,000.00 | 9.90 |
| 4 | 160414 | 16 农发 14 | 2,000,000 | 199,720,000.00 | 9.89 |
| 5 | 160204 | 16 国开 04 | 1,500,000 | 149,970,000.00 | 7.43 |

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（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））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（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））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

本基金本报告期末本报告期内（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））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（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））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（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）），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 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 536,922.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 20,064,248.92 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,601,171.79 |

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（2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））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 | 002675 | 东诚药业 | 32,093,532.90 | 1.59 | 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。

§ 7 投资组合报告(转型后)

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 | 414,163,897.88 | 87.70 |
| | 其中：股票 | 414,163,897.88 | 87.70 |
| 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 | 57,207,922.30 | 12.11 |
| 7 | 其他资产 | 857,364.84 | 0.18 |
| 8 | 合计 | 472,229,185.02 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 313,487,702.12 | 68.26 |
| 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 | 32,616,000.00 | 7.10 |
| 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 | 9,623,639.62 | 2.10 |
| J | 金融业 | 41,120,171.14 | 8.95 |
| K | 房地产业 | 3,358.00 | 0.00 |
| 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 | 17,313,027.00 | 3.77 |
| 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 | 414,163,897.88 | 90.18 |

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(转型后)

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 | 601689 | 拓普集团 | 1,100,000 | 36,839,000.00 | 8.02 |
| 2 | 002236 | 大华股份 | 1,600,000 | 36,496,000.00 | 7.95 |
| 3 | 002007 | 华兰生物 | 970,000 | 35,405,000.00 | 7.71 |
| 4 | 002675 | 东诚药业 | 2,244,303 | 32,901,481.98 | 7.16 |
| 5 | 600511 | 国药股份 | 900,000 | 32,616,000.00 | 7.10 |
| 6 | 603808 | 歌力思 | 946,000 | 27,925,920.00 | 6.08 |
| 7 | 000967 | 盈峰环境 | 2,397,749 | 25,991,599.16 | 5.66 |
| 8 | 002273 | 水晶光电 | 1,250,000 | 25,787,500.00 | 5.62 |
| 9 | 600518 | 康美药业 | 1,000,000 | 21,740,000.00 | 4.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 10 | 601628 | 中国人寿 | 799,993 | 21,583,811.14 | 4.70 |
| 11 | 002050 | 三花智控 | 1,230,412 | 20,080,323.84 | 4.37 |
| 12 | 300258 | 精锻科技 | 1,206,607 | 19,921,081.57 | 4.34 |
| 13 | 300152 | 科融环境 | 2,194,300 | 17,313,027.00 | 3.77 |
| 14 | 300246 | 宝莱特 | 599,879 | 16,406,690.65 | 3.57 |
| 15 | 002614 | 奥佳华 | 749,303 | 13,622,328.54 | 2.97 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 300,000 | 10,161,000.00 | 2.21 |
| 17 | 300059 | 东方财富 | 800,000 | 9,616,000.00 | 2.09 |
| 18 | 601336 | 新华保险 | 182,400 | 9,375,360.00 | 2.04 |
| 19 | 603801 | 志邦股份 | 1,406 | 47,522.80 | 0.01 |
| 20 | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.01 |
| 21 | 300666 | 江丰电子 | 2,276 | 43,448.84 | 0.01 |
| 22 | 603335 | 迪生力 | 2,230 | 24,864.50 | 0.01 |
| 23 | 002879 | 长缆科技 | 1,313 | 23,660.26 | 0.01 |
| 24 | 002881 | 美格智能 | 989 | 22,608.54 | 0.00 |
| 25 | 603679 | 华体科技 | 809 | 21,438.50 | 0.00 |
| 26 | 603938 | 三孚股份 | 1,246 | 20,932.80 | 0.00 |
| 27 | 002882 | 金龙羽 | 2,966 | 18,389.20 | 0.00 |
| 28 | 603933 | 睿能科技 | 857 | 17,311.40 | 0.00 |
| 29 | 603305 | 旭升股份 | 1,351 | 15,212.26 | 0.00 |
| 30 | 300669 | 沪宁股份 | 841 | 14,650.22 | 0.00 |
| 31 | 300670 | 大烨智能 | 1,259 | 13,760.87 | 0.00 |
| 32 | 603286 | 日盈电子 | 890 | 13,528.00 | 0.00 |
| 33 | 300672 | 国科微 | 1,257 | 10,659.36 | 0.00 |
| 34 | 603331 | 百达精工 | 999 | 9,620.37 | 0.00 |
| 35 | 300671 | 富满电子 | 942 | 7,639.62 | 0.00 |
| 36 | 603617 | 君禾股份 | 832 | 7,429.76 | 0.00 |
| 37 | 600340 | 华夏幸福 | 100 | 3,358.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601689 | 拓普集团 | 42,491,850.47 | 9.25 |
| 2 | 002108 | 沧州明珠 | 36,923,615.12 | 8.04 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 34,235,939.00 | 7.45 |
| 4 | 002562 | 兄弟科技 | 33,691,995.54 | 7.34 |
| 5 | 600511 | 国药股份 | 32,843,182.72 | 7.15 |
| 6 | 000967 | 盈峰环境 | 29,796,732.75 | 6.49 |
| 7 | 002273 | 水晶光电 | 29,619,119.01 | 6.45 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 28,650,000.00 | 6.24 |
| 9 | 600498 | 烽火通信 | 26,176,705.79 | 5.70 |
| 10 | 002456 | 欧菲光 | 26,092,280.00 | 5.68 |
| 11 | 000980 | 众泰汽车 | 25,739,525.00 | 5.60 |
| 12 | 600518 | 康美药业 | 23,809,251.21 | 5.18 |
| 13 | 600522 | 中天科技 | 23,553,366.00 | 5.13 |
| 14 | 600820 | 隧道股份 | 23,468,430.70 | 5.11 |
| 15 | 601628 | 中国人寿 | 21,984,650.87 | 4.79 |
| 16 | 002281 | 光迅科技 | 20,848,619.48 | 4.54 |
| 17 | 300152 | 科融环境 | 20,352,709.49 | 4.43 |
| 18 | 600686 | 金龙汽车 | 20,249,986.54 | 4.41 |
| 19 | 601992 | 金隅股份 | 20,231,597.00 | 4.41 |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 20,199,981.70 | 4.40 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 002366 | 台海核电 | 57,374,428.25 | 12.49 |
| 2 | 002368 | 太极股份 | 55,506,717.67 | 12.09 |
| 3 | 002482 | 广田集团 | 52,832,070.13 | 11.50 |
| 4 | 000070 | 特发信息 | 44,871,491.44 | 9.77 |
| 5 | 002562 | 兄弟科技 | 36,000,166.06 | 7.84 |
| 6 | 002108 | 沧州明珠 | 34,713,533.29 | 7.56 |
| 7 | 002698 | 博实股份 | 30,481,652.28 | 6.64 |
| 8 | 300363 | 博腾股份 | 28,457,283.59 | 6.20 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 27,693,882.02 | 6.03 |
| 10 | 002456 | 欧菲光 | 26,915,241.87 | 5.86 |
| 11 | 600498 | 烽火通信 | 25,645,512.00 | 5.58 |
| 12 | 300396 | 迪瑞医疗 | 24,514,318.06 | 5.34 |
| 13 | 600522 | 中天科技 | 21,200,215.00 | 4.62 |
| 14 | 600820 | 隧道股份 | 21,141,668.06 | 4.60 |
| 15 | 300053 | 欧比特 | 20,902,511.44 | 4.55 |
| 16 | 002007 | 华兰生物 | 20,816,215.95 | 4.53 |
| 17 | 600686 | 金龙汽车 | 20,771,559.19 | 4.52 |
| 18 | 000980 | 众泰汽车 | 20,672,339.72 | 4.50 |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 19,143,889.60 | 4.17 |
| 20 | 601992 | 金隅股份 | 18,408,797.00 | 4.01 |

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 | 809,187,549.17 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 881,127,007.60 |

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

本基金本报告期末(2017年6月30日)未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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(2017年6月30日)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(2017年6月30日)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(2017年6月30日)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(2017年6月30日)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(2017年6月30日)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(2017年6月30日)未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内(2017年1月4日(基金合同生效日)至2017年6月30日), 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 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 468,351.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | 217,085.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,105.41 |
| 5 | 应收申购款 | 159,822.57 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 857,364.84 |

7.12.7 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（2017年6月30日）未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.8 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 | 002675 | 东诚药业 | 32,901,481.98 | 7.16 | 重大事项 |

7.12.9 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(转型前)

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 |
| 18,771 | 106,547.33 | 1,318,505,002.00 | 65.93% | 681,494,998.00 | 34.07% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------------------|----------------|----------|
| 1 | 中国人寿再保险有限责任公司 | 146,367,705.00 | 7.32% |
| 2 | 泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红-019L-FH002 深 | 123,229,132.00 | 6.16% |
| 3 | 伦敦市投资管理有限公司—客户资金 | 106,048,612.00 | 5.30% |
| 4 | 农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 87,569,219.00 | 4.38% |
| 5 | 建信人寿保险有限公司—普通 | 69,992,125.00 | 3.50% |
| 6 | 中国人寿保险股份有限公司 | 65,570,214.00 | 3.28% |
| 7 | 泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品-019L-CT001 深 | 50,062,198.00 | 2.50% |
| 8 | 中国人寿资产管理有限公司 | 46,728,751.00 | 2.34% |
| 9 | 中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深 | 41,299,906.00 | 2.06% |
| 10 | 上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募） | 41,195,452.00 | 2.06% |

注：1、上述本基金前十名持有人相关资料由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

2、本报告期末为 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日）。

§ 8 基金份额持有人信息(转型后)

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 |
| 7,663 | 59,613.18 | 148,734,235.56 | 32.56% | 308,081,546.76 | 67.44% |

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 | 995.12 | 0.00% |

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(2017年1月4日)基金份额总额 | 2,000,000,000.00 |
| 报告期期初基金份额总额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 480,282,710.14 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 2,011,300,701.31 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份 额减少以“-”填列) | -12,166,226.51 |

| | |
|-------------|----------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 456,815,782.32 |
|-------------|----------------|

注：报告期间（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）基金总申购份额含封转开集中申购基金份额。

§ 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、托管人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 (转型后)

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 | |
| 国泰君安证券 | 2 | 568,517,363.97 | 33.67% | 519,949.34 | 33.72% | - |
| 第一创业 | 1 | 456,045,538.74 | 27.01% | 415,598.63 | 26.96% | - |
| 中信建投 | 1 | 297,066,363.19 | 17.59% | 270,716.61 | 17.56% | - |
| 中投证券 | 1 | 286,001,594.96 | 16.94% | 260,633.54 | 16.90% | - |
| 申万宏源 | 2 | 44,735,527.31 | 2.65% | 41,171.50 | 2.67% | - |
| 海通证券 | 1 | 36,197,622.40 | 2.14% | 33,710.66 | 2.19% | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券(山东) | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

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

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

2、本报告期内（2017 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）基金租用券商交易单元的变更情况：

（I）租用交易单元情况

未租用新的交易单元。

（II）退租交易单元情况

未退租交易单元。

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

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 |
| 国泰君安证券 | 550,357,713.20 | 85.19% | 5,750,000,000.00 | 96.64% | - | - |
| 第一创业 | 95,673,564.36 | 14.81% | 200,000,000.00 | 3.36% | - | - |

| | | | | | | |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券(山东) | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

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

1、本基金本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））无租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况。

2、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席位租用协议。

3、本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日（基金合同终止日））基金租用券商交易单元的变更情况：

(I) 租用交易单元情况

未租用新的交易单元。

(II) 退租交易单元情况

未退租交易单元。

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（转型后）

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-----------------------|-----------------|
| 1 | 关于宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金开展电子直销平台集中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 | 2017 年 1 月 4 日 |
| 2 | 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 |
| 3 | 关于增加中国建设银行股份有限公司为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 6 日 |
| 4 | 关于增加金元证券股份有限公司为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 10 日 |
| 5 | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报 | 2017 年 1 月 10 日 |
| 6 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金（原基金鸿阳）基金份额确权登记指引 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 13 日 |
| 7 | 关于增加华泰证券股份有限公司为 | 中国证券报 证券时报 | 2017 年 1 月 13 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------|-----------------|
| | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 报 上海证券报 | |
| 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 1 月 13 日 |
| 9 | 关于鸿阳证券投资基金转型所得宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额折算的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 17 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 1 月 17 日 |
| 11 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 19 日 |
| 12 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金集中申购结果暨原鸿阳证券投资基金份额折算结果的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 21 日 |
| 13 | 关于增加广发证券股份有限公司为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 21 日 |
| 14 | 关于增加西南证券股份有限公司为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017 年 1 月 25 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 1 月 26 日 |
| 16 | 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 |

| | | | |
|----|--|-----------------------|------------|
| 17 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017年2月20日 |
| 18 | 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 |
| 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3月2日 |
| 20 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017年3月7日 |
| 21 | 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 |
| 22 | 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 |
| 23 | 关于增加银河证券股份有限公司为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017年3月20日 |
| 24 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2017年3月22日 |
| 25 | 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 |
| 26 | 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 |
| 27 | 宝盈基金管理有限公司高级管理人员 | 中国证券报 证券时报 | 2017年4月14日 |

| | | | |
|----|--|-------------------------------|-----------------|
| | 员变更公告 | 报 上海证券报 证 券日报 | |
| 28 | 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 |
| 29 | 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 |
| 30 | 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 |
| 31 | 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 |
| 32 | 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 |
| 33 | 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 6 月 24 日 |

10.8 其他重大事件（转型前）

| 序 号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|--------|--------------------------|----------------------|----------------|
| 1 | 鸿阳证券投资基金终止上市第二次 提示性公告 | 中国证券报 证券时 报 上海证券报 | 2017 年 1 月 3 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳证券投资基金基金托管协议》。

中国证监会准予鸿阳证券投资基金变更注册的文件；

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

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

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

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

12.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，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