宝盈祥泰养老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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	宝盈祥泰养老混合
基金主代码	001358
交易代码	001358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	2,131,052,787.54份
投资目标	在严格控制下行风险的前提下,追求稳定的投资回报,为投资人提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,在控制下行风险的前提下,确定大类资产配置比例,通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益,适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)×1%
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,属于中等收益/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	中国建设银行股份有限公司

§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	4,031,063.53
2.本期利润	-1,667,312.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0007
4.期末基金资产净值	2,211,221,731.63
5.期末基金份额净值	1.038

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。

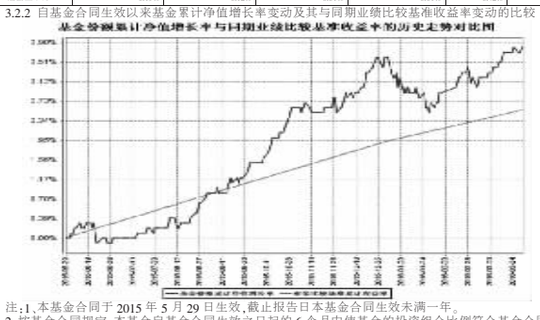
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.19%	0.12%	0.61%	0.01%	-0.42%	0.11%

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、本基金合同于2015年5月29日生效,截止报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、宝盈祥福养老混合型证券投资基金基金经理、宝盈祥裕养老混合型证券投资基金基金经理	2015年5月29日	-	13年	陈若劲女士,香港中文大学金融MBA,曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资,研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员,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《宝盈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,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,市场震荡上行,年初受熔断影响,市场大幅下跌,随着基本面数据的转暖和改革政策的不断推出,市场逐渐企稳,反弹渐次展开。报告期,我们对权益市场维持了谨慎的态度,继续维持较低的权益仓位,并紧密关注优质个股超跌带来的投资机会。同时,我们坚持积极参与权益市场一级投资,从中选择优良品种长期持有。

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0.19%,同期业绩比较基准收益率是0.61%。

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	41,405,581.84	1.62
	其中:股票	41,405,581.84	1.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,456,952,174.60	96.15
	其中:债券	2,456,952,174.60	96.15
	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	-	-
	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	14,143,995.98	0.55
8	其他资产	42,715,237.13	1.67
9	合计	2,555,216,989.55	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	-	-
B	采矿业	114,020.85	0.01
C	制造业	37,141,834.62	1.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	119,709.48	0.01
F	批发和零售业	172,820.34	0.01
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	3,857,196.55	0.17
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	-	-
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	41,405,581.84	1.87

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	600096	云天化	1,000,000	9,680,000.00	0.44
2	002241	歌尔声学	300,000	7,680,000.00	0.35
3	000418	小天鹅A	300,000	7,605,000.00	0.34
4	600809	山西汾酒	299,911	5,479,373.97	0.25
5	000590	启迪古汽	215,280	4,602,686.40	0.21
6	300496	中科创达	6,560	1,265,948.80	0.06
7	603508	思维列控	14,605	1,256,760.25	0.06
8	603996	中新科技	16,729	541,350.44	0.02
9	300494	盛天网络	6,251	525,709.10	0.02
10	002777	久远银海	4,264	460,512.00	0.02

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	90,147,000.00	4.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	198,441,000.00	8.97
	其中:政策性金融债	198,441,000.00	8.97
4	企业债券	71,308,000.00	3.22
5	企业短期融资券	742,695,000.00	33.59
6	中期票据	1,299,572,000.00	58.77
7	可转债(可交换债)	5,619,174.60	0.25
8	同业存单	49,170,000.00	2.22
9	其他	-	-
10	合计	2,456,952,174.60	111.11

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	140209	14国开09	1,200,000	128,796,000.00	5.82
2	1282290	12铝业MTN2	1,000,000	102,810,000.00	4.65
3	011520003	15中铝SCP003	1,000,000	100,540,000.00	4.55
4	041570003	15英华CP001	800,000	80,616,000.00	3.65
5	019527	15国债27	800,000	80,144,000.00	3.62

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有贵金属。

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

本基金本报告期未未持有权证。

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投资股指期货。

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投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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。

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	100,954.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,272,622.29
5	应收申购款	340,660.70
6	其他应收款	1,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,715,237.13

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	2,896,023,603.96
报告期期间基金总申购份额	5,188,927.12
减:报告期期间基金总赎回份额	770,159,743.54
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	2,131,052,787.54

§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祥泰养老混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥泰养老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:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

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

宝盈新价值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:招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。

基金托管人招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	宝盈新价值混合
基金主代码	000574
交易代码	000574
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月10日
报告期末基金份额总额	2,424,855,115.06份
投资目标	本基金以超越业绩比较基准为目标,在严格控制下行风险的基础上进行有效的资产配置与投资标的精选,力争实现资产的稳定增值。
投资策略	本基金将实施积极主动的投资策略,运用多种方法进行资产配置,具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四个部分组成。 (一)大类资产配置策略 本基金大类资产配置的策略目标是一方面规避相关资产的下行风险,另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。 (二)股票投资策略 本基金的股票投资采取行业配置与"自下而上"的个股精选相结合的方法,以深入的基本面研究为基础,精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票,通过定量和定性相结合的方式来构建备选股票库。 (三)固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。 (四)权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资,在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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	-254,808,886.19
2.本期利润	-701,372,485.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3215
4.期末基金资产净值	3,299,318,225.40
5.期末基金份额净值	1.361

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。

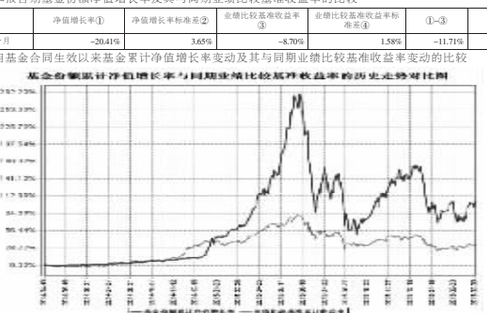
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-20.41%	3.65%	-8.70%	1.58%	-11.71%	2.07%

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		
鄢歌	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;总经理助理;投资部总监	2014年4月10日	-	15年	鄢歌先生,金融学硕士,曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所,银华基金管理有限公司投资管理部,万联证券有限责任公司研发中心。财富证券有限责任公司从事投资研究工作,2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部,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。本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易有1次,为不同投资组合因投资策略不同而发生的反向交易,相关投资组合经理按规定履行了审批程序。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度股票市场急跌企稳态势,上证指数跌幅15.12%,沪深300跌幅13.75%,深成指跌幅17.45%,同期,创业板指数跌幅17.53%,中小板指数跌幅为18.22%;整体来看中小板、创业板在一季度中小板、创业板落后于主板。本基金在一季度实现收益为-20.41%,低于比较基准,未能为基金持有人在本季取得收益。

本基金管理人认为,本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑,虽然政府反腐力度逐渐加大等因素,某种程度上短期对经济及职能效率有一定程度影响,但长期来看,出清腐败、加强监管、巩固执政理念,有利于更强有力的改革措施出台,减少改革阻力。目前来看,实体经济增速放缓趋势依然严峻,GDP增速在持续下滑调整过程中,政府需要通过各种货币政策工具来降低实体经济利率,给企业减压输血,同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级;从整体来看,政府依然能有决心实现稳步的经济增长,同时也全面支持发展新兴产业,无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展,都能体现国家对经济结构转型升级的决心。

从改革开放三十多年的经济发展历程来看,不要去质疑政府对发展经济作为第一要务的决心,也不要去轻易判断经济会断崖式下跌或者硬着陆等,我们需要积极的去适应当前经济转型的新常态,需要有耐心的寻找产业转型新的方向和政府职能转变后新的机遇,总之,我们处在激烈变革的新时代,必然伴随着社会行为及市场主体发生着相应的波动行为,我们相信当前的一切痛苦可以是一个深度的自然净化过程,我们需要的是一种坚持的信念。

回顾市场,一季度以触发下跌熔断急速调整,使得开年以来多数投资人始料未及,也迫使政府不得不暂停熔断机制,整体来说,一季度市场依然是延续去年6月份以来的熊市下跌态势,市场参与者依然处于情绪恐慌之中,资金也加速离场,市场企稳依然需要一个漫长的过程。虽然一季度未能取得较好的收益,但在实际操作中,基金管理人坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来来操作,在板块选择上坚持选择与过往市场不同的新的投资方向和成长主题,虽然短期未能产生正收益,但也在新价值规模增加的情况下充分布局思买的标的。本季度主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、体育、泛娱乐等方向。

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-20.41%,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	2,860,635,573.96	83.99
	其中:股票	2,860,635,573.96	83.99
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	100,000,000.00	2.94
	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	407,069,768.80	11.95
8	其他资产	38,092,473.99	1.12
9	合计	3,405,797,816.75	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	81,848,336.02	2.48
B	采矿业	14,014,931.15	0.42
C	制造业	1,625,071,618.02	49.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	104,168,672.88	3.16
F	批发和零售业	134,472,151.28	4.08
G	交通运输、仓储和邮政业	64,668,302.46	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	384,007,099.44	11.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	121,004,488.38	3.67
L	租赁和商务服务业	197,752,436.67	5.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	68,648,688.50	2.08
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	64,978,849.16	1.97
S	综合	-	-
	合计	2,860,635,573.96	86.70

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	300005	探路者	7,471,554	133,591,385.52	4.05
2	300252	金信诺	4,704,014	132,559,114.52	4.02
3	603456	九洲药业	2,032,656	120,211,275.84	3.64
4	002773	康弘药业	1,787,622	118,197,566.64	3.58
5	300420	五洲科技	2,538,160	117,237,610.40	3.55
6	600057	象屿股份	10,037,005	102,377,451.00	3.10
7	002445	中南重工	5,001,700	99,533,830.00	3.02
8	300047	天源迪科	5,130,146	94,856,399.54	2.88
9	002368	太极股份	2,548,350	92,377,687.50	2.80
10	300170	汉得信息	5,964,172	84,094,825.20	2.55

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投资。

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投资。

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投资股指期货。

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投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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(代码:603456)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减持。

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	1,842,982.43
2	应收证券清算款	19,311,046.87
3	应收股利	-
4	应收利息	101,672.48
5	应收申购款	16,836,772.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,092,473.99

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	2,079,633,886.89
报告期期间基金总申购份额	1,018,733,262.52
减:报告期期间基金总赎回份额	673,512,034.35
报告期期间基金份额变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,424,855,115.06

§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	5,658,743.63
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	5,658,743.63
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.23

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新价值灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈新价值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:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦

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

宝盈新兴产业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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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
报告期末基金份额总额	4,101,217,330.92份
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四部分组成。 一、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。
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

§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	-125,965,146.33
2.本期利润	-697,863,707.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1695
4.期末基金资产净值	2,588,896,841.18
5.期末基金份额净值	0.631

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	-21.22%	3.23%	-10.91%	1.94%	-10.31%	1.29%

3.2.2 自基金合同生效以