# 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 宝盈核心优势混合 | |
| 基金主代码 | 213006 | |
| 交易代码 | 213006 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2009年3月17日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,600,051,999.79份 | |
| 投资目标 | 基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业,建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上,对于景气度较高的行业给予适当倾斜,以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制投资组合的市场适应性,在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。 | |
| 投资策略 | 1.资产配置策略<br>本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。<br>2.股票投资策略<br>根据公司的基本面情况,根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业,建立股票池。本基金在构建投资组合时,强调两阶段投资,价值与成长性能平衡,兼顾价值与成长型股票,以均衡资产组合策略建立动力资产组合。努力克服唯一风格投资所带来的局限性,这样可以较好控制组合市场适应性,一定程度上能够排除对景气误判概率,以求多空环境中都能创造主动管理回报。<br>3.债券投资策略<br>本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数x65%+上证国债指数x35% | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险预算范围内追求收益最大化。 | |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 宝盈核心优势混合A | 宝盈核心优势混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 213006 | 000241 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,563,135,831.92份 | 36,916,167.87份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年1月1日-2016年3月31日) | |
|---|---|---|
| | 宝盈核心优势混合A | 宝盈核心优势混合C |
| 1.本期已实现收益 | 33,681,286.03 | 2,662,420.45 |
| 2.本期利润 | -401,435,202.03 | -13,523,756.70 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2628 | -0.3294 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,845,276,270.63 | 43,068,711.07 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1805 | 1.1667 |

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

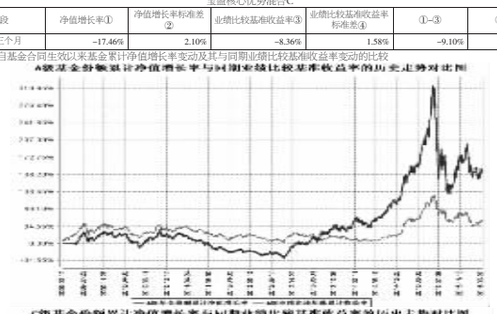
宝盈核心优势混合A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -17.58% | 2.12% | -8.36% | 1.58% | -9.22% | 0.54% |

宝盈核心优势混合C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -17.46% | 2.10% | -8.36% | 1.58% | -9.10% | 0.52% |

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



注: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.本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈核心优势混合C"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张小仁 | 本基金基金经理、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金经理 | 2014年9月26日 | - | 9年 | 张小仁先生,中山大学经济学硕士,2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理、中国国籍,证券投资基金从业人员资格。 |
| 易祚兴 | 本基金基金经理 | 2016年3月26日 | - | 5年 | 易祚兴先生,浙江大学计算机应用硕士,曾任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理研究员,自2014年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部研究员;宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈鑫安回报混合型证券投资基金、宝盈鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,中国国籍,证券投资基金从业人员资格。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场经历了大幅震荡,上证指数上涨-15.12%,创业板指数上涨-17.53%,一方面由于去年四季度的大幅反弹,获利资金较多;另一方面,人民币汇率新年后持续贬值,出逃了部分避险资金;外加"熔断机制"的实行,加剧了市场的恐慌情绪。春节后,随着人民币汇率的企稳,美元加息预期的减弱,再加经济企稳的迹象出现,市场进入了震荡企稳的阶段。本基金在去年底即开始减仓,但由于持仓多集中于风险偏好较高的中小盘股,损失仍然较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

宝盈核心优势混合A:本基金在本报告期内净值增长率是-17.58%,同期业绩比较基准收益率是-8.36%。
宝盈核心优势混合C:本基金在本报告期内净值增长率是-17.46%,同期业绩比较基准收益率是-8.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,205,758,183.75 | 63.13 |
| | 其中:股票 | 1,205,758,183.75 | 63.13 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 375,772,690.10 | 19.67 |
| | 其中:债券 | 375,772,690.10 | 19.67 |
| | 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 | 100,000,650.00 | 5.24 |
| | 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 | 169,320,882.54 | 8.86 |
| 8 | 其他资产 | 59,234,399.07 | 3.10 |
| 9 | 合计 | 1,910,086,805.46 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 21,570,000.00 | 1.14 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 501,584,977.02 | 26.56 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 29,154,683.46 | 1.54 |
| E | 建筑业 | 11,246,234.48 | 0.60 |
| F | 批发和零售业 | 41,798,400.00 | 2.21 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 137,461,170.93 | 7.28 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 36,996,750.00 | 1.96 |
| J | 金融业 | 65,018,000.00 | 3.44 |
| K | 房地产业 | 251,898,411.90 | 13.34 |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,059,555.96 | 0.69 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 95,970,000.00 | 5.08 |
| 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 | 1,205,758,183.75 | 63.85 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300187 | 永清环保 | 2,100,000 | 95,970,000.00 | 5.08 |
| 2 | 001979 | 招商蛇口 | 6,282,510 | 94,551,775.50 | 5.01 |
| 3 | 000060 | 中金岭南 | 6,999,919 | 78,189,095.23 | 4.14 |
| 4 | 002345 | 潮宏基 | 6,575,328 | 71,079,295.68 | 3.76 |
| 5 | 601688 | 华泰证券 | 3,800,000 | 65,018,000.00 | 3.44 |
| 6 | 600715 | 文投控股 | 1,500,000 | 61,740,000.00 | 3.27 |
| 7 | 600115 | 东方航空 | 9,999,969 | 60,799,811.52 | 3.22 |
| 8 | 000070 | 特发信息 | 2,320,566 | 53,210,578.38 | 2.82 |
| 9 | 600221 | 海南航空 | 15,000,000 | 47,550,000.00 | 2.52 |
| 10 | 603456 | 九洲药业 | 799,974 | 47,310,462.36 | 2.51 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 208,069,345.20 | 11.02 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 167,703,344.90 | 8.88 |
| | 其中:政策性金融债 | 167,703,344.90 | 8.88 |
| 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 | 375,772,690.10 | 19.90 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 018002 | 国开1302 | 1,536,730 | 167,703,344.90 | 8.88 |
| 2 | 010107 | 21国债(7) | 1,360,770 | 147,997,345.20 | 7.84 |
| 3 | 019515 | 15国债15 | 600,000 | 60,072,000.00 | 3.18 |

5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 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。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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持有国债期货。
5.10.3 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内除九洲药业外未受到公开谴责、处罚。

2015年1月17日,浙江九洲药业股份有限公司(以下简称"公司")位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故,造成1名工人受伤,经抢救无效死亡。事故发生后,公司立即启动突发事件应急处置预案,并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内,未对公司生产经营造成重大影响,也未对公司的经营业绩产生较大影响。

2015年4月22日,公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书,认定该事故为一般生产安全责任事故,给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司预计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。

我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在事故发生后及处罚决定下达后未做重大调整。

5.11.2
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。
5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,000,273.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 51,566,575.98 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,213,010.67 |
| 5 | 应收申购款 | 2,454,538.92 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 59,234,399.07 |

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,546,627,015.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 190,574,818.38 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 174,066,001.69 |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,563,135,831.92 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 4,300,645.16 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,300,645.16 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.27 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。
《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。
9.2 存放地点
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。
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1号
9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2016年4月22日

# 宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 宝盈鸿利收益混合 |
| 基金主代码 | 213001 |
| 交易代码 | 213001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2002年10月8日 |
| 报告期末基金份额总额 | 964,047,963.69份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下,为基金投资人谋求长期资本增值收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益:<br>(一)战略资产配置策略<br>基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标,对不同市场的风险收益状况做出判断,据此调整股票、债券和现金等大类资产的配置比例。<br>(二)股票投资策略<br>1.行业资金配置策略,首先由行业分析师估计各行业未来的期望增长速度,以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整,寻找总体投资价值被相对低估的行业,根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标,结合经济发展不同阶段对不同行业的影响,决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。<br>2.公司选择策略,本基金对上市公司投资价值的判断,主要依赖于两方面的基础工作:一是从行业发展趋势、公司核心竞争优势、公司运营管理效率的角度对公司进行定性分析,二是通过选择适当的估值模型对公司的投资价值进行定量测算。在筛选过程中,更强调公司长期(6-5年)的发展和竞争优势,稳定成长的市场,可持续的主营业务利润,良好的现金流和高意的红利分配政策。在对行业内上市公司进行分析排序的基础上,重点投资于位于行业前列的收益型上市公司,排序所依据的主要指标为红利收益率和增长率调整后的市盈率。<br>(三)短期收益类资产投资策略<br>在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。<br>(四)权证投资策略<br>本基金还可能运用组合财产进行权证投资,在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率x65% +中债综合指数收益率 位价)x35% | |
| 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。 | |
| 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 | |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年1月1日-2016年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -39,551,407.50 |
| 2.本期利润 | -239,359,093.51 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2438 |
| 4.期末基金资产净值 | 874,805,011.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.907 |

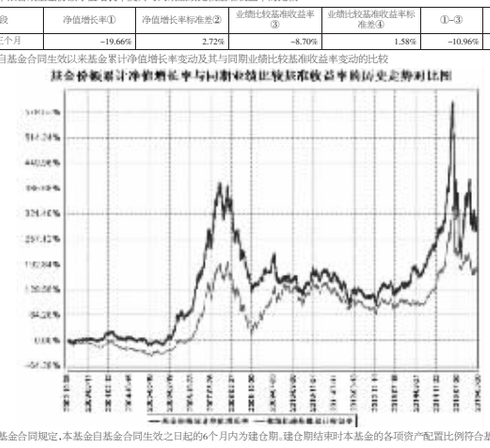
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | -19.66% | 2.72% | -8.70% | 1.58% | -10.96% | 1.14% |

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




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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张小仁 | 本基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金经理 | 2014年1月7日 | - | 9年 | 张小仁先生,中山大学经济学硕士,2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理、中国国籍,证券投资基金从业人员资格。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场经历了大幅震荡,上证指数上涨-15.12%,创业板指数上涨-17.53%,一方面由于去年四季度的大幅反弹,获利资金较多;另一方面,人民币汇率新年后持续贬值,出逃了部分避险资金;外加"熔断机制"的实行,加剧了市场的恐慌情绪。春节后,随着人民币汇率的企稳,美元加息预期的减弱,再加经济企稳的迹象出现,市场进入了震荡企稳的阶段。本基金在去年底即开始减仓,但由于持仓多集中于风险偏好较高的中小盘股,损失仍然较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是-19.66%,同期业绩比较基准收益率是-8.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 597,567,993.66 | 68.06 |
| | 其中:股票 | 597,567,993.66 | 68.06 |
| 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 | 100,000,290.00 | 11.39 |
| | 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 | 153,502,255.58 | 17.48 |
| 8 | 其他资产 | 26,891,422.26 | 3.06 |
| 9 | 合计 | 877,961,961.50 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 49,040,411.16 | 5.61 |
| B | 采矿业 | 35,325,000.00 | 4.04 |
| C | 制造业 | 226,068,476.94 | 25.84 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 8,243,436.48 | 0.94 |
| F | 批发和零售业 | 87,012,580.00 | 9.95 |
| 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 | 32,864,513.58 | 3.76 |
| J | 金融业 | 13,800,000.00 | 1.58 |
| K | 房地产业 | 99,513,575.50 | 11.38 |
| 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 | 45,700,000.00 | 5.22 |
| 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 | 597,567,993.66 | 68.31 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600682 | 南京新百 | 1,877,000 | 51,692,580.00 | 5.91 |
| 2 | 001979 | 招商蛇口 | 3,420,910 | 51,484,695.50 | 5.89 |
| 3 | 300187 | 永清环保 | 1,000,000 | 45,700,000.00 | 5.22 |
| 4 | 000070 | 特发信息 | 1,590,000 | 36,458,700.00 | 4.17 |
| 5 | 601069 | 西部黄金 | 1,500,000 | 35,325,000.00 | 4.04 |
| 6 | 002746 | 仙坛股份 | 915,731 | 34,660,418.35 | 3.96 |
| 7 | 600715 | 松江汽车 | 800,000 | 32,928,000.00 | 3.76 |
| 8 | 300325 | 德威新材 | 1,833,078 | 29,017,624.74 | 3.32 |
| 9 | 603456 | 九洲药业 | 460,699 | 27,245,738.86 | 3.11 |
| 10 | 300447 | 全信股份 | 350,962 | 26,743,304.40 | 3.06 |

5.4 报告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。
5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 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。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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持有国债期货。
5.10.3 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
报告期内本基金投资的前十名证券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除九洲药业外未受到公开谴责、处罚。

2015年1月17日,浙江九洲药业股份有限公司(以下简称"公司")位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故,造成1名工人受伤,经抢救无效死亡。事故发生后,公司立即启动突发事件应急处置预案,并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内,未对公司生产经营造成重大影响,也未对公司的经营业绩产生较大影响。

2015年4月22日,公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书,认定该事故为一般生产安全责任事故,给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司预计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。

我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在事故发生后及处罚决定下达后未做重大调整。

5.11.2
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。
5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,487,326.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 25,297,895.43 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 55,478.03 |
| 5 | 应收申购款 | 50,722.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,891,422.26 |

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告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。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,280,069,306.25 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 241,170,502.55 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 557,191,845.11 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 964,047,963.69 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈鸿利收益证券投资基金变更注册为宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金的文件。
《宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
《宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。
9.2 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
9.3 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
2016年4月22日

# 宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 宝盈泛沿海混合 |
| 基金主代码 | 213002 |
|