

宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈新兴产业混合
基金主代码	001128
交易代码	001128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 13 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,912,360,346.01 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，精选新兴产业及其相关行业中的优质企业进行投资，分享新兴产业发展所带来的投资机会，力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	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权证投资策略四部分组成。 本基金所指的新兴产业是指随着科研、技术、工艺、产品、服务、商业模式以及管理等方面的创新和变革

	而产生和发展起来的新兴产业部门。当前所指的新兴产业主要包括：新能源、节能环保、新能源汽车、信息产业、生物医药、国防军工、新材料、高端装备制造、现代服务业及海洋产业等。本基金管理人将重点投资新兴产业及其上下游延伸产业的相关个股，深入挖掘主题投资机会，分享这一投资机遇。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×65% + 中证综合债券指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-76,623,589.60	-209,867,130.95	-1,655,193,205.96
本期利润	-30,552,361.01	-670,465,935.47	-1,234,817,906.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0091	-0.1690	-0.2392
本期基金份额净值增长率	-0.79%	-20.72%	-19.90%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4138	-0.3974	-0.3453
期末基金资产净值	1,836,225,067.17	2,361,991,142.78	3,288,110,133.18
期末基金份额净值	0.630	0.635	0.801

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

2、上述基金业绩指标不包括份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

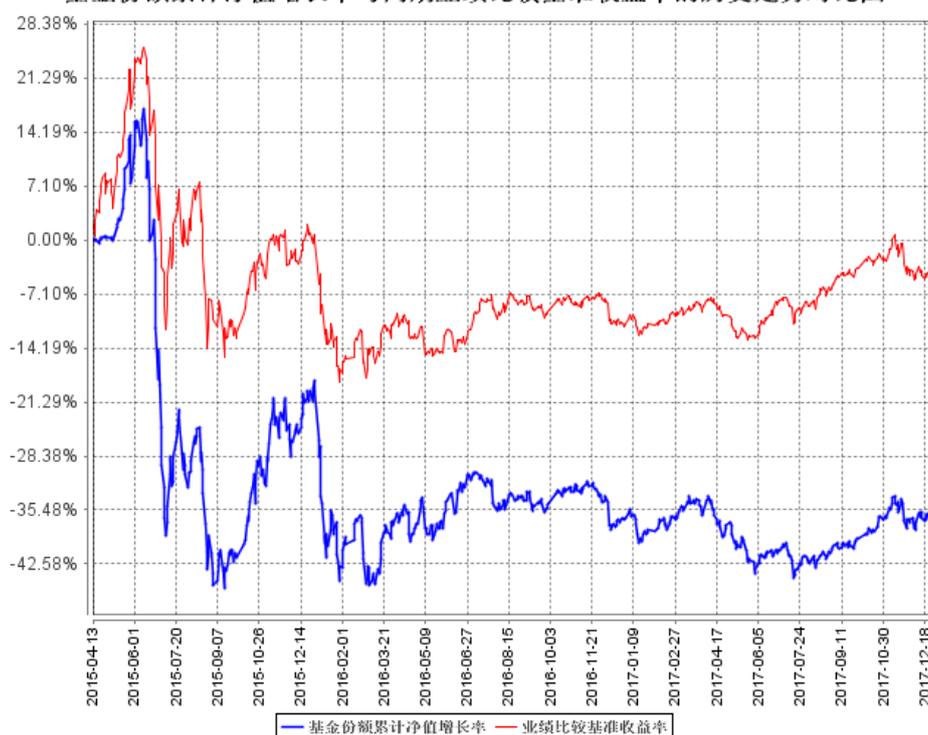
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.79%	1.03%	-1.03%	0.70%	4.82%	0.33%
过去六个月	6.24%	0.94%	3.54%	0.63%	2.70%	0.31%
过去一年	-0.79%	0.96%	7.20%	0.56%	-7.99%	0.40%
自基金合同生效起至今	-37.00%	1.96%	-4.62%	1.32%	-32.38%	0.64%

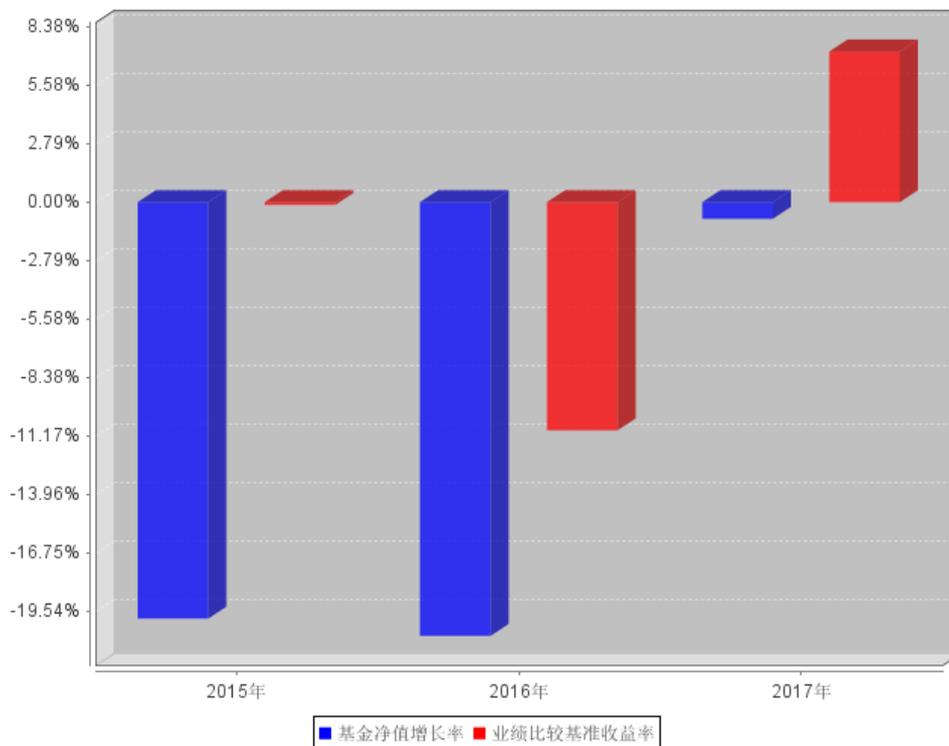
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、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		
张志梅	本基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理；权益投资部副总经理	2017 年 12 月 7 日	-	17 年	张志梅女士，中国人民银行研究生部经济学硕士。1994 年 8 月至 1996 年 8 月任职于南方证券有限公司资金部；1999 年 3 月至 2000 年 7 月任职于南方证券有限公司研究所；2000 年 7 月至 2000 年 11 月任职于 21 世纪科技投资有限公司投资部；2000 年 11 月至 2015 年 5 月任职于南方基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理、专户投资部投资经理兼总监助理。2015 年 5 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任专户投资部投资经理、专户投资部副总经理，现任权益投资部副总经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
盖俊龙	本基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015 年 4 月 13 日	2017 年 12 月 9 日	12 年	盖俊龙先生，经济学硕士。2005 年 8 月至 2011 年 5 月，在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011 年 6 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员，专户投资部投资经理，宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

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

2、张志梅为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2017 年 12 月 31 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

各维度上的“分化”是 2017 年 A 股行情的最显著特征。大市值公司涨幅明显超过中小市值，各个行业内部也表现为强势公司的虹吸效应。结构上最大的变化就是长期以来被低估的价值板块全面重估，P/E 估值抬升——市场偏好从“小而美”变成了“大而美”。很多典型的价值板块在 2017 年之前估值都分布于市场均衡线以下，到 2017 年中这些板块估值水平全面回归均衡水平。

龙头崛起和价值重估有投资者结构变化和资金偏好的因素，但是更为本质的原因在于坚实的基本面趋势和产业变迁规律。在经济温和复苏的宏观环境下，经过充分的竞争和优胜劣汰，行业龙头的护城河不断加宽，定价权进一步提升，行业整体利润向少数几家大公司聚集。行业集中度提升和优胜劣汰本来就是经济走向成熟阶段的特征之一，2016 年以来供给侧改革和严厉的环保政策更加快了小企业退出的速度。

本基金的重点投资领域是新兴产业，坚持自下而上、精选个股、相对集中的投资策略。2017 年本基金管理人认为 10-20%有核心竞争力的股票相对 2016 年有趋势性的投资机会，因此采取更为积极的操作策略，重点选择估值合理，业绩有内生高增长的质优公司，并积极把握行业之间的阶段性投资机会。报告期内，本基金净值增长-0.79%。

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 0.630 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.79%，业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年经济的上中下游基本上全面复苏，这种复苏的势头一直延续到 4 季度，依然没有出现明显减弱的迹象。继 9 月中采制造业 PMI 指数升至 52.4%（是 2012 年 5 月以来的新高），明显超出市场预期后，11 月、12 月该指依然维持在 51.8%和 51.6%，连续 15 个月超过 51%。其中值得关注的是建筑业 PMI 升至 5 年以来的景气高点，这可能预示着在低库存以及棚改、公租政策实施下，2018 年房地产投资继续存在超预期的可能，并进一步继续带动制造的景气。

展望 2018 年，在各行业和板块估值水平回归均衡的情况下，由于价值低估带来的投资的确定性明显降低，相反，由于预期的波动或者企业盈利增长暂时低于预期所带来的股价波动的可能性会明显上升。就某一阶段而言，A 股可能是预测性最差的市场，这可能和中国经济本身的高速发展和裂变、政策的多变和扰动、投资者结构的变化和演进以及投资工具不断创新有关。我们认为投资不应该建立在对市场整体的预测上，而是对 alpha 或者优秀企业的追逐。只要排除了通缩或者通胀这两个极端的经济状态，在较为正常的经济状态下，股票市场就是可为的。中国 A 股市场

近 10 年来指数维持在 3000 点附近，并非新兴市场的独有特点，即使在成熟的美国市场，道琼斯指数也曾经在 17 年间没有什么变动（1964 年 12 月 31 日 874.12 点，1981 年 12 月 31 日 875.00 点），同时期实际经济总量发生巨大变化，现在很多大公司就是从那个时期发展壮大起来的。

本基金管理人将继续秉持价值、成长的投资理念，深刻理解中国经济正在发生的变化，在新兴产业中深入挖掘，寻找具有广阔市场空间和长期成长潜力的行业和公司，选择其中最优秀的企业，以低估或者合理的价格买入，伴随企业共同成长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。基金托管人根据法律法规要求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委员会，由公司投研、运营的分管领导及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部负责人共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20826 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	129,561,949.11	439,651,335.82
结算备付金	-	2,934,704.98
存出保证金	368,710.52	546,520.12
交易性金融资产	1,651,603,945.46	1,898,248,405.28
其中：股票投资	1,651,603,945.46	1,898,248,405.28
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	60,000,230.00	-
应收证券清算款	27,717,021.96	44,535,614.86
应收利息	81,344.42	98,947.87
应收股利	-	-
应收申购款	68,347.10	81,879.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,869,401,548.57	2,386,097,408.64

负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	24,968,059.65	17,485,150.11
应付赎回款	3,791,085.47	730,740.01
应付管理人报酬	2,366,890.55	3,034,726.33
应付托管费	394,481.76	505,787.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,455,864.76	2,104,300.30
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,099.21	245,561.41
负债合计	33,176,481.40	24,106,265.86
所有者权益:		
实收基金	2,912,360,346.01	3,717,143,347.82
未分配利润	-1,076,135,278.84	-1,355,152,205.04
所有者权益合计	1,836,225,067.17	2,361,991,142.78
负债和所有者权益总计	1,869,401,548.57	2,386,097,408.64

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.630 元，基金份额总额 2,912,360,346.01 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	22,578,929.31	-610,706,389.92
1. 利息收入	2,749,246.44	6,301,676.12
其中：存款利息收入	2,472,086.07	5,115,052.51
债券利息收入	492.94	979,178.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	276,667.43	207,445.53
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-26,317,499.61	-156,795,729.27

其中：股票投资收益	-34,037,387.99	-159,037,693.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,099.38	-4,124,682.80
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,705,789.00	6,366,646.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	46,071,228.59	-460,598,804.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	75,953.89	386,467.75
减：二、费用	53,131,290.32	59,759,545.55
1. 管理人报酬	31,170,285.54	38,342,869.24
2. 托管费	5,195,047.61	6,390,478.21
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,311,686.35	14,630,662.45
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	454,270.82	395,535.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-30,552,361.01	-670,465,935.47
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-30,552,361.01	-670,465,935.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,717,143,347.82	-1,355,152,205.04	2,361,991,142.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-30,552,361.01	-30,552,361.01
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）	-804,783,001.81	309,569,287.21	-495,213,714.60
其中：1. 基金申购款	38,833,593.69	-14,875,200.51	23,958,393.18
2. 基金赎回款	-843,616,595.50	324,444,487.72	-519,172,107.78
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）	2,912,360,346.01	-1,076,135,278.84	1,836,225,067.17
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,102,849,407.05	-814,739,273.87	3,288,110,133.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-670,465,935.47	-670,465,935.47
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）	-385,706,059.23	130,053,004.30	-255,653,054.93
其中：1. 基金申购款	175,094,361.21	-64,682,358.36	110,412,002.85
2. 基金赎回款	-560,800,420.44	194,735,362.66	-366,065,057.78
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）	3,717,143,347.82	-1,355,152,205.04	2,361,991,142.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 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

7.4 报表附注

7.4.1 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.4 关联方关系

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

“中国建设银行”)	
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,170,285.54	38,342,869.24
其中：支付销售机构的客户维护费	14,422,466.92	19,852,009.92

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 X 1.5% / 当年天数

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,195,047.61	6,390,478.21

注：支付基金托管人中国建设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 X 0.25% / 当年天数

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
期初持有的基金份额	14,835,311.57	14,835,311.57
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	14,835,311.57	14,835,311.57
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.51%	0.40%

7.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	129,561,949.11	2,391,393.11	439,651,335.82	5,038,769.53

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

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间无需披露其他关联交易事项。

7.4.6 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
000820	神雾节能	2017年7月17日	重大事项	28.96	2018年1月17日	26.06	1,000,000	27,707,436.30	28,960,000.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	暂时停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	暂时停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例 (%)
1	权益投资	1,651,603,945.46	88.35
	其中：股票	1,651,603,945.46	88.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	60,000,230.00	3.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	129,561,949.11	6.93
8	其他各项资产	28,235,424.00	1.51
9	合计	1,869,401,548.57	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	25,720,000.00	1.40
B	采矿业	95,210,689.20	5.19
C	制造业	1,237,742,683.35	67.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,973,625.00	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,995,382.55	3.81
J	金融业	175,165,156.20	9.54
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	22,762,323.20	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,651,603,945.46	89.95

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,500,000	104,970,000.00	5.72
2	000830	鲁西化工	6,000,000	95,520,000.00	5.20
3	600188	兖州煤业	6,557,210	95,210,689.20	5.19
4	000538	云南白药	904,400	92,058,876.00	5.01
5	002475	立讯精密	3,899,924	91,414,218.56	4.98
6	002508	老板电器	1,790,178	86,107,561.80	4.69
7	300403	地尔汉宇	5,200,000	79,508,000.00	4.33
8	601717	郑煤机	11,850,643	77,977,230.94	4.25
9	601336	新华保险	999,931	70,195,156.20	3.82
10	002439	启明星辰	2,996,200	69,961,270.00	3.81

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司 <http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方 A	135,731,741.86	5.75
2	601318	中国平安	111,082,856.00	4.70
3	601717	郑煤机	104,103,899.53	4.41
4	002564	天沃科技	101,212,427.45	4.29
5	002475	立讯精密	97,540,682.19	4.13
6	600717	天津港	95,088,264.08	4.03
7	600188	兖州煤业	93,679,607.70	3.97
8	002273	水晶光电	93,155,772.72	3.94
9	603556	海兴电力	92,416,740.75	3.91
10	000830	鲁西化工	92,304,836.46	3.91
11	000538	云南白药	88,562,090.92	3.75
12	002508	老板电器	85,313,686.35	3.61
13	600219	南山铝业	85,059,802.00	3.60
14	600352	浙江龙盛	84,862,997.25	3.59
15	600089	特变电工	82,086,053.98	3.48
16	600060	海信电器	80,903,798.55	3.43
17	002064	华峰氨纶	79,759,069.55	3.38

18	000528	柳 工	79,312,456.27	3.36
19	000065	北方国际	78,395,583.88	3.32
20	002353	杰瑞股份	78,314,887.88	3.32
21	603186	华正新材	77,647,553.98	3.29
22	600690	青岛海尔	75,513,421.14	3.20
23	002195	二三四五	73,707,646.76	3.12
24	002439	启明星辰	70,912,068.53	3.00
25	601336	新华保险	68,991,081.62	2.92
26	000928	中钢国际	68,183,639.07	2.89
27	600856	中天能源	66,052,609.15	2.80
28	000811	冰轮环境	65,853,631.57	2.79
29	601328	交通银行	63,286,151.28	2.68
30	601988	中国银行	63,223,230.00	2.68
31	300197	铁汉生态	63,048,065.22	2.67
32	601689	拓普集团	60,958,238.48	2.58
33	600966	博汇纸业	60,926,058.38	2.58
34	000568	泸州老窖	59,336,850.80	2.51
35	600685	中船防务	58,580,169.97	2.48
36	600019	宝钢股份	58,292,319.96	2.47
37	600196	复星医药	57,932,330.62	2.45
38	002501	利源精制	56,530,398.66	2.39
39	000998	隆平高科	53,085,016.83	2.25
40	002045	国光电器	52,001,284.26	2.20
41	300083	劲胜智能	50,047,255.65	2.12
42	300003	乐普医疗	48,519,285.64	2.05
43	603716	塞力斯	47,471,346.16	2.01

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000725	京东方 A	218,227,806.32	9.24
2	300316	晶盛机电	158,298,148.19	6.70
3	600717	天津港	131,318,701.11	5.56
4	300097	智云股份	117,318,446.06	4.97

5	300342	天银机电	112,050,667.45	4.74
6	000820	神雾节能	107,323,004.79	4.54
7	000925	众合科技	88,456,783.70	3.75
8	600690	青岛海尔	87,943,737.24	3.72
9	000830	鲁西化工	87,815,866.19	3.72
10	600196	复星医药	87,765,502.73	3.72
11	000528	柳工	85,012,044.67	3.60
12	002564	天沃科技	82,662,563.51	3.50
13	600089	特变电工	81,278,101.32	3.44
14	300450	先导智能	79,682,345.78	3.37
15	002064	华峰氨纶	78,293,706.50	3.31
16	600060	海信电器	77,428,688.63	3.28
17	603186	华正新材	72,968,090.66	3.09
18	300232	洲明科技	71,881,194.35	3.04
19	300202	聚龙股份	70,861,361.46	3.00
20	002322	理工环科	70,421,950.51	2.98
21	600856	中天能源	69,981,383.07	2.96
22	002195	二三四五	69,609,727.35	2.95
23	600966	博汇纸业	69,323,544.94	2.93
24	603556	海兴电力	67,760,974.53	2.87
25	600525	长园集团	66,463,145.39	2.81
26	600685	中船防务	65,678,328.60	2.78
27	601988	中国银行	62,150,555.53	2.63
28	000065	北方国际	61,138,210.05	2.59
29	002662	京威股份	61,123,934.66	2.59
30	601328	交通银行	60,645,579.74	2.57
31	000811	冰轮环境	57,699,098.65	2.44
32	300083	劲胜智能	57,644,919.04	2.44
33	002353	杰瑞股份	57,321,317.12	2.43
34	002245	澳洋顺昌	56,800,967.08	2.40
35	002045	国光电器	56,411,586.48	2.39
36	300410	正业科技	55,715,336.11	2.36
37	300408	三环集团	55,340,750.44	2.34
38	300197	铁汉生态	55,093,602.92	2.33
39	601600	中国铝业	53,736,029.70	2.28
40	002519	银河电子	52,016,463.25	2.20
41	300003	乐普医疗	49,414,417.03	2.09
42	002546	新联电子	48,529,529.94	2.05

43	000928	中钢国际	48,311,873.42	2.05
44	601233	桐昆股份	48,070,745.96	2.04

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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,261,138,338.23
卖出股票收入（成交）总额	5,527,771,753.65

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	368,710.52
2	应收证券清算款	27,717,021.96
3	应收股利	-
4	应收利息	81,344.42
5	应收申购款	68,347.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,235,424.00

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例

35,635	81,727.52	20,698,407.66	0.71%	2,891,661,938.35	99.29%
--------	-----------	---------------	-------	------------------	--------

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月13日）基金份额总额	6,932,275,586.95
本报告期期初基金份额总额	3,717,143,347.82
本报告期基金总申购份额	38,833,593.69
减：本报告期基金总赎回份额	843,616,595.50
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	2,912,360,346.01

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

（1）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。

（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重大人事变动情况如下：

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行股份有限公司发布公告，聘任纪伟为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）负责本基金的审计事务。该事项经本基金管理人股东会审议通过，按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人，并已按规定向中国证券监督管理委员会、深圳证监局备案。从 2017 年起，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期本基金应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 100,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

西南证券	2	1,913,292,491.32	17.74%	1,743,582.16	17.74%	-
长江证券	2	1,866,031,662.83	17.30%	1,700,512.76	17.30%	-
华泰证券	1	1,826,756,848.16	16.94%	1,664,709.94	16.94%	-
平安证券	1	990,273,946.92	9.18%	902,437.24	9.18%	-
广发证券	2	964,317,876.55	8.94%	878,777.15	8.94%	-
万和证券	1	456,561,480.02	4.23%	416,063.54	4.23%	-
财通证券	2	417,213,504.31	3.87%	380,212.59	3.87%	-
长城证券	2	404,231,440.51	3.75%	368,375.14	3.75%	-
东方证券	2	378,731,073.27	3.51%	345,137.46	3.51%	-
国金证券	2	374,019,408.19	3.47%	340,844.96	3.47%	-
国泰君安	2	289,756,166.24	2.69%	264,054.68	2.69%	-
国信证券	1	273,661,734.98	2.54%	249,388.41	2.54%	-
东吴证券	1	254,982,374.95	2.36%	232,359.34	2.36%	-
招商证券	1	223,193,969.45	2.07%	203,395.54	2.07%	-
首创证券	-	85,563,427.88	0.79%	77,973.25	0.79%	-
兴业证券	2	65,100,937.95	0.60%	59,327.10	0.60%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申银宏源	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

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

2、应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单独指股票交易佣金。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(1) 本报告期内新租万和证券深圳交易单元一个，财通证券上海、深圳交易单元各一个，中信建投证券上海、深圳交易单元各一个，西南证券上海交易单元一个。

(2) 本报告期内退租首创证券上海、深圳交易单元各一个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	2,897,992.32	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银宏源	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日