

宝盈资源优选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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 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 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	宝盈资源优选混合
基金主代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 15 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	2,480,447,915.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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，处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值，相关上市公司体现出较好的投
------	--

	<p>资价值。 本基金根据研究部的估值模型，优选各个行业中具有资源优势的上市公司，建立股票池。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>本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合，并注重资产在各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。</p> <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>本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。</p> <p>在个股选择层面，本基金以净资产收益率、预期 PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。</p> <p>3、债券及短期金融工具投资策略</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> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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	tianqing1.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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-302,325,864.73	606,377,690.15	357,075,281.08
本期利润	-1,627,084,857.98	1,347,007,726.09	728,777,180.26
加权平均基金份额本期利润	-0.5576	0.3753	0.6404
本期基金份额净值增长率	-20.98%	51.97%	50.31%
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	-0.0837	0.0021	0.2010
期末基金资产净值	4,289,178,966.88	7,803,272,504.48	3,915,530,868.84
期末基金份额净值	1.7292	2.1883	1.6482

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

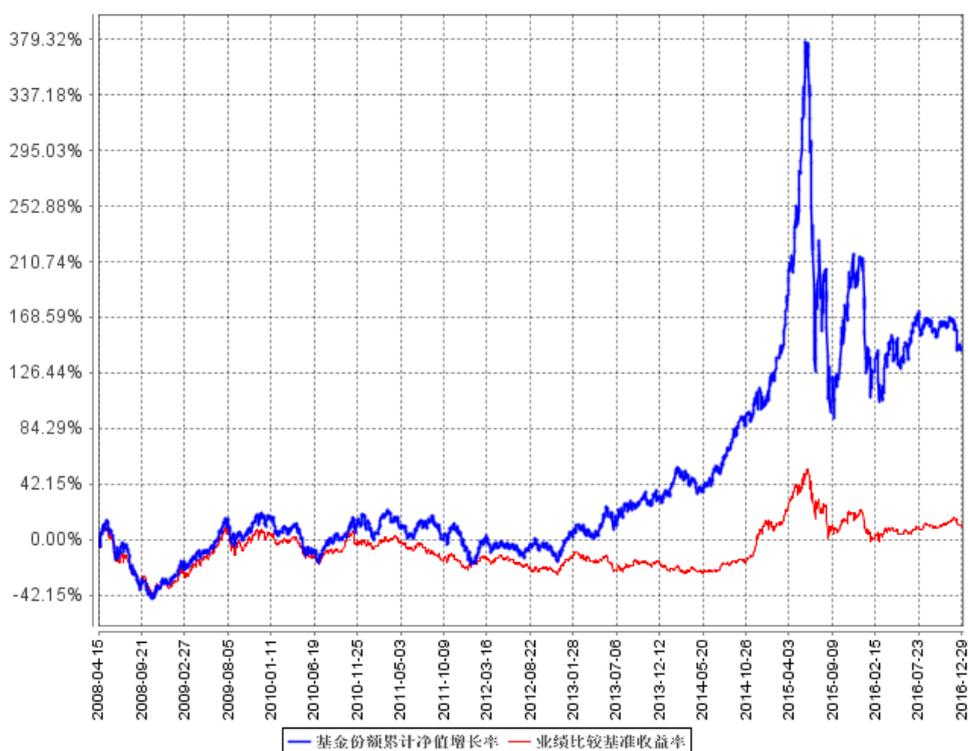
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	----------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去三个月	-4.57%	0.88%	1.34%	0.54%	-5.91%	0.34%
过去六个月	-5.39%	0.91%	4.10%	0.57%	-9.49%	0.34%
过去一年	-20.98%	2.00%	-7.40%	1.05%	-13.58%	0.95%
过去三年	80.51%	2.33%	37.65%	1.34%	42.86%	0.99%
过去五年	160.65%	2.04%	40.16%	1.22%	120.49%	0.82%
自基金合同 生效起至今	144.94%	1.92%	10.87%	1.35%	134.07%	0.57%

3.2.2 自基金转型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

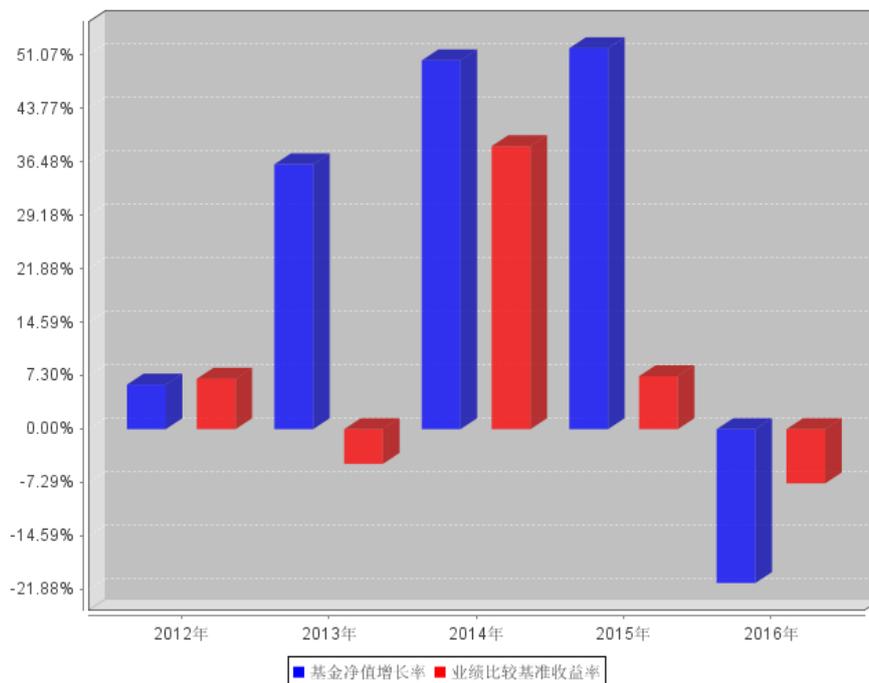


注：1、 本基金在 2008 年 4 月 15 日由原封闭式基金转换成立。

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。

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

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：宝盈资源优选基金由基金鸿飞在 2008 年 4 月 15 日封转开转型而来；

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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	-	-	-	-	
2015	3.6000	1,213,692,573.25	339,609,738.62	1,553,302,311.87	
2014	2.0200	110,803,975.81	95,655,182.53	206,459,158.34	
合计	5.6200	1,324,496,549.06	435,264,921.15	1,759,761,470.21	

§ 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		
彭敢	本基金、宝盈新价值灵活配置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；权益投资部总监	2010年11月5日	-	15年	彭敢先生，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权益投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈策略增长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	2015年1月30日	2016年3月26日	5年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。历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，

	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助理			2014 年 11 月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	---------------------------------	--	--	--

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。

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 年股票市场整体前低后高态势，经历了开年熔断以后，情绪性恐慌基本释放完毕，从全年来看，主板走势要好于中小创指数走势，上证指数涨跌幅为-12.31%、沪深 300 涨跌幅为-11.28%、深成指涨跌幅为-19.64%，同期，创业板指数涨跌幅为-27.71%、中小板指数涨跌幅为-22.89%。基本从全年来看熊市特征明显，本基金全年业绩一般，未能为基金持有人取得较好收益。

本基金管理人认为，在实现中国梦的道路上，改革开放是必然选择。中国经济自改革开放以来已经实现了连续三十多年的高速增长态势，基本依赖于丰厚的人口红利以及低环保成本优势参与全球竞争，尤其是在加入 WTO 后，充分受益于全球化红利，GDP 总量已经位居全球第二，同时也带来了一定的负面影响，比如过剩产能、环保问题、半导体军工等核心产业全球竞争力依然不足等等。随着近期，英国脱欧、美国特朗普的全球收缩政策，“逆全球化”趋势日趋明显。我们急迫于需要新的经济增长点来带动产业结构调整、需要新的市场来消化过剩产能、需要新的金融体系来降低融资成本等；因此国家的“一路一带”战略和“供给侧”改革呼之欲出，同时我们期待已久的金融体系改革也即将拉开序幕。

本届政府多次强调经济转型是当前我国必然之路，从政策效果来说虽然短期没有能体现经济结构明显改观，同时反腐加速，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。同时，本基金管理人过去梳理了一线城市和准一线城市的经济结构和人才结构，整体来说这梯度的城市代表着中国未来的经济转型希望，也是上市公司最集中的区域，已经不少公司逐渐借助资本的力量逐渐成为全国 500 强企业或者行业龙头，研发投入也是逐年加大，也有一种新的现象就是不少国内上市公司加大走出去力度，未来将会有更多的公司出海，这也是经济转型的一大契机。

回顾市场，全年来说市场熊市氛围笼罩，虽然出现了些个股机会，总体来说，市场参与者情绪依然不高。本基金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，整体来看取得了一定的投资效果，但是需要时间来消化市场整体的负面情绪，耐心等待收获时期。本基金主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、体育、新能源汽车、泛娱乐等方向。

4.4.2 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-20.98%，同期业绩比较基准收益率是-7.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为，2017 年中国的宏观经济仍然处于持续触底的过程，尽管政府出台了多项改革和稳增长的财政和货币政策，但经济增长的固有规律在发挥作用，过剩产能以及前期大量的房地产和固定资产投资仍然成为经济的主要风险。目前来看国家在稳定经济增长方面信心十足，随着“供给侧改革”和“一路一带”战略深入人心，使得传统产业有了一定的释放空间和喘气机会，让我们更坚定的看好本届政府对经济转型的决心。

从宏观政策分析来看，2016 年新证监会主席熔断后临危受命，按照稳自当头，疏通 IPO 堰塞湖，净化市场环境等相关措施出台，使得市场逐渐企稳。同时我们也需要看到，过去一年新股上市近 300 家，引入了更多的活水进入市场，虽然某种程度消纳了市场的资金，但长远来看，更有利于专业投资者挑选更加优秀的上市公司。

从市场来看，目前股票市场经历了熔断以后，市场基本企稳。在利率下行趋势下，资产价格决定于未来现金流，现金流充裕的情况和 A 股不发生系统性风险前提下，以成长股为代表的创业板、盈利模式逐渐清晰的新型蓝筹以及智能制造转型升级等都存在着新时代资本市场盛宴的机会。

从制度红利来看，中国对资本市场和国企治理的决心已毋庸置疑，沪港通、深港通、证券法修改及注册制等都是资本市场已发生或即将发生的重大影响意义的事件；同时国企治理对改革转型起到关键性作用，国有资产证券化是较好的实现途径。从长期看，中国通过改革转型提升经济增长的空间仍然很大，新的国家战略如一带一路的提出等让市场预期政府会通过向全球输出中国的高铁等优势产业来缓解产能过剩问题。同样的，“互联网+”为主要手段的各行业互联网化趋势逐渐确立，互联网金融、互联网医疗、互联网能源以及互联网农业等在转型升级的中国带来了许多投资机遇和新的产业形态。

我们认为中国资本市场不管是过去、现在还是未来的走势均是对中国经济前景和改革信心的反应。从目前宏观经济数据和改革管理措施来看，看不到改善的迹象，各种改革措施总体来说也是雷声大雨点小，资本市场的大环境难言乐观。但从另一方面来看，中国经济的韧性和中国企业家的创新精神和奋斗意识在全球横向比较中仍然有一定的优势，中国经济的前景也无需过于担心。

因此，现阶段的市场调整可以更多的理解为市场下跌趋势的惯性延续。投资者信心的恢复需要时间，而市场重新走出趋势性的上涨行情需要更多的宏观经济数据的变化和政府改革措施的落实实施，并给投资者带来信心。

目前来看，市场的悲观因素反应较为充分，而市场积极的因素在累积，如接下来的“一带一路峰会”、十九大的召开、国家以供给侧改革为核心的国有企业改革措施的落实等等。所以在目前阶段，虽然市场信心较弱，但在经历多次下跌后，市场目前所处的位置具有较好的风险收益比。即使从市场波动来看，考虑到目前市场与历史估值比较相对偏低的位置，个人判断今年仍然存在一轮趋势性上涨的机会。投资的热点可能集中在周期性股票的博弈机会、国企改革带来的国企控股优质公司的变革，成长股方面，体育传媒等新兴消费服务业、以云计算大数据为核心的科技产业、以 VR 等技术变革为中心的新技术产业可能会有持续的盈利机会。

从价值投资的角度来看，目前自下而上选股可投资的股票越来越多，有相当一部分股票进入合理乃至极有价值的投资区间。虽然我们认为市场未来仍有调整空间，但市场分化也将产生，我们相信，部分优质公司的选择仍能提供较好的获利机会。

从 2017 年全年来看，经济回暖趋势可能会加速，资本市场大波动基本难以发生，市场底可能先于经济底率先反应，市场结构性机会必然多于过去一年。当然我们也需要看到目前市场的一些主要风险因素，正如我们前面已经提到的：1、投资者的对经济企稳和政治体系稳定的信心；2、货币政策与汇率稳定的关系；3、资本市场改革进度和措施低于预期及市场适应新制度的能力；4、“互联网+”创新显著低于预期；5、楼市及部分固定资产快速泡沫化后的消化能力。

基金管理人秉承几个最基本的投资理念：1、投资不可能赚到所有的钱，投资要赚自己所理解和能把握的钱。投资收益有两类钱，一类是市场博弈赚图形的钱，我的收益即是他人的亏损。在这个充分竞争的市场机会本基金管理人不可能持久赚到博弈的钱；2、第二类投资收益是赚公司成长的钱。优质的成长股不管在何种市场风口，最后必然超越市场涨幅，在无法判别市场风向的市场，挑选最强健的猪。尤其是成长空间巨大的公司，要有充分的耐心，这是本基金管理人的目标收益；3、中国的经济已经进入必须转型的阶段，中国经济的核心不可能是靠地产和传统国企来支撑。变革和转型创新是中国经济更重要的部分。而目前传统产业在中国股票市场中的市值比率并不低，这类企业无论是从静态还是动态估值跟国际对比偏贵、从管理水平和制度结构来说跟跨国公司对比也差距巨大。

本基金将继续重点以个股投资价值判断为主，继续采取自下而上的投资策略。基金管理人将坚持价值投资的理念，结合资源优选基金重点投资技术资源、渠道资源、品牌资源的特点，为投资者追求较高的收益。

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及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。

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 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 20379 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：宝盈资源优选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
资 产：		

银行存款	238,144,299.80	283,262,802.66
结算备付金	4,236,430.70	12,737,939.46
存出保证金	863,448.39	3,792,085.71
交易性金融资产	4,056,957,020.90	7,554,401,191.65
其中：股票投资	4,056,957,020.90	7,205,095,264.55
基金投资	-	-
债券投资	-	349,305,927.10
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	-	39,999,983.76
应收利息	54,629.98	20,215,633.90
应收股利	-	-
应收申购款	1,469,305.95	7,361,462.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,301,725,135.72	7,921,771,099.21
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015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	-	55,178,722.13
应付赎回款	4,047,028.90	44,446,483.04
应付管理人报酬	5,683,748.45	10,017,549.37
应付托管费	947,291.41	1,669,591.58

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,592,729.72	6,788,512.64
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	275,370.36	397,735.97
负债合计	12,546,168.84	118,498,594.73
所有者权益：		
实收基金	2,280,384,839.36	3,278,265,708.49
未分配利润	2,008,794,127.52	4,525,006,795.99
所有者权益合计	4,289,178,966.88	7,803,272,504.48
负债和所有者权益总计	4,301,725,135.72	7,921,771,099.21

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7292 元，基金份额总额

2,480,447,915.79 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈资源优选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	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
一、收入	-1,518,755,942.38	1,538,823,952.37
1. 利息收入	5,546,365.63	20,102,632.36
其中：存款利息收入	5,114,735.68	3,847,507.31
债券利息收入	111,001.19	16,255,125.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	320,628.76	-
其他利息收入	-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）	-202,760,481.89	753,712,558.89
其中：股票投资收益	-210,337,066.89	723,269,780.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-10,062,775.50	-576,422.40
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	17,639,360.50	31,019,200.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,324,758,993.25	740,630,035.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,217,167.13	24,378,725.18
减：二、费用	108,328,915.60	191,816,226.28
1. 管理人报酬	77,024,550.73	119,918,957.74
2. 托管费	12,837,425.07	19,986,492.97
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,964,946.71	50,691,052.45
5. 利息支出	-	766,926.86
其中：卖出回购金融资产支出	-	766,926.86
6. 其他费用	501,993.09	452,796.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,627,084,857.98	1,347,007,726.09
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,627,084,857.98	1,347,007,726.09

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈资源优选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）	3,278,265,708.49	4,525,006,795.99	7,803,272,504.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,627,084,857.98	-1,627,084,857.98
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）	-997,880,869.13	-889,127,810.49	-1,887,008,679.62
其中：1. 基金申购款	921,792,491.85	810,592,226.73	1,732,384,718.58
2. 基金赎回款	-1,919,673,360.98	-1,699,720,037.22	-3,619,393,398.20
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）	2,280,384,839.36	2,008,794,127.52	4,289,178,966.88
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
一、期初所有者权益（基金净值）	2,184,068,811.87	1,731,462,056.97	3,915,530,868.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,347,007,726.09	1,347,007,726.09
三、本期基金份额交易产	1,094,196,896.62	2,999,839,324.80	4,094,036,221.42

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	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“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

本基金本报告期间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
	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
当期发生的基金应支付的管理费	77,024,550.73	119,918,957.74
其中：支付销售机构的客户维护费	18,272,930.97	17,534,929.46

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 × 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
	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
当期发生的基金应支付的托管费	12,837,425.07	19,986,492.97

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

7.4.5.3 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自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	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月

	12 月 31 日	31 日
期初持有的基金份额	5,499,697.49	5,499,697.49
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	5,499,697.49	5,499,697.49
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2200%	0.1500%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中国对外经济贸易信托有限公司	413,523.18	0.0200%	413,523.18	0.0100%

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

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 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	
	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	238,144,299.80	5,006,684.65	283,262,802.66	3,457,575.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期间及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

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（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

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
300364	中文在线	2016 年 8 月 12 日	2017 年 8 月 15 日	非公开发行流通受限	46.80	39.52	2,141,154	100,206,007.20	84,618,406.08	-
300005	探路者	2016 年 6 月 2 日	2017 年 6 月 6 日	非公开发行流通受限	15.88	16.36	3,189,762	50,653,420.56	52,184,506.32	-
000050	深天马 A	2016 年 1 月 14 日	2017 年 1 月 17 日	非公开发行流通受限	17.82	18.78	2,244,668	39,999,983.76	42,154,865.04	-
300301	长方集团	2016 年 5 月 17 日	2017 年 5 月 20 日	非公开发行流通受限	7.60	8.24	3,125,000	23,750,000.00	25,750,000.00	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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
300047	天源迪科	2016 年 8 月 15 日	重大资产重组	18.36	2017 年 1 月 6 日	19.00	5,098,223	143,067,975.38	93,603,374.28	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大资产重组	20.04	-	-	3,706,883	94,879,682.31	74,285,935.32	-
002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	重大资产重组	36.49	-	-	1,554,243	50,879,546.39	56,714,327.07	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	15.80	-	-	3,241,634	41,529,461.94	51,217,817.20	-
603308	应流股份	2016 年 11 月 24 日	重大资产重组	21.92	2017 年 2 月 14 日	21.92	1,869,268	44,695,794.47	40,974,354.56	-
600711	盛屯矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项停牌	7.02	2017 年 1 月 11 日	7.38	4,284,965	34,981,865.65	30,080,454.30	-
300450	先导智能	2016 年 11 月 15 日	重大资产重组	31.21	2017 年 2 月 8 日	33.00	643,661	21,747,300.31	20,088,659.81	-
300005	探路者	2016 年 11 月 29 日	重大资产重组	16.69	2017 年 2 月 6 日	15.02	1,115,350	22,400,472.74	18,615,191.50	-

000042	中洲控股	2016 年 10 月 27 日	重大事项停牌	20.24	-	-	847,942	14,172,309.57	17,162,346.08	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大资产重组	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	752,800	13,780,976.04	11,563,008.00	-
300213	佳讯飞鸿	2016 年 11 月 4 日	重大资产重组	28.00	2017 年 2 月 17 日	25.48	300,000	8,331,801.30	8,400,000.00	-

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

截至本报告期末 2016 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余额。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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	4,056,957,020.90	94.31
	其中：股票	4,056,957,020.90	94.31
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	242,380,730.50	5.63
7	其他各项资产	2,387,384.32	0.06
8	合计	4,301,725,135.72	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	25,100,000.00	0.59
B	采矿业	108,277,582.38	2.52
C	制造业	2,970,142,226.51	69.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,852,555.60	1.21
E	建筑业	17,016,180.00	0.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	34,174,735.02	0.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	521,560,883.05	12.16
J	金融业	14,923,288.60	0.35
K	房地产业	17,162,346.08	0.40
L	租赁和商务服务业	26,945,555.40	0.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	136,022,180.00	3.17
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	133,779,488.26	3.12
S	综合	-	-
	合计	4,056,957,020.90	94.59

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	300252	金信诺	9,143,803	271,662,387.13	6.33

2	002522	浙江众成	15,009,502	270,020,940.98	6.30
3	002023	海特高新	17,621,152	243,876,743.68	5.69
4	002773	康弘药业	3,857,357	219,059,304.03	5.11
5	603456	九洲药业	8,629,310	186,134,216.70	4.34
6	002368	太极股份	4,914,241	150,424,917.01	3.51
7	002549	凯美特气	13,401,200	136,022,180.00	3.17
8	300170	汉得信息	10,424,229	123,110,144.49	2.87
9	002215	诺普信	10,231,536	113,365,418.88	2.64
10	603589	口子窖	3,109,656	99,913,247.28	2.33

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	600887	伊利股份	132,913,583.65	1.70
2	300364	中文在线	129,695,982.20	1.66
3	002675	东诚药业	116,771,864.06	1.50
4	603589	口子窖	111,558,254.47	1.43
5	300476	胜宏科技	111,421,250.09	1.43
6	600338	西藏珠峰	107,063,145.88	1.37
7	300005	探路者	91,157,303.24	1.17
8	600518	康美药业	91,145,039.20	1.17
9	300088	长信科技	81,121,072.71	1.04
10	300033	同花顺	78,967,802.23	1.01
11	600458	时代新材	78,239,488.46	1.00
12	600597	光明乳业	71,138,153.50	0.91
13	600198	大唐电信	70,494,801.16	0.90

14	002053	云南能投	69,150,360.39	0.89
15	600990	四创电子	62,054,532.36	0.80
16	300420	五洋科技	60,978,281.42	0.78
17	300463	迈克生物	60,388,243.03	0.77
18	300367	东方网力	58,143,349.19	0.75
19	002341	新纶科技	57,629,712.67	0.74
20	002131	利欧股份	55,088,382.36	0.71

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	002522	浙江众成	231,566,561.58	2.97
2	300463	迈克生物	152,411,461.55	1.95
3	002373	千方科技	139,508,052.00	1.79
4	300094	国联水产	131,850,242.32	1.69
5	300367	东方网力	122,149,506.68	1.57
6	600975	新五丰	121,112,223.29	1.55
7	002053	云南能投	119,778,981.65	1.53
8	300467	迅游科技	101,939,189.53	1.31
9	002341	新纶科技	95,359,681.68	1.22
10	002286	保龄宝	93,806,564.38	1.20
11	603703	盛洋科技	87,495,486.57	1.12
12	300318	博晖创新	83,189,743.07	1.07
13	600201	生物股份	81,322,892.48	1.04
14	000558	莱茵体育	80,125,640.08	1.03
15	300326	凯利泰	78,708,175.32	1.01

16	000971	高升控股	76,138,198.25	0.98
17	002157	正邦科技	74,503,518.62	0.95
18	600887	伊利股份	71,281,926.42	0.91
19	300252	金信诺	69,879,178.99	0.90
20	300071	华谊嘉信	69,458,201.27	0.89

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	4,979,180,573.36
卖出股票收入（成交）总额	6,582,194,908.47

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指买卖成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

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	863,448.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,629.98
5	应收申购款	1,469,305.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,387,384.32

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
178,792	13,873.37	46,969,936.57	1.89%	2,433,477,979.22	98.11%

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	69,345.02	0.0028%

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、基金投资和研究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（2008年4月15日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,565,885,731.68
本报告期基金总申购份额	1,002,666,741.04
减：本报告期基金总赎回份额	2,088,104,556.93
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	2,480,447,915.79

§ 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无重大人事变动。

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 130,000 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	
银河证券	2	1,742,046,602.82	15.36%	1,587,527.27	15.30%	-
国泰君安	2	1,735,248,043.95	15.30%	1,615,265.70	15.57%	-
长江证券	2	1,452,729,943.49	12.81%	1,323,874.06	12.76%	-
东方证券	2	1,377,543,951.82	12.14%	1,255,355.68	12.10%	-
西南证券	1	1,344,148,434.08	11.85%	1,224,923.26	11.80%	-
华泰证券	1	1,242,117,296.91	10.95%	1,131,937.04	10.91%	-
国金证券	2	644,743,006.31	5.68%	587,555.44	5.66%	-
中金公司	2	565,980,364.48	4.99%	515,778.18	4.97%	-
中投证券	2	398,062,976.47	3.51%	362,754.61	3.50%	-
中信证券	1	224,528,743.16	1.98%	204,612.92	1.97%	-
申万宏源	1	191,193,857.39	1.69%	178,057.85	1.72%	-
海通证券	1	113,939,478.16	1.00%	106,110.99	1.02%	-
东北证券	1	111,249,503.01	0.98%	101,382.23	0.98%	-
国信证券	1	97,785,995.22	0.86%	89,112.29	0.86%	-
广发证券	2	85,450,042.26	0.75%	77,870.51	0.75%	-

兴业证券	2	15,845,677.00	0.14%	14,440.20	0.14%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	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席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

① 租用交易单元情况

本基金本报告期内租用首创证券上海交易单元和深圳交易单元各 1 个，租用中投证券上海交易单元和深圳交易单元各 1 个，租用东北证券 1 个深圳交易单元。

② 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元情况。

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	500,000,000.00	62.50%	-	-
国金证券	-	-	300,000,000.00	37.50%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司

2017 年 3 月 27 日