

# 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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 2016 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	
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	
报告期末基金份额总额	1,644,279,865.39 份	
基金合同存续期	不定期	
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	1,618,892,713.15 份	25,387,152.24 份
-----------------	--------------------	-----------------

## 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p>
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。
--	------------------------------------------------------------------------------------

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	王永民
	联系电话	0755-83276688	010-66594896
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95566
传真		0755-83515599	010-66594942

## 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	基金管理人办公场所、基金托管人住所

## § 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	2016 年		2015 年		2014 年	
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
本期已实现收益	-18,113,405.92	1,362,299.75	2,205,781,697.47	80,116,609.88	1,358,988,274.22	38,323,774.46
本期利润	-493,220,044.11	-15,541,837.54	1,776,199,053.89	74,525,232.83	2,148,789,015.90	55,282,138.26
加权平均基金份额本期利润	-0.2943	-0.4628	0.6617	0.9160	0.7500	0.6896
本期基金份额净值增长率	-21.53%	-22.29%	26.28%	25.52%	80.11%	77.98%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	

期末可供分配基金份额利润	0.0647	0.0399	0.3851	0.3648	0.1977	0.1926
期末基金资产净值	1,723,642,627.83	26,399,545.89	2,330,726,353.63	135,234,917.73	7,206,242,829.54	233,748,101.27
期末基金份额净值	1.0647	1.0399	1.5070	1.4881	1.5035	1.4968

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 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	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	-1.19%	0.71%	1.18%	0.47%	-2.37%	0.24%
过去六个月	-3.04%	0.80%	3.75%	0.49%	-6.79%	0.31%
过去一年	-21.53%	1.34%	-5.88%	0.91%	-15.65%	0.43%
过去三年	78.47%	1.84%	35.36%	1.16%	43.11%	0.68%
过去五年	179.08%	1.62%	38.99%	1.05%	140.09%	0.57%
自基金合同生效起至今	134.80%	1.48%	50.39%	1.05%	84.41%	0.43%

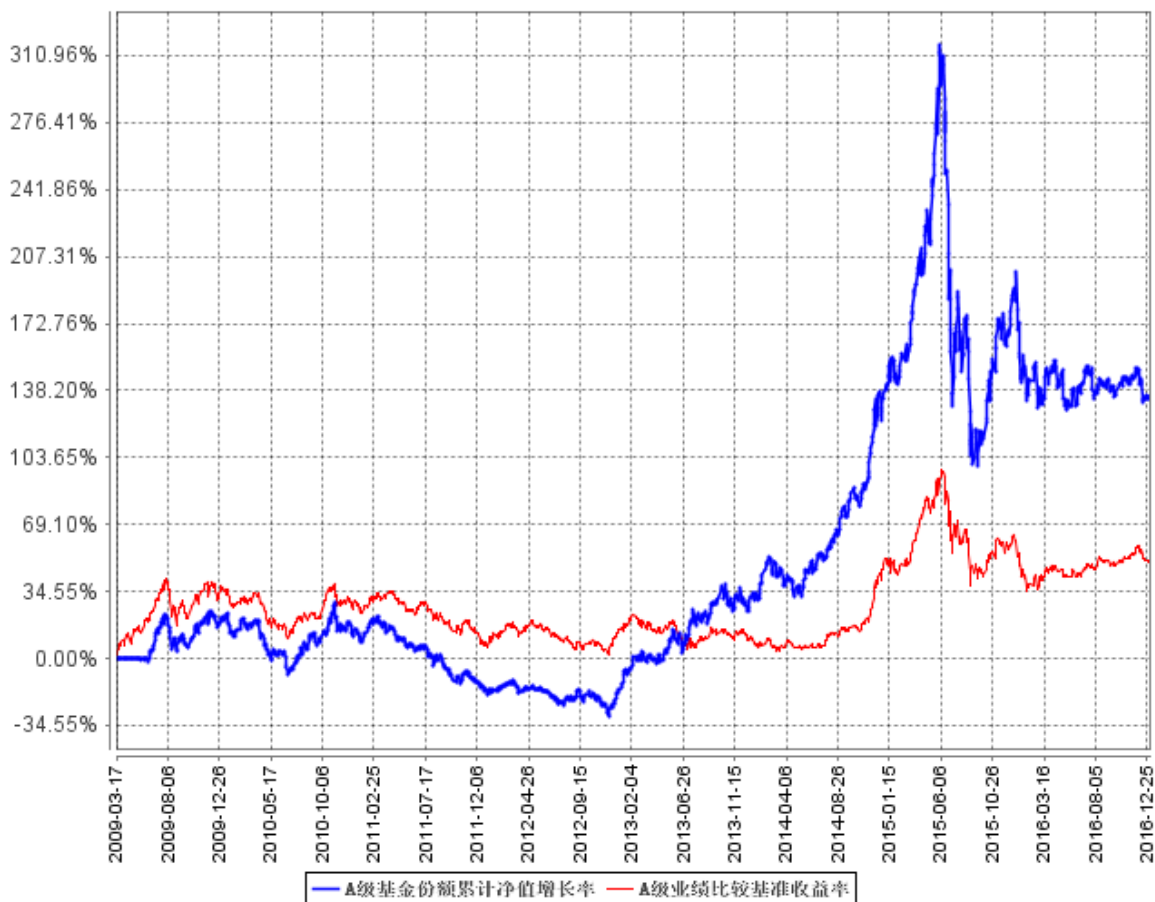
宝盈核心优势混合 C

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	-1.55%	0.71%	1.18%	0.47%	-2.73%	0.24%
过去六个月	-3.77%	0.80%	3.75%	0.49%	-7.52%	0.31%
过去一年	-22.29%	1.33%	-5.88%	0.91%	-16.41%	0.42%

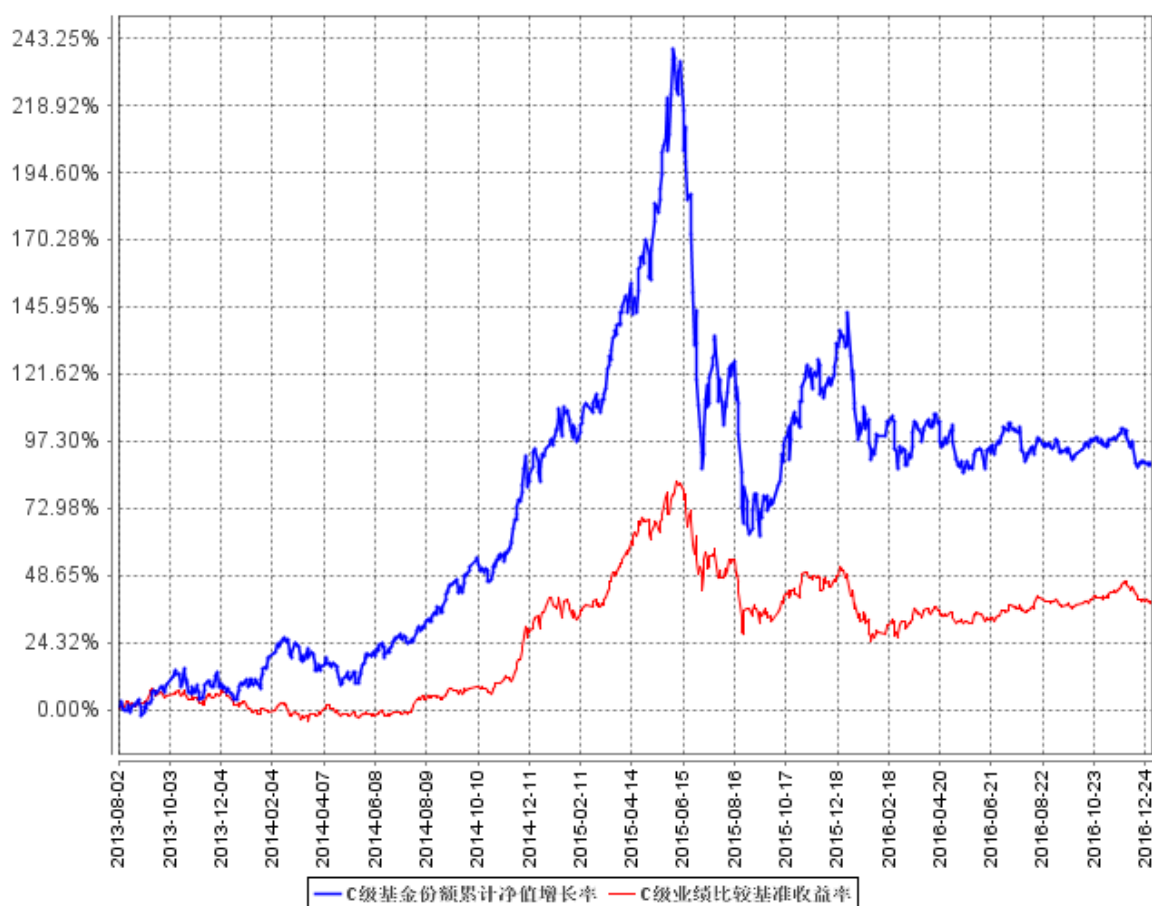
过去三年	73.60%	1.84%	35.36%	1.16%	38.24%	0.68%
自基金合同生效起至今	88.47%	1.80%	39.27%	1.12%	49.20%	0.68%

### 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

A级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



C级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

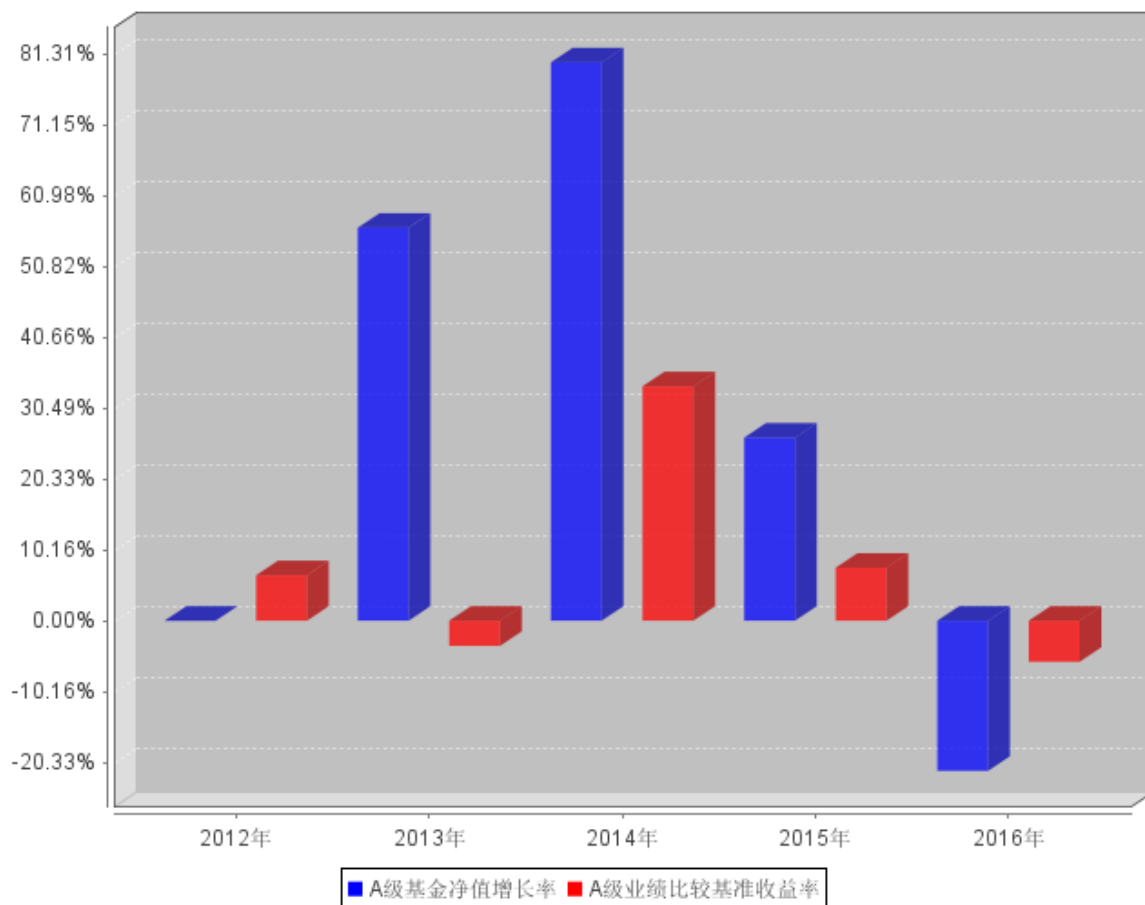


注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

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”。

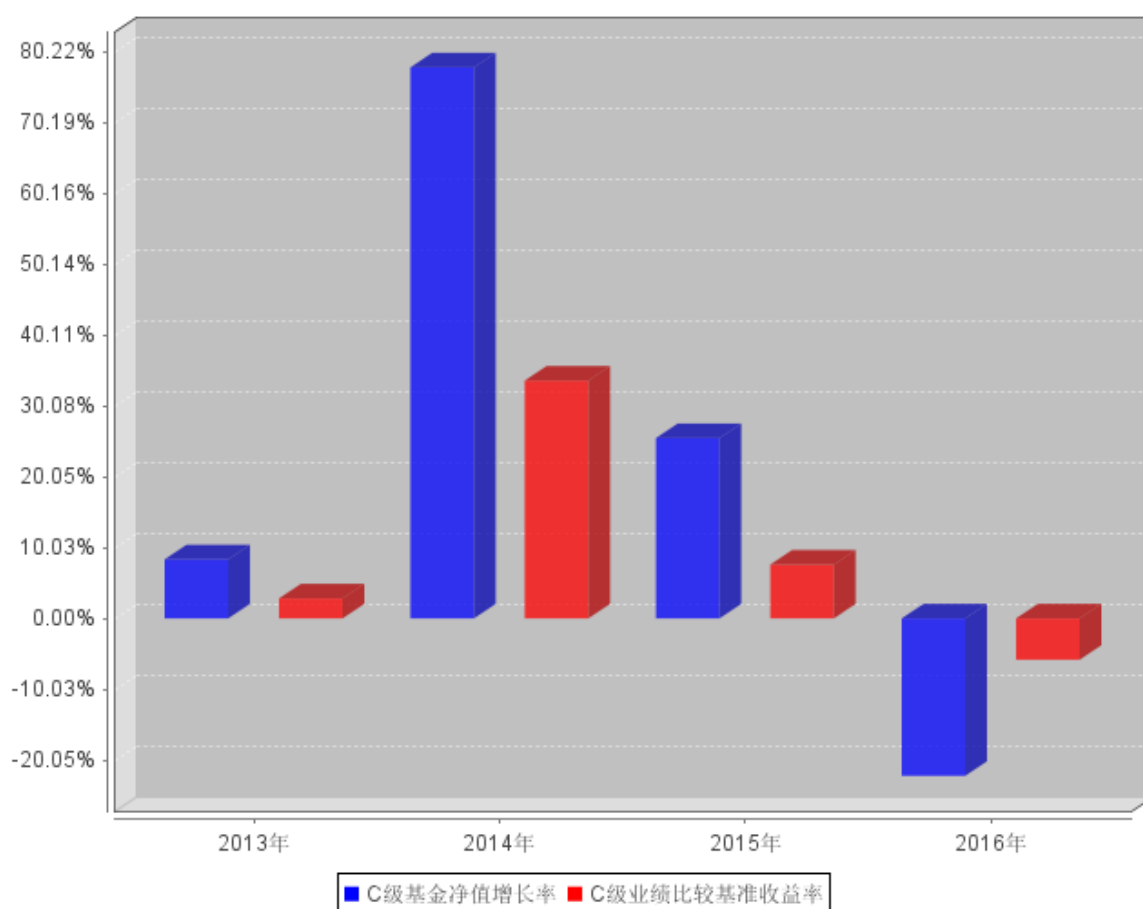
### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年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





C级过去五年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



注：1、本基金合同生效日为 2009 年 3 月 17 日，合同生效日当年，本基金的收益率和业绩比较基准收益率是按实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

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”。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

宝盈核心优势混合 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.2000	126,696,631.09	70,066,537.53	196,763,168.62	
2015	4.4000	771,547,112.80	653,051,479.42	1,424,598,592.22	
2014	2.5500	400,216,351.90	309,935,411.81	710,151,763.71	
合计	8.1500	1,298,460,095.79	1,033,053,428.76	2,331,513,524.55	

单位：人民币元

宝盈核心优势混合 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.2000	2,681,548.07	1,832,253.93	4,513,802.00	
2015	4.4000	23,356,159.18	22,115,216.22	45,471,375.40	
2014	2.4500	15,404,859.00	4,111,514.21	19,516,373.21	
合计	8.0500	41,442,566.25	28,058,984.36	69,501,550.61	

## §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。公司目前管理基金鸿阳、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	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

	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				核心研究员、宝盈泛沿海区域增长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。
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。

注：1、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；

2、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 2016 年 12 月 31 日。

#### 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 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，对于异常交易发生前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。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 2 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 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

2016 年一季度，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。

2016 年二季度，市场窄幅震荡，上证指数上涨-2.47%，创业板指数上涨-0.47%。市场窄幅震荡的背后，却有多重重大变量发生了显著变化。其中，人民币相比美元贬值明显（-2.6%），英国超预期地公投出“脱欧”的结果，而加入 MSCI 则仍需等待。本基金在五月中下旬开始显著加仓，基于自下而上的选股策略，行业主题主要集中在军工、储能、新能源等方向。

2016 年三季度，市场窄幅震荡，上证指数上涨 2.56%，创业板指数上涨-3.5%。本基金自五月中下旬显著加仓后，继续保持了比较高的水平。基于自下而上的选股策略，主要集中在以消费、地产为代表的价值股，以及以储能、军工信息化为代表的成长股。

2016 年四季度，市场窄幅震荡，上证指数上涨 3.29%，创业板指数上涨-8.74%。本基金自五月中下旬显著加仓后，一直保持了较高的水平。主要基于个股长期价值出发，重仓品种主要集中在地产、消费、医药等领域；由于集中度较低，而且短期缺乏刺激，目前表现仍然一般。

#### 4.4.2 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-21.53%，同期业绩比较基准收益率是-5.88%。

宝盈核心优势混合 C：本基金在本报告期内净值增长率是-22.29%，同期业绩比较基准收益率是-5.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2017 年，我们认为市场不会是波澜壮阔的牛市，但是权益市场是有机会的，会诞生出数量不菲的牛股。原因在于：货币政策保持稳健中性，整体尚较为宽松。企业盈利趋于稳定，市场风险偏好正在恢复。低利率环境下，银行资管和保险公司等传统负债型的机构不得不向固定收益以外的资产增加配置，权益市场存在持续涌入的资金。

2017 市场风格和价值判断体系将有较大变化，我们认为主要有几个方面：

1、证监会提速 IPO，收紧收购兼并和再融资的审批。在相对疲弱的市场大规模 IPO 发行，市场水位不断下降，很大程度上压缩了资本运作对上市公司的股价弹性。当上市公司充足供应时，主业扎实行业前景广阔的龙头公司成为聚焦市场注意力的稀缺资源，运作讲故事的公司被不断边缘化。原来 A 股市场给以小烂差公司估值溢价，行业龙头公司反而给予估值折价，这种扭曲的价值评估体系将在 2017 年进一步修正。

2、投资者结构也在不断发生变化，注重价值，以绝对收益为投资目标逐渐成为主流。随着保险机构、银行委外资金、养老金等低风险偏好，绝对收益目标的资金不断入市，散户和游资主导的市场风格更加机构化，且机构由相对收益者向绝对收益者转换。过去，委外机构投资思路受公募基金的投资思路影响较大，随着资本市场进程的不断深化，绝对收益投资者话语权不断增强，在不断改变市场玩法。以保险为例，120 家规模保险机构有 12 万亿资产管理规模，远超公募基金权益资产规模，大资金体量的保险机构对投资的理解和标的选择注定与小资金不同，绝对收益者将夺得市场话语权。

3、就行业竞争格局而言，在过去几年经济断崖式下行过程中，没有竞争和成本优势的小企业不断被洗牌推出。中游制造业竞争格局不断改善，行业集中度不断提升。在未来经济企稳回升的过程中，洗牌后的龙头公司将迎来巨大的业绩弹性。

综上所述，2017 年资本市场将更加注重内生增长，虽然市场整体估值水平缓慢下行，但龙头公司将依靠稳定的业绩增长和估值修复获得绝对收益。

从市场风格判断，我们认为 2017 年市场的风格也将更加均衡。

1、传统周期性行业。目前或已处于 L 型探底的底部区域，随着市场自然出清和供给侧改革，周期性的传统行业，尤其是龙头公司业绩环比改善态势明显。部分竞争格局良好的中游行业，龙头企业在经济恢复过程中的弹性将是巨大的。

2、新兴成长性行业。毋庸置疑成长性行业才是未来中国经济发展的未来，也是市场长久的主线。以 TMT 为代表的成长性行业经历过 2015-2016 两年的惨烈调整后，2017 年再大幅跑输市场的可能性较小。虽然目前成长股并没有估值优势，但成长股毋庸置疑更容易获得市场的发自内心的认同，本基金将适时加大对成长股的配置。

3、传统意义上的价值股。典型如白酒和家用电器等，在过去两年已经有显著的超额收益，2017 年再大幅跑赢市场的可能性不大。但是对于风险偏好较低的价值投资者而言，仍然有获取绝对收益的配置价值。

综上所述，我们认为 2017 年市场将呈现整体稳定，但个股分化的态势。本基金将加大对于周期股和成长股的配置，在具体标的的选择方面，将遵循自下而上的原则精选标的重仓持有。选择的原则是有产业价值，细分行业竞争优势的产业龙头，周期股中偏重竞争格局良好的中上游弹性标的，成长股选股原则是选最好的细分行业中的最优质的企业。

#### 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本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式，基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；当基金实现可分配收益达到 0.04 元或者当基金净值达到 1.10 元或以上时，且满足法定分红条件时，即实施收益分配，具体分红金额待定，分红方案将在满足上述条件的 10 个交易日内实施；基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少分配 1 次，基金收益分配每年至多 12 次，年度分红 12 次后，如果再次达到分红条件，收益分配滚存到下一年度实施；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 60%；基金合同生效不满三个月，收益可不分配；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，报告期内本基金共进行了 12 次收益分配：

- 1、本基金管理人已于 2016 年 1 月 13 日发布公告，以 2016 年 1 月 4 日可供分配利润为基准，

每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

2、本基金管理人已于 2016 年 1 月 23 日发布公告，以 2016 年 1 月 15 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

3、本基金管理人已于 2016 年 2 月 15 日发布公告，以 2016 年 1 月 28 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

4、本基金管理人已于 2016 年 2 月 27 日发布公告，以 2016 年 2 月 17 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

5、本基金管理人已于 2016 年 3 月 11 日发布公告，以 2016 年 3 月 1 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

6、本基金管理人已于 2016 年 3 月 23 日发布公告，以 2016 年 3 月 14 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

7、本基金管理人已于 2016 年 4 月 7 日发布公告，以 2016 年 3 月 25 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

8、本基金管理人已于 2016 年 4 月 19 日发布公告，以 2016 年 4 月 8 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

9、本基金管理人已于 2016 年 5 月 3 日发布公告，以 2016 年 4 月 21 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

10、本基金管理人已于 2016 年 5 月 16 日发布公告，以 2016 年 5 月 5 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

11、本基金管理人已于 2016 年 5 月 27 日发布公告，以 2016 年 5 月 18 日可供分配利润为基



准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

12、本基金管理人已于 2016 年 6 月 13 日发布公告，以 2016 年 5 月 31 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元，符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

本报告期末宝盈核心优势混合 A 可供分配基金份额利润 0.0647 元，基金份额净值 1.0647 元，符合利润分配条件，但 2016 年度该基金分红次数已达到 12 次，根据合同约定该基金年度分红 12 次后，如果再次达到分红条件，收益分配滚存到下一年度实施。本报告期末宝盈核心优势混合 C 可供分配基金份额利润 0.0399 元，基金份额净值 1.0399 元，不符合利润分配条件。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### **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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### **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**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本基金 2016 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(2017)第 20373 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：宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	163,586,566.57	286,307,091.42
结算备付金	1,761,822.26	5,244,046.14
存出保证金	426,517.36	2,559,966.99
交易性金融资产	1,581,015,589.61	2,182,381,771.03
其中：股票投资	1,289,149,718.75	1,806,253,770.03
基金投资	-	-
债券投资	291,865,870.86	376,128,001.00
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	-	-
应收证券清算款	-	17,681,730.23
应收利息	8,921,575.72	12,099,023.32
应收股利	-	-
应收申购款	268,982.47	8,799,773.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-

资产总计	1,755,981,053.99	2,515,073,402.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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	-	29,856,964.90
应付赎回款	1,645,486.63	12,488,441.10
应付管理人报酬	2,261,853.83	2,720,712.20
应付托管费	376,975.63	453,452.01
应付销售服务费	33,941.01	75,931.89
应付交易费用	1,291,242.71	3,191,760.47
应交税费	70,261.60	70,261.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	259,118.86	254,606.93
负债合计	5,938,880.27	49,112,131.10
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,644,279,865.39	1,637,503,815.55
未分配利润	105,762,308.33	828,457,455.81
所有者权益合计	1,750,042,173.72	2,465,961,271.36
负债和所有者权益总计	1,755,981,053.99	2,515,073,402.46

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,644,279,865.39 份，其中宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值为 1.0647 元，基金份额为 1,618,892,713.15 份；宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值为 1.0399 元，基金份额为 25,387,152.24 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-461,734,815.40	1,971,695,849.74
1.利息收入	16,494,632.53	23,547,271.87
其中：存款利息收入	1,781,715.82	2,441,122.84
债券利息收入	14,640,497.18	21,035,325.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	72,419.53	70,823.14
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	12,746,980.85	2,365,440,249.77
其中：股票投资收益	5,313,494.62	2,310,891,198.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	202,806.62	40,122,404.74
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	7,230,679.61	14,426,646.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-492,010,775.48	-435,174,020.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,034,346.70	17,882,348.73
<b>减：二、费用</b>	47,027,066.25	120,971,563.02
1. 管理人报酬	28,922,831.60	65,330,388.78
2. 托管费	4,820,471.85	10,888,398.18

3. 销售服务费	573,864.90	1,946,653.79
4. 交易费用	12,241,231.82	41,134,432.94
5. 利息支出	-	1,178,287.41
其中：卖出回购金融资产支出	-	1,178,287.41
6. 其他费用	468,666.08	493,401.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-508,761,881.65</b>	<b>1,850,724,286.72</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-508,761,881.65</b>	<b>1,850,724,286.72</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	1,637,503,815.55	828,457,455.81	2,465,961,271.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-508,761,881.65	-508,761,881.65
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）	6,776,049.84	-12,656,295.21	-5,880,245.37
其中：1. 基金申购款	654,455,844.33	106,514,396.33	760,970,240.66
2. 基金赎回款	-647,679,794.49	-119,170,691.54	-766,850,486.03
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）	-	-201,276,970.62	-201,276,970.62

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	五、期末所有者权益（基金净值）	1,644,279,865.39	105,762,308.33
一、期初所有者权益（基金净值）	4,949,278,284.37	2,490,712,646.44	7,439,990,930.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,850,724,286.72	1,850,724,286.72
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）	-3,311,774,468.82	-2,042,909,509.73	-5,354,683,978.55
其中：1. 基金申购款	5,778,620,771.83	3,640,568,102.13	9,419,188,873.96
2. 基金赎回款	-9,090,395,240.65	-5,683,477,611.86	-14,773,872,852.51
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）	-	-1,470,069,967.62	-1,470,069,967.62
五、期末所有者权益（基金净值）	1,637,503,815.55	828,457,455.81	2,465,961,271.36

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：

\_\_\_\_\_ 李文众                      \_\_\_\_\_ 胡坤                      \_\_\_\_\_ 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 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

### 7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

### 7.4.2.3 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。

## 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、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
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：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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,922,831.60	65,330,388.78
其中：支付销售机构的客户维护费	5,480,239.38	11,580,358.83

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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,820,471.85	10,888,398.18

注：支付基金托管人中国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×0.25%/当年天数。

### 7.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	合计
宝盈基金管理有限公司	-	414,181.93	414,181.93
合计	-	414,181.93	414,181.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	合计
宝盈基金管理有限公司	-	1,423,602.42	1,423,602.42
合计	-	1,423,602.42	1,423,602.42

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 1.5% / 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2016年1月1日至2016年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	

中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	887,600,000.00	376,946.85

#### 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 A
期初持有的基金份额	4,300,645.16	-
期间申购/买入总份额	-	4,300,645.16
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	4,300,645.16	4,300,645.16
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.26%	0.28%

##### 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

本基金本报告期末及上年度期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国银行	163,586,566.57	1,698,019.79	286,307,091.42	2,175,634.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.6 期末（2016 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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
002664	信质电机	2016 年 12 月 16 日	重大事项	25.39	-	-	1,534,200	47,418,875.00	38,953,338.00	-
300537	广信材料	2016 年 10 月 12 日	重大事项	48.79	2017 年 1 月 13 日	43.91	101,024	5,378,394.24	4,928,960.96	-
603986	兆易创新	2016 年 9 月 19 日	重大事项	177.97	2017 年 3 月 13 日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-

注：本基金截至 2016 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

###### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

## §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	1,289,149,718.75	73.41

	其中：股票	1,289,149,718.75	73.41
2	固定收益投资	291,865,870.86	16.62
	其中：债券	291,865,870.86	16.62
	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	165,348,388.83	9.42
7	其他各项资产	9,617,075.55	0.55
8	合计	1,755,981,053.99	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	871,764,685.64	49.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,071,196.81	1.55
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	100,204,122.00	5.73
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	31,240,566.00	1.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	185,809,738.95	10.62
L	租赁和商务服务业	23,779,409.35	1.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	49,280,000.00	2.82

0	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	1,289,149,718.75	73.66

### 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	001979	招商蛇口	8,099,884	132,757,098.76	7.59
2	600682	南京新百	2,688,600	100,204,122.00	5.73
3	000070	特发信息	3,300,000	83,457,000.00	4.77
4	600085	同仁堂	2,171,235	68,133,354.30	3.89
5	000860	顺鑫农业	3,000,000	66,000,000.00	3.77
6	002675	东诚药业	3,861,089	55,213,572.70	3.15
7	600266	北京城建	3,979,943	53,052,640.19	3.03
8	300187	永清环保	4,000,000	49,280,000.00	2.82
9	002215	诺普信	4,141,352	45,886,180.16	2.62
10	002546	新联电子	5,000,000	45,350,000.00	2.59

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	600570	恒生电子	147,129,982.46	5.97
2	600115	东方航空	134,074,542.79	5.44

3	000860	顺鑫农业	126,404,241.92	5.13
4	002445	中南文化	85,300,959.45	3.46
5	600682	南京新百	83,335,639.55	3.38
6	000060	中金岭南	82,021,923.55	3.33
7	000070	特发信息	79,455,907.76	3.22
8	002519	银河电子	75,748,583.34	3.07
9	600315	上海家化	74,472,951.65	3.02
10	600458	时代新材	72,247,062.82	2.93
11	600085	同仁堂	68,444,578.41	2.78
12	601688	华泰证券	67,374,055.26	2.73
13	600266	北京城建	66,277,693.81	2.69
14	002675	东诚药业	65,913,410.58	2.67
15	001979	招商蛇口	65,217,021.67	2.64
16	002546	新联电子	64,615,913.23	2.62
17	600801	华新水泥	62,146,869.59	2.52
18	000728	国元证券	59,567,608.15	2.42
19	000768	中航飞机	59,555,437.59	2.42
20	600048	保利地产	58,338,426.27	2.37
21	300068	南都电源	58,075,258.56	2.36
22	002215	诺普信	49,476,417.24	2.01

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。

#### 8.4.2 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

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	002368	太极股份	358,899,634.37	14.55
2	600570	恒生电子	127,581,255.52	5.17

3	600115	东方航空	125,035,653.10	5.07
4	002445	中南文化	116,265,084.56	4.71
5	600715	文投控股	108,225,768.34	4.39
6	300187	永清环保	99,665,346.59	4.04
7	601099	太平洋	96,513,951.94	3.91
8	600458	时代新材	79,263,311.67	3.21
9	300033	同花顺	75,470,753.77	3.06
10	000060	中金岭南	73,736,041.49	2.99
11	002345	潮宏基	70,569,217.72	2.86
12	000768	中航飞机	69,299,668.11	2.81
13	000728	国元证券	64,088,186.85	2.60
14	601688	华泰证券	62,519,519.07	2.54
15	002519	银河电子	61,074,097.86	2.48
16	600048	保利地产	61,013,626.46	2.47
17	000860	顺鑫农业	58,511,060.44	2.37
18	603398	邦宝益智	52,478,194.62	2.13
19	600801	华新水泥	52,441,812.50	2.13
20	002113	天润数娱	49,743,563.00	2.02

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	4,051,209,263.09
卖出股票收入（成交）总额	4,095,435,580.94

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

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	111,425,017.50	6.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	123,710,739.90	7.07
	其中：政策性金融债	123,710,739.90	7.07
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）	56,730,113.46	3.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	291,865,870.86	16.68

### 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

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	018002	国开 1302	1,182,590	123,710,739.90	7.07
2	010107	21 国债(7)	1,058,670	111,425,017.50	6.37
3	127003	海印转债	500,001	56,730,113.46	3.24

### 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。

### 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	426,517.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,921,575.72
5	应收申购款	268,982.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	9,617,075.55
---	----	--------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127003	海印转债	56,730,113.46	3.24

#### 8.12.5 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。

#### 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

份额级别	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
宝盈核心优势混合 A	106,352	15,222.02	268,063,034.34	16.56%	1,350,829,678.81	83.44%
宝盈核心优势混合 C	1,995	12,725.39	-	-	25,387,152.24	100.00%
合计	108,347	15,176.05	268,063,034.34	16.30%	1,376,216,831.05	83.70%

注：① 本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

② 户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	宝盈核心优势混合 A	305,691.17	0.0189%
	宝盈核心优势混合 C	168,683.03	0.6644%

	合计	474,374.20	0.0288%
--	----	------------	---------

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	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	宝盈核心优势混合 A	10~50
	宝盈核心优势混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈核心优势混合 A	0~10
	宝盈核心优势混合 C	0
	合计	0~10

## § 10 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
基金合同生效日（2009年3月17日）基金份额总额	776,687,900.16	-
本报告期期初基金份额总额	1,546,627,015.23	90,876,800.32
本报告期基金总申购份额	636,684,759.93	17,771,084.40
减：本报告期基金总赎回份额	564,419,062.01	83,260,732.48
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	1,618,892,713.15	25,387,152.24

## § 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) 2016 年 4 月 27 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十一临时会议，同意储诚忠辞去副总经理职务。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。

(2) 2016 年 8 月 4 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十二次临时会议，同意杨凯辞去副总经理职务。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) 2016 年 12 月 3 日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，葛俊杰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。

(4) 2016 年 9 月 27 日，宝盈基金管理有限公司董事马宏变更为张栋，本基金管理人已按规定报中国证监会备案。

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：

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 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

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 110,000 元，目前事务所已连续 8 年为本基金提供审计服务。

## 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

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会《关于对宝盈基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停办理公募基金产品注册申请 3 个月，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，针对性的制定、实施整改措施，并向中国证监会及深圳证监局提交整改报告，深圳证监局已完成现

场整改验收。

2、2016 年 9 月中国证券业协会发布公告，本基金由于提供有效报价但未参与申购，被列入首次公开发行股票配售对象黑名单，黑名单起止日期为 2016 年 9 月 8 日至 2017 年 3 月 7 日。事件发生后，公司及时就相关问题进行了自查并制定了整改措施，以确保不再发生类似事件。

除上述情况外，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	
国泰君安证券	1	1,331,438,145.38	16.35%	1,213,339.90	16.35%	-
中信建投	1	857,681,172.25	10.53%	781,599.59	10.53%	-
东兴证券	1	793,788,680.98	9.75%	723,380.13	9.75%	-
海通证券	3	774,350,564.85	9.51%	705,667.37	9.51%	-
招商证券	1	759,189,228.38	9.32%	691,844.94	9.32%	-
华创证券	1	669,038,112.77	8.22%	609,687.57	8.22%	-
长江证券	1	599,725,743.28	7.36%	546,529.53	7.36%	-
安信证券	2	598,181,880.95	7.35%	545,124.72	7.35%	-
天风证券	2	475,417,170.99	5.84%	433,250.69	5.84%	-
平安证券	1	428,657,519.38	5.26%	390,636.75	5.26%	-
兴业证券	1	329,893,640.24	4.05%	300,632.26	4.05%	-
长城证券	1	272,256,893.61	3.34%	248,106.40	3.34%	-
广州证券	2	83,529,946.24	1.03%	76,121.37	1.03%	-
浙商证券	2	58,227,526.00	0.72%	53,060.49	0.72%	-
中投证券	1	51,558,113.63	0.63%	46,984.94	0.63%	-
华泰证券	1	44,337,850.15	0.54%	40,405.02	0.54%	-
申万宏源证券	1	15,917,565.00	0.20%	14,505.63	0.20%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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单  
元租用协议。

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。

2、本基金本报告期新租广州证券、天风证券、海通证券、浙商证券上海交易单元各一个，新增  
广州证券、天风证券、海通证券、浙商证券、华泰证券深圳交易单元各一个。

3、本基金本报告期退租恒泰证券上海交易单元一个。

### 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
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	48,662,164.00	22.49%	60,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券	44,018,851.90	20.34%	-	-	-	-
长江证券	11,282,137.79	5.21%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	54,333,708.30	25.11%	-	-	-	-
平安证券	24,187,121.00	11.18%	-	-	-	-
兴业证券	24,175,000.00	11.17%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	9,718,306.60	4.49%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司

2017年3月27日