宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月27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2017年10月26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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈国家安全沪港深股票
基金主代码	001877
交易代码	001877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月20日
报告期末基金份额总额	125,138,578.63份
投资目标	本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券,在严格控制投资风险的条件下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
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金融衍生品投资策略四部分组成。 (一)大类资产配置策略 本基金将在基金合同约定的投资范围内,结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析,自上而下地实施积极的大类资产配置策略,并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例。 (二)股票投资策略 本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域:(1)国防安全相关的军工及其上、下游领域,包括航海、航空、航天、兵器、核工业等;(2)能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域,包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保 工程及服务等;(3)信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域,包括通讯设备、计算机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素,有效结合国家政策导向,分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平,通过对各指标的深入研究,动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上,通过定性分析与定量分析相结合的方法,精选 出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。 (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、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。 (四)金融衍生品投资策略 本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。 本基金可投资于港股通标的股票,除了需要承担境内证券市场投资风险之外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险,包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险(在内地市场开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。
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

§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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-11,902,965.95
2.本期利润	-4,063,090.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0305
4.期末基金资产净值	120,023,827.70
5.期末基金份额净值	0.959

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。

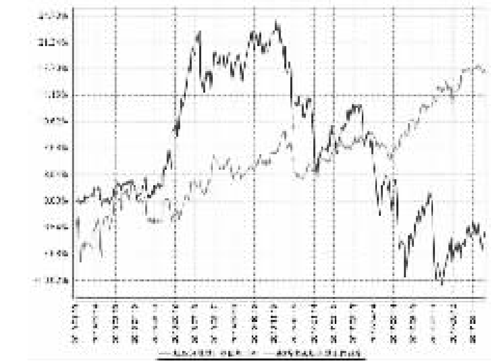
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.94%	1.26%	4.27%	0.45%	-7.21%	0.81%

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		
易祚兴	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理	2016年6月30日	-	6年	易祚兴先生,浙江大学计算机应用硕士。曾任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员,自2014年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部研究员;宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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

2017年前三季度市场整体向好,上证综指涨幅为7.9%、沪深300涨幅为15.9%、深成指涨幅为8.94%,同期,创业板指跌幅为4.84%,中小板指数涨幅为16.8%;整体来看除了创业板指数较为疲软以外,整体指数走势较为强劲。

本基金管理人在半年度报告中对创业板股票表现较弱从多方面进行了较详细的分析。三季度,市场运行较上半年有所变化。上游周期行业(钢铁、有色、煤炭等)在2季度中下旬触底反弹,三季度表现依然非常强势,主要是受供给侧改革和环保核查等因素的影响,相关企业盈利能力大幅好转,也带动了银行坏账率的下行。同时,由于上游原材料涨价、汇率升值、对地产担忧等原因,上半年表现非常强势的家电板块3季度处于横盘状态。上半年强势的食品饮料板块,在次高端白酒和伊利股份等企业的基本面推动下继续上涨。创业板在3季度触底反弹,主要是几个方面原因:1)经过下跌和时间消化,估值逐步趋于合理;2)受到人工智能、半导体、5G等强主题的推动。3)在厦门金砖会议上习主席提到积极投身智能制造、互联网+、数字经济、共享经济等带来的创新发展浪潮。

相比中报,3季度大幅增加了军工、上游战略资源相关个股的配置。9月22日,习近平主持召开中央军民融合发展委员会第二次全体会议,军民融合作为国家战略进入加速推进期;且强大军事能力也是一带一路国家战略的坚强保障。另外,当前信息产业也处在一个大的变革时期,5G、人工智能、AR/VR、云计算和云存储等未来的大趋势都处在爆发前夜,也有望带来信息安全方面诸多投资机会。

本基金管理人认为,市场的规律已经发生了与过去四年截然不同的变化,在金融去杠杆、IPO加速、外资定价权加强等大的背景下,市场风险偏好也会相对较低,有稀缺性的行业龙头在相当长的时间内都会受到市场的青睐。中期来看,十九大会议需要重点关注,相关的政策可能对4季度和明年的市场走势产生较大的影响。

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-2.94%,同期业绩比较基准收益率是4.27%。

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	105,921,365.19	85.19
	其中:股票	105,921,365.19	85.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	71,484.00	0.06
	其中:债券	71,484.00	0.06
	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	17,872,954.33	14.38
8	其他资产	463,163.80	0.37
9	合计	124,328,967.32	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	95,152,502.93	79.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.03
E	建筑业	674.10	0.00
F	批发和零售业	26,380.90	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,801,434.00	4.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,663,459.03	4.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	51,196.08	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	105,921,365.19	88.25

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600038	中直股份	226,000	9,878,460.00	8.23
2	000768	中航飞机	400,100	7,693,923.00	6.41
3	002637	赞宇科技	584,900	7,393,136.00	6.16
4	600219	南山铝业	1,708,100	6,815,319.00	5.68
5	601600	中国铝业	856,700	6,485,219.00	5.40
6	600885	宏发股份	152,300	6,323,496.00	5.27
7	601233	桐昆股份	367,190	6,300,980.40	5.25
8	002050	三花智控	354,700	5,703,576.00	4.75
9	002368	太极股份	203,900	5,645,991.00	4.70
10	601689	拓普集团	192,600	5,531,472.00	4.61

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,484.00	0.06
	其中:政策性金融债	71,484.00	0.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	71,484.00	0.06

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	700	71,484.00	0.06

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投资。

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。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体拓普集团于2017年7月21日收到中国证券监督管理委员会宁波监管局《关于对宁波拓普集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》([2017] 18号)。

该决定书公告:"经查,你公司于2017年5月26日先后将募集资金60,000万元和40, 000万元用于临时补充流动资金。2017年6月1日,你公司公告《关于使用部分闲置自有资金进行结构性存款或购买保本型理财产品的进展公告》,公告中披露,'为提高自有资金的使用效率,宁波拓普集团股份有限公司使用金额为人民币60,000万元的闲置自有资金购买兴业银行股份有限公司宁波分行北仑支行的保本浮动收益型人民币理财产品',而实际上你公司5月27日用于购买保本型理财产品的60,000万元实系刚用于补充流动资金的募集资金。2017年7月14日,你公司将临时补充流动资金的60,000万元归还至募集资金专户。你公司的上述行为违反了《上市公司监管指引第2号——上市公司募集资金管理和使用的监管要求》以及《上市公司信息披露管理办法》第二条的相关规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九的相关规定,我局决定对你公司采取出具警示函的监管措施,提醒你公司引以为戒,杜绝类似问题再次发生"

在收到《决定书》后,公司董事会及管理层对上述问题高度重视,并针对《决定书》提出的问题进行了全面、深刻分析,公司全体董事、监事和高级管理人员及相关工作人员将强化对《上市公司监管指引》、《上市公司信息披露管理办法》、《上海证券交易所上市公司募集资金管理办法》等相关法规及公司《募集资金管理制度》的深入学习,加强对监管背景及上述规范的理解,强化勤勉尽责意识,提高风险把控能力,防范此类问题再次发生。

本基金投资于拓普集团的决策程序说明:基金管理人看好拓普集团在汽车零部件国产化、智能化和电子化进程中的快速崛起,公司业绩也一直保持较高速增长,拓普集团上述行为仅是对自有资金的处置不当,不影响公司未来正常的经营活动和投资进程,基于对公司深入研究和估值比较,基金管理人买入并持有。

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	88,542.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,115.18
5	应收申购款	368,506.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	463,163.80

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002637	赞宇科技	7,393,136.00	6.16	重大事项
2	601600	中国铝业	6,485,219.00	5.40	重大事项

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	138,077,710.95
报告期期间基金总申购份额	27,447,602.12
减:报告期期间基金总赎回份额	40,386,734.44
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	125,138,578.63

§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

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人住所:北京市西城区复兴门内大街1号

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
2017年10月27日

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月27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2017年10月26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2017年7月1日起至9月30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	1,316,270,279.53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,对于景气度提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 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。 2、股票投资策略 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,强调两端投资,价值与成长性能平衡,兼顾价值与成长型股票,以均衡资产混合策略建立动力资产组合,努力克服单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。 3、债券投资策略 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×65%+上证国债指数×35%	
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	1,295,102,555.82份	21,167,723.71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(2017年7月1日 - 2017年9月30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	35,384,816.84	535,785.51
2.本期利润	112,465,394.29	1,660,989.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0801	0.0760
4.期末基金资产净值	1,336,357,739.42	21,251,886.31
5.期末基金份额净值	1.0319	1.0040

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

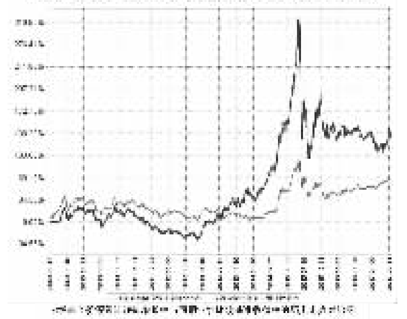
宝盈核心优势混合A

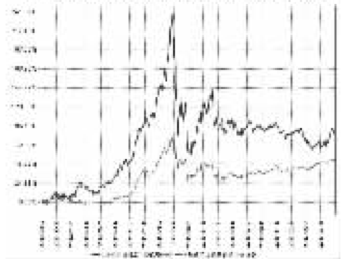
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.67%	1.09%	3.08%	0.39%	5.59%	0.70%

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	8.24%	1.09%	3.08%	0.39%	5.16%	0.70%

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		
易祚兴	本基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金和宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理	2016年3月26日	2017年7月29日	6年	易祚兴先生,浙江大学计算机应用硕士。曾任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员,自2014年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部研究员;宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
李健伟	本基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年1月25日	-	6年	李健伟先生,华南理工大学工学硕士。2007年8月至2010年4月,在普华永道咨询有限公司任职高级顾问。2010年4月至2012年12月,在广发证券股份有限公司任职稽核员、行业研究员。2012年12月加入宝盈基金管理有限公司,先后任职研究部研究员、专户投资部投资经理。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

本基金2017年中报中,对于下半年的投资策略和方向,基金管理人认为:"金融去杠杆与金融监管趋严叠加流动性收紧态势依然延续,虽然边际上有所改善,但市场风险偏好仍然较低。中国经济展现出较强韧性,中游制造龙头企业在经济回暖和竞争格局改善的双重作用下盈利恢复得以持续。新能源汽车等高景气度的行业龙头也会得到市场的持续追捧。同时,某些真成长高确定性的品种,由于静态估值贵,在上半年跌幅较深,该类标的将在四季度估值切换过程中迎来系统性的机会。上述方向将是本基金未来重点配置的方向。"

基于以上投资策略,本基金加大了对周期性中游制造业,新能源汽车和TMT等领域的配置,该投资组合获得了较好的投资收益,本基金在三季度宝盈核心优势混合A实现了8.67%的正收益,宝盈核心优势混合C实现了8.24%的正收益(同期沪深300指数收益4.63%)。

展望四季度,央行定向降准意味着货币政策的宽松信号开始出现,人民币汇率走稳为货币政策预留操作空间,9月份PMI数据开始呈现反弹,这都是市场的积极信号。虽然宏观周期是否会呈现二次探底暂时没有定论,但从目前预披露情况来看,上市公司三季度净利润增速为37%,环比二季度回升14.4%。海外市场,特朗普政府的减税计划拖延了大半年后终于面世整体框架,虽力度有所减小,但仍是多年来美国历史上规模最大的减税,这将为美国经济注入一剂强心针,利多全球经济与美元、同时利多权益类市场和大宗商品。国内方面,随着十九大召开日益临近,预计明年政府工作重点将更多投入到经济工作建设中,有利于提升市场整体风险偏好。基于此,我们认为四季度仍然将是比较不错的投资窗口。我们重点看好的领域和方向包括:工业环保,5G,供给侧改革,以及跨年度估值切换的成长股。

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8.67%,同期业绩比较基准收益率是3.08%。

宝盈核心优势混合C:本基金在本报告期内净值增长率是8.24%,同期业绩比较基准收益率是3.08%。

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	1,011,224,383.80	72.93
	其中:股票	1,011,224,383.80	72.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	256,226,108.34	18.48
	其中:债券	256,226,108.34	18.48
	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	104,022,995.23	7.50
8	其他资产	15,128,459.79	1.09
9	合计	1,386,601,947.16	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	10,289,793.60	0.76
C	制造业	731,913,177.43	53.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,380.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	162,618,458.55	11.98
J	金融业	70,014,650.00	5.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,213,157.20	2.67
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	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,011,224,383.80	74.49

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	600985	雷鸣科化	6,179,999	78,918,587.23	5.81
2	002709	天赐材料	1,150,000	61,467,500.00	4.53
3	002766	索菱股份	2,863,989	56,363,303.52	4.15
4	300603	立昂技术	1,661,012	55,992,714.52	4.12
5	002368	太极股份	1,712,000	47,405,280.00	3.49
6	000063	中兴通讯	1,601,740	45,329,242.00	3.34
7	002045	国光电器	2,613,569	45,057,929.56	3.32
8	600019	宝钢股份	6,046,000	44,679,940.00	3.29
9	600388	龙净环保	2,613,805	44,225,580.60	3.26
10	601688	华泰证券	1,885,000	42,638,700.00	3.14

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	107,952,579.90	7.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,555,112.00	8.14
	其中:政策性金融债	110,555,112.00	8.14
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)	37,718,416.44	2.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	256,226,108.34	18.87

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	1,082,600	110,555,112.00	8.14
2	010107	21国债(7)	1,058,670	107,952,579.90	7.95
3	127003	海印转债	372,859	37,718,416.44	2.78

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体华泰证券于2017年1月18日收到中国证监会行政监管措施决定书《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2017]3号)。该决定书涉及公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三十九条、《私募投资基金监督管理暂行办法》第十四条、《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。

同日,华泰证券控股子公司华泰联合证券收到中国证监会行政监管措施决定书《关于对华泰联合证券有限责任公司采取出具警示函措施的决定》([2017]4号) 。该决定书涉及公司作为北京利德曼生化股份有限公司发行股份购买资产并募集配套资金项目的财务顾问,对标的资产主要客户和供应商的核查不充分。上述行为违反了《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》第三条、第二十四条的规定。

本基金投资于华泰证券的决策程序说明:随着资本市场逐渐转暖,市场成交量逐步放大和金融创新的不断推进,基金管理人看好华泰证券的长期发展,基于对基本面研究以及二级市场的判断,基金管理人买入并持有。

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	388,147.01
2	应收证券清算款	8,572,759.41
3	应收股利	-
4	应收利息	5,543,889.21
5	应收申购款	623,664.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,128,459.79

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127003	海印转债	37,718,416.44	2.78

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600985	雷鸣科化	78,918,587.23	5.81	重大事项
2	300603	立昂技术	55,992,714.52	4.12	重大事项

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

项目	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
报告期期初基金份额总额	1,557,160,511.35	22,673,172.90
报告期期间基金总申购份额	47,206,295.51	847,631.79
减:报告期期间基金总赎回份额	309,264,251.04	2,353,080.98
报告期期末基金份额总额	1,295,102,555.82	21,167,723.71

§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(%)	0.33

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

8.1 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。

8.2 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。

§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办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人住所:北京市西城区复兴门内大街1号

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
2017年10月27日

宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9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
报告送出日期:2017年10月27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2017年10月26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2017年7月1日起至9月30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	381,270,246.62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: (一)战略资产配置策略 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。 (二)股票投资策略 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。 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(3-5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、良好的现金流和满意的红利分配政策。在对行业内上市公司进行合理排序的基础上,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。 (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、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。 (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(全价)×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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	37,411,548.71
2.本期利润	42,498,431.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.1093
4.期末基金资产净值	383,999,071.52
5.期末基金份额净值	1.007

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。

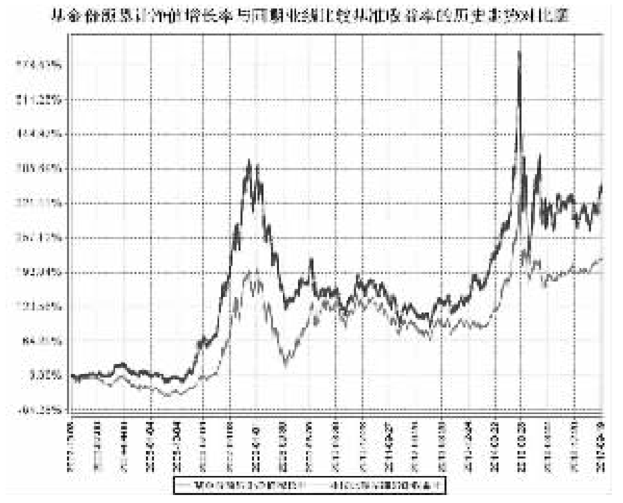
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.26%	1.04%	2.96%	0.38%	9.30%	0.66%

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		
李进	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金的基金经理	2017年1月4日	-	7年	李进先生,武汉大学金融学专业硕士。2007年7月至2010年2月任职于中国农业银行深圳分行,担任信贷审批员,2010年3月至2013年8月任职于华泰联合证券研究所,担任研究员。自2013年8月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究员、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

2017年前三季度本基金上涨16.42%。三季度,市场企稳回升,周期股、消费股和成长股精彩纷呈。三季度,本基金重点增持了新能源汽车行业股票,同时买入了估值相对便宜、业绩高增长的个股;白马股以消费电子为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期基金份额净值增长率为12.26%,业绩比较基准收益率为2.96%。

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	332,614,653.76	85.06
	其中:股票	332,614,653.76	85.06
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	-	-
	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	57,488,704.63	14.70
8	其他资产	934,358.51	0.24
9	合计	391,037,716.90	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	39,793.60	0.01
C	制造业	271,499,043.67	70.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,380.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,458,645.03	8.45
J	金融业	28,295,500.00	7.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.02
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	115,299.99	0.03
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	332,614,653.76	86.62

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	002833	弘亚数控	547,486	35,422,344.20	9.22
2	603197	保隆科技	494,956	26,712,775.32	6.96
3	000063	中兴通讯	880,000	24,904,000.00	6.49
4	300567	精测电子	234,993	24,836,410.17	6.47
5	603111	康尼机电	1,320,000	19,588,800.00	5.10
6	603556	海兴电力	417,800	17,564,312.00	4.57
7	300308	中际旭创	325,000	15,791,750.00	4.11
8	600030	中信证券	850,000	15,461,500.00	4.03
9	002624	完美世界	465,000	15,233,400.00	3.97
10	600999	招商证券	600,000	12,834,000.00	3.34

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	286,778.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,623.46
5	应收申购款	633,956.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	934,358.51

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603111	康尼机电	19,588,800.00	5.10	重大事项

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	395,851,693.21
报告期期间基金总申购份额	19,770,363.75
减:报告期期间基金总赎回份额	34,351,810.34
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	381,270,246.62

§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

8.1 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。

8.2 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。

§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
2017年10月27日