

# 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

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 重要提示及目录

### 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。

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。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 12        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 13        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15        |
| 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             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18        |
| 4.9 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       | 20        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>20</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 20        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 20        |
| 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      | 21        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>21</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 21        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 21        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>22</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 22        |
| 7.2 利润表                                 | 24        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 25        |
| 7.4 报表附注                                | 27        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 51        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 52        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 52        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 54        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 56        |
| 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      | 56        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 57        |

|             |                                   |           |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 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 | 57        |
| 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    | 57        |
| 8.10        | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明              | 57        |
| 8.11        | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明              | 57        |
| 8.12        | 投资组合报告附注                          | 57        |
| <b>§ 9</b>  | <b>基金份额持有人信息</b>                  | <b>58</b> |
| 9.1         | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 58        |
| 9.2         | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 59        |
| 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     | 59        |
| <b>§ 10</b> | <b>开放式基金份额变动</b>                  | <b>59</b> |
| <b>§ 11</b> | <b>重大事件揭示</b>                     | <b>60</b> |
| 11.1        | 基金份额持有人大会决议                       | 60        |
| 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       | 60        |
| 11.3        | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼            | 61        |
| 11.4        | 基金投资策略的改变                         | 61        |
| 11.5        | 为基金进行审计的会计师事务所情况                  | 61        |
| 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          | 61        |
| 11.7        | 基金租用证券公司交易单元的有关情况                 | 61        |
| 11.8        | 其他重大事件                            | 64        |
| <b>§ 12</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b>             | <b>71</b> |
| <b>§ 13</b> | <b>备查文件目录</b>                     | <b>71</b> |
| 13.1        | 备查文件目录                            | 71        |
| 13.2        | 存放地点                              | 71        |
| 13.3        | 查阅方式                              | 72        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                 |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称            | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 |                 |
| 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         |
| 注册地址    |      | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号     |
| 办公地址    |      | 广东省深圳市福田区福华              | 北京市西城区复兴门内大街 1       |

|       |                   |        |
|-------|-------------------|--------|
|       | 一路 115 号投行大厦 10 层 | 号      |
| 邮政编码  | 518034            | 100818 |
| 法定代表人 | 李文众               | 田国立    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报、证券时报、上海证券报  |
| 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 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                              |
|--------|----------------------|-----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号<br>星展银行大厦 6 楼 |
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司           | 广东省深圳市福田区福华一路 115<br>号投行大厦 10 层   |

## § 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<br>混合 A  | 宝盈核心优势<br>混合 C | 宝盈核心优势<br>混合 A   | 宝盈核心优势<br>混合 C | 宝盈核心优势<br>混合 A   | 宝盈核心优势<br>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         |
| 本期加权平均净值利润率   | -26.12%         | -41.24%        | 42.51%           | 58.01%         | 65.09%           | 59.92%         |
| 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    | 2016 年末         |                | 2015 年末          |                | 2014 年末          |                |

| 和指标          |                  |               |                  |                |                  |                |
|--------------|------------------|---------------|------------------|----------------|------------------|----------------|
| 期末可供分配利润     | 104,749,914.68   | 1,012,393.65  | 595,551,385.51   | 33,147,930.18  | 947,686,408.51   | 30,072,975.19  |
| 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         |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016 年末          |               | 2015 年末          |                | 2014 年末          |                |
| 基金份额累计净值增长率  | 134.80%          | 88.47%        | 199.24%          | 142.54%        | 136.97%          | 93.22%         |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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% |



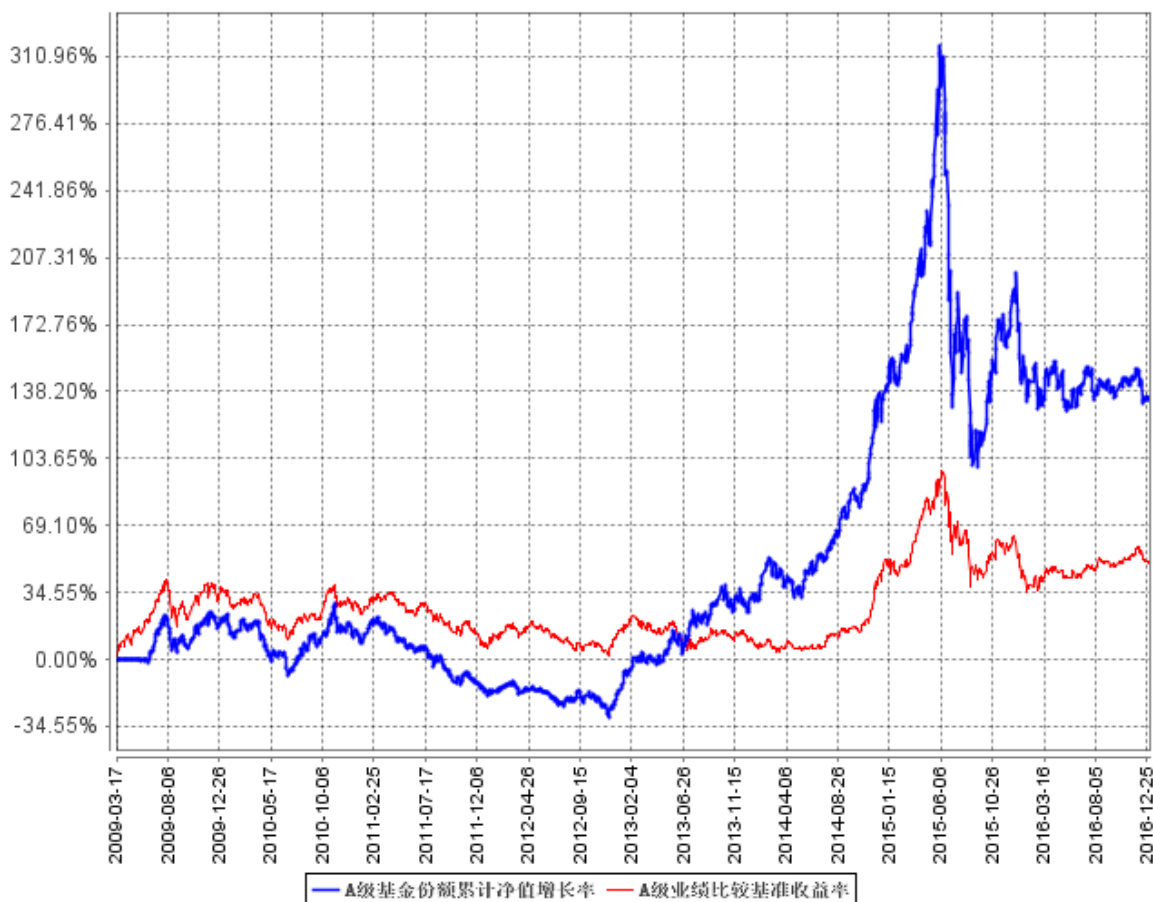
|            |         |       |        |       |         |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去五年       | 179.08% | 1.62% | 38.99% | 1.05% | 140.09% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 134.80% | 1.48% | 50.39% | 1.05% | 84.41%  | 0.43% |

宝盈核心优势混合 C

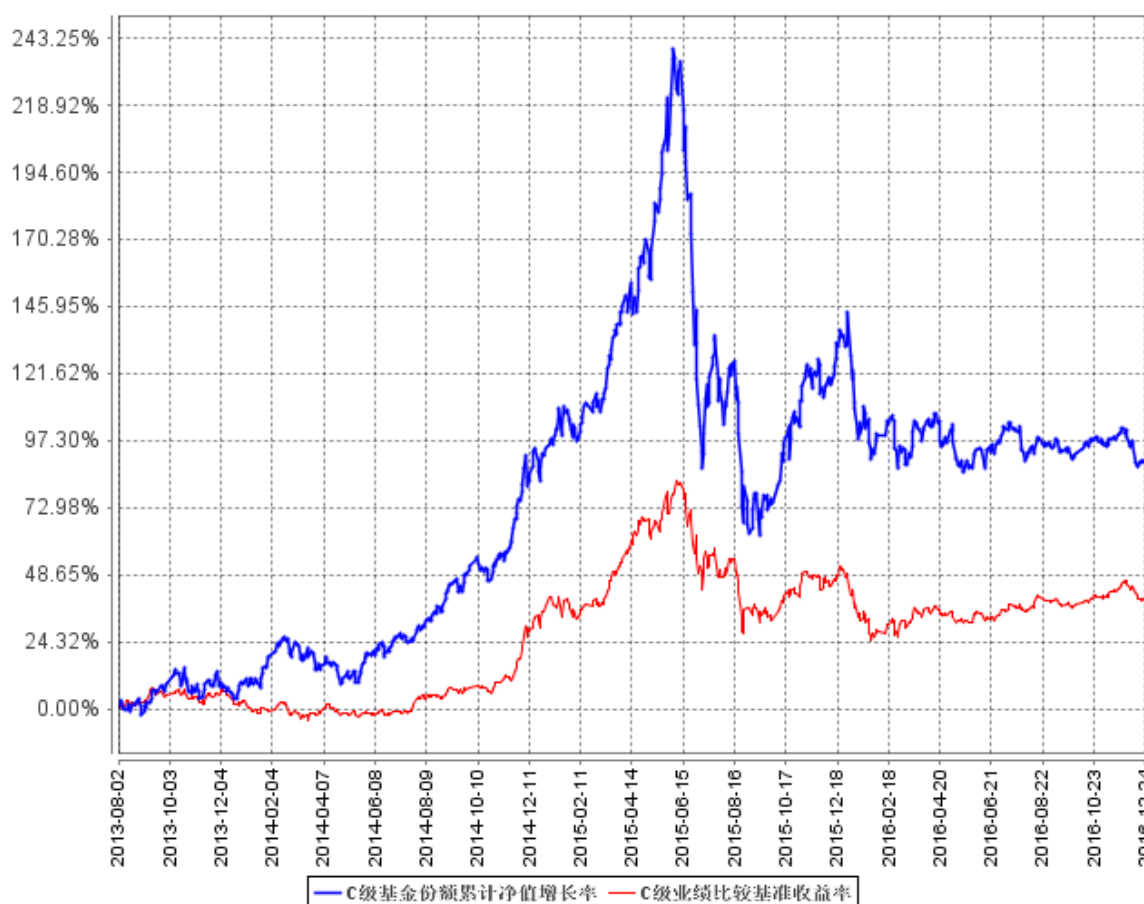
| 阶段         | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -1.55%       | 0.71%               | 1.18%              | 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

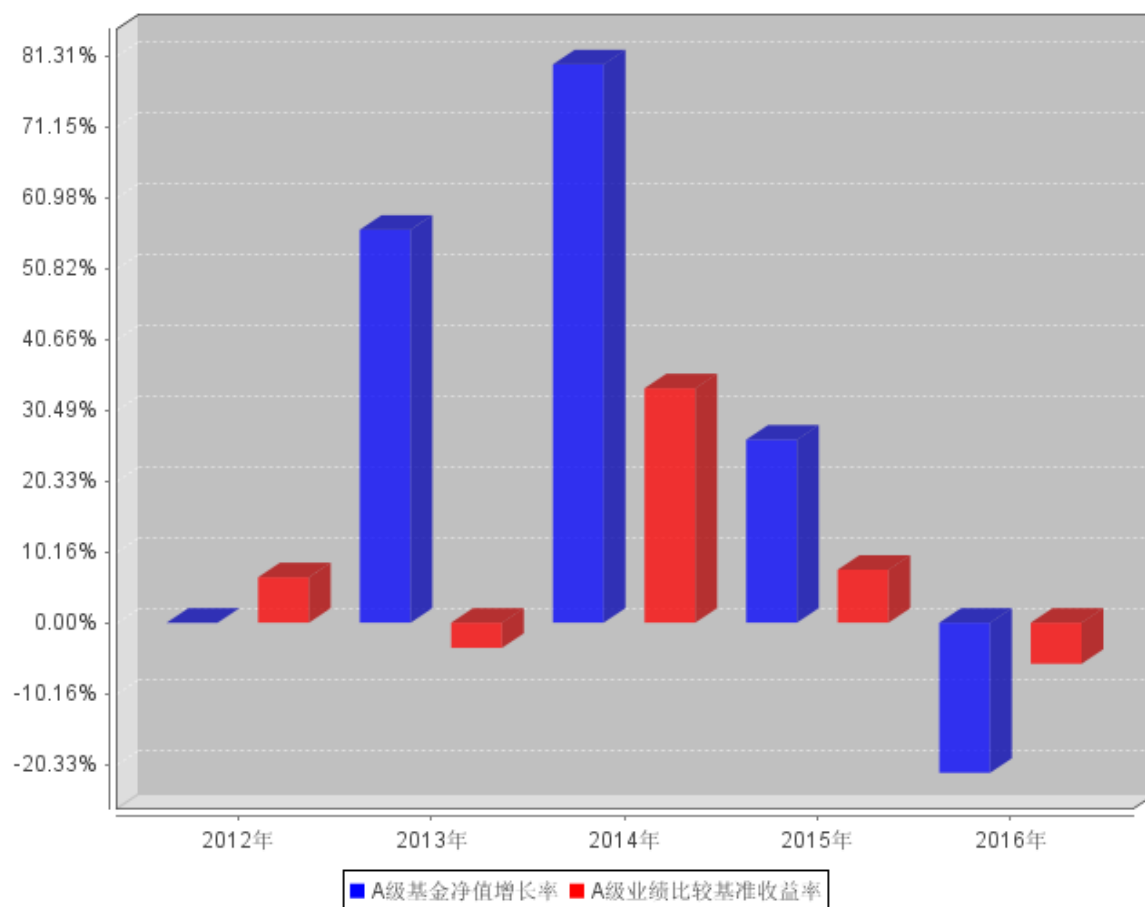


注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

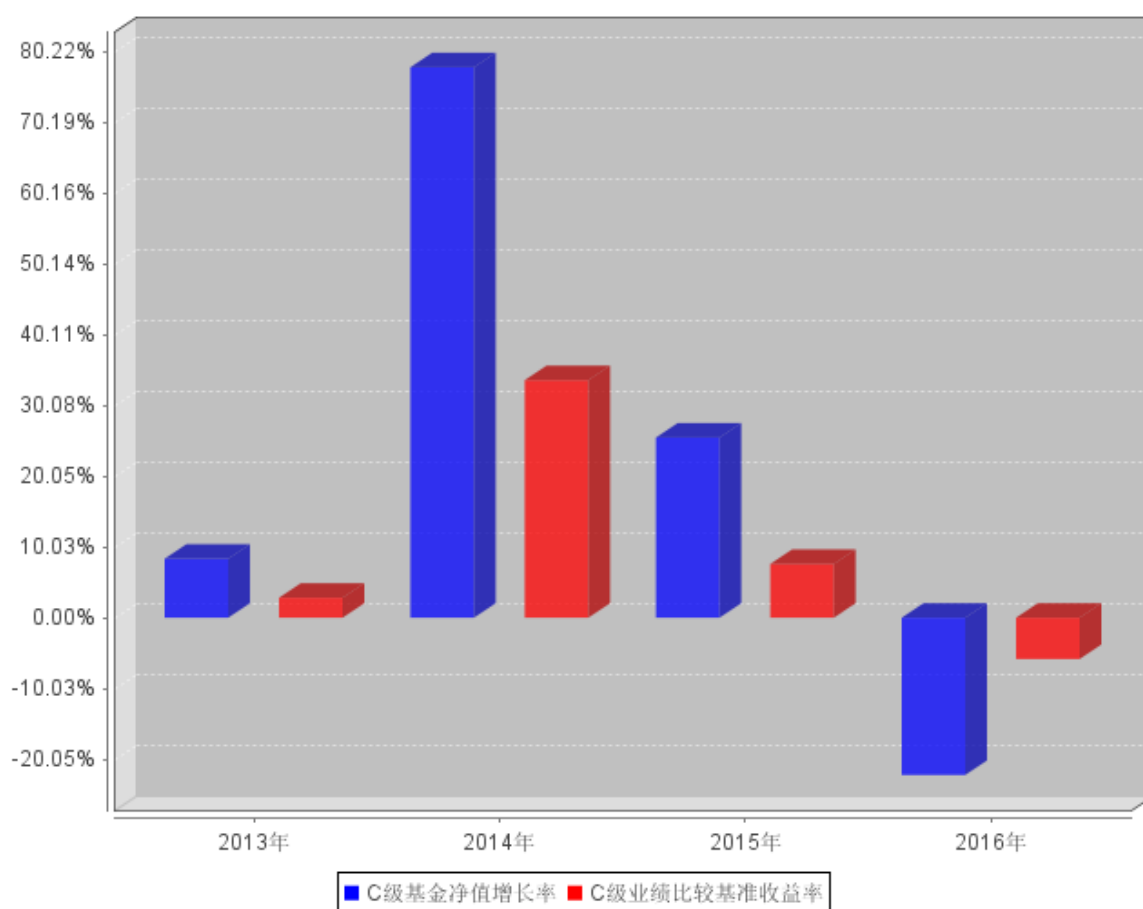
2、本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合C”。

### 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理、宝盈先进制造灵活 | 2014 年 9 月 26 日 | -    | 9 年    | 张小仁先生，中山大学经济学硕士。2007 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长混 |

|     |  |                 |   |     |  |
|-----|--|-----------------|---|-----|--|
|     | 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                               |                 |   |     | 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合规守信情况的说明

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合同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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常交易监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中

和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### **4.9 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

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2017)第 20373 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告  |
|--------------|---|
| 审计报告收件人      | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 引言段          | 我们审计了后附的宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“宝盈核心优势混合”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。  |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是宝盈核心优势混合 的基金管理人宝盈基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:<br>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;<br>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。<br>中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德   |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段     | 我们认为，上述宝盈核心优势混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了宝盈核心优势混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。   |
| 注册会计师的姓名  | 薛竞   周祎   |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市  |
| 审计报告日期    | 2017 年 3 月 23 日   |

## § 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   | 附注号     | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：  |         |                         |                          |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 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         | 7.4.7.2    | 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          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                          | 17,681,730.23               |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 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            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 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>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 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        | 7.4.7.7  | 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          | 7.4.7.8  | 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          | 7.4.7.9  | 1,644,279,865.39 | 1,637,503,815.55 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 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         | 附注号      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|-------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|             |          | 2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至<br>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   | 7.4.7.11 | 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                  | 7.4.7.12   | 5,313,494.62    | 2,310,891,198.51 |
| 基金投资收益                     |            | -               | -                |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 202,806.62      | 40,122,404.74    |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.1 | -               | -                |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14   | -               | -                |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15   | -               | -                |
| 股利收益                       | 7.4.7.16   | 7,230,679.61    | 14,426,646.52    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.17   | -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）          | 7.4.7.18   | 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                   | 7.4.10.2.1 | 28,922,831.60   | 65,330,388.78    |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 4,820,471.85    | 10,888,398.18    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 573,864.90      | 1,946,653.79     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 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                    | 7.4.7.20   | 468,666.08      | 493,401.92       |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -508,761,881.65 | 1,850,724,286.72 |
| 减：所得税费用                    |            | -               | -                |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -508,761,881.65 | 1,850,724,286.72 |

### 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<br>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<br>（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<br>（净值减少以“-”号填列） | -   | -201,276,970.62   | -201,276,970.62   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                            | 1,644,279,865.39                            | 105,762,308.33    | 1,750,042,173.72  |
| 项目   | 上年度可比期间<br>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）                            | 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<br>（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：

|              |             |             |
|--------------|-------------|-------------|
| _____<br>李文众 | _____<br>胡坤 | _____<br>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 基金基本情况

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 5 号《关于核准宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 776,417,611.14 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报验字(09)第 0003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 776,687,900.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 270,289.02 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为基本面良好、投资价值较高的上市公司股票,以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产占基金总资产的比例为 30%-80%;债券为 15%-65%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数 X65%+上证国债指数 X35%。

根据《关于宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金增加收费模式并修改基金合同的公告》,本基金自 2013 年 8 月 1 日起实施分级。根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,为本基金 A 类基金份额;不收取申

购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，为本基金 C 类基金份额。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人

可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 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。

#### **7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 163,586,566.57          | 286,307,091.42           |



|                |                |   |                |
|----------------|----------------|---|----------------|
| 定期存款           |                | - | -              |
| 其中：存款期限 1-3 个月 |                | - | -              |
| 其他存款           |                | - | -              |
| 合计：            | 163,586,566.57 |   | 286,307,091.42 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日  |                  |                |
|-------------------|--------------------------|------------------|----------------|
|                   | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票                | 1,364,271,538.68         | 1,289,149,718.75 | -75,121,819.93 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                        | -                | -              |
| 债券                | 交易所市场                    | 291,865,870.86   | -9,320,727.59  |
|                   | 银行间市场                    | -                | -              |
|                   | 合计                       | 291,865,870.86   | -9,320,727.59  |
| 资产支持证券            | -                        | -                | -              |
| 基金                | -                        | -                | -              |
| 其他                | -                        | -                | -              |
| 合计                | 1,665,458,137.13         | 1,581,015,589.61 | -84,442,547.52 |
| 项目                | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                  |                |
|                   | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票                | 1,403,184,361.91         | 1,806,253,770.03 | 403,069,408.12 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                        | -                | -              |
| 债券                | 交易所市场                    | 376,128,001.00   | 4,498,819.84   |
|                   | 银行间市场                    | -                | -              |
|                   | 合计                       | 376,128,001.00   | 4,498,819.84   |
| 资产支持证券            | -                        | -                | -              |

|    |                  |                  |                |
|----|------------------|------------------|----------------|
| 基金 | -                | -                | -              |
| 其他 | -                | -                | -              |
| 合计 | 1,774,813,543.07 | 2,182,381,771.03 | 407,568,227.96 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 35,763.39          | 45,450.18           |
| 应收定期存款利息   | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 872.08             | 2,595.78            |
| 应收债券利息     | 8,884,729.16       | 12,049,710.16       |
| 应收买入返售证券利息 | -                  | -                   |
| 应收申购款利息    | -                  | -                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  | -                   |
| 其他         | 211.09             | 1,267.20            |
| 合计         | 8,921,575.72       | 12,099,023.32       |

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,291,002.71            | 3,187,613.47             |
| 银行间市场应付交易费用 | 240.00                  | 4,147.00                 |
| 合计          | 1,291,242.71            | 3,191,760.47             |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 应付赎回费 | 4,118.86                | 44,606.93                |
| 预提费用  | 255,000.00              | 210,000.00               |
| 合计    | 259,118.86              | 254,606.93               |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 宝盈核心优势混合 A    |  |                  |
|---------------|--|------------------|
| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,546,627,015.23                       | 1,546,627,015.23 |
| 本期申购          | 636,684,759.93                         | 636,684,759.93   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -564,419,062.01                        | -564,419,062.01  |
| 本期末           | 1,618,892,713.15                       | 1,618,892,713.15 |

金额单位：人民币元

| 宝盈核心优势混合 C |  |               |
|------------|--|---------------|
| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |               |
|            | 基金份额（份）                                | 账面金额          |
| 上年度末       | 90,876,800.32                          | 90,876,800.32 |
| 本期申购       | 17,771,084.40                          | 17,771,084.40 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -83,260,732.48 | -83,260,732.48 |
| 本期末           | 25,387,152.24  | 25,387,152.24  |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 宝盈核心优势混合 A     |                 |                 |                 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
| 上年度末           | 595,551,385.51  | 188,547,952.89  | 784,099,338.40  |
| 本期利润           | -18,113,405.92  | -475,106,638.19 | -493,220,044.11 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 35,204,290.44   | -24,570,501.43  | 10,633,789.01   |
| 其中：基金申购款       | 216,235,672.22  | -112,369,637.01 | 103,866,035.21  |
| 基金赎回款          | -181,031,381.78 | 87,799,135.58   | -93,232,246.20  |
| 本期已分配利润        | -196,763,168.62 | -               | -196,763,168.62 |
| 本期末            | 415,879,101.41  | -311,129,186.73 | 104,749,914.68  |

单位：人民币元

| 宝盈核心优势混合 C     |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 33,147,930.18  | 11,210,187.23  | 44,358,117.41  |
| 本期利润           | 1,362,299.75   | -16,904,137.29 | -15,541,837.54 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,233,627.82 | 943,543.60     | -23,290,084.22 |
| 其中：基金申购款       | 5,724,778.53   | -3,076,417.41  | 2,648,361.12   |
| 基金赎回款          | -29,958,406.35 | 4,019,961.01   | -25,938,445.34 |
| 本期已分配利润        | -4,513,802.00  | -              | -4,513,802.00  |
| 本期末            | 5,762,800.11   | -4,750,406.46  | 1,012,393.65   |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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<br>12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31<br>日 |
|-----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,698,019.79                        | 2,175,634.85                        |
| 定期存款利息收入  | -                                   | -                                   |
| 其他存款利息收入  | -                                   | -                                   |
| 结算备付金利息收入 | 63,155.65                           | 187,810.19                          |
| 其他        | 20,540.38                           | 77,677.80                           |
| 合计        | 1,781,715.82                        | 2,441,122.84                        |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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<br>年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015<br>年 12 月 31 日 |
| 卖出股票成交总额   | 4,095,435,580.94                    | 15,788,747,667.71                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,090,122,086.32                    | 13,477,856,469.20                   |
| 买卖股票差价收入   | 5,313,494.62                        | 2,310,891,198.51                    |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期                        | 上年度可比期间                   |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|
|                   | 2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 2015年1月1日至<br>2015年12月31日 |
| 卖出债券及债券到期兑付成交总额   | 177,370,339.73            | 2,113,747,781.97          |
| 减：卖出债券及债券到期兑付成本总额 | 173,270,560.18            | 2,040,657,819.59          |
| 减：应收利息总额          | 3,896,972.93              | 32,967,557.64             |
| 买卖债券差价收入          | 202,806.62                | 40,122,404.74             |

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,230,679.61                | 14,426,646.52                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                           | -                                |
| 合计          | 7,230,679.61                | 14,426,646.52                    |

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -492,010,775.48             | -435,174,020.63                  |
| ——股票投资     | -478,191,228.05             | -356,670,875.77                  |
| ——债券投资     | -13,819,547.43              | -78,503,144.86                   |
| ——资产支持证券投资 | -                           | -                                |
| ——贵金属投资    | -                           | -                                |
| ——其他       | -                           | -                                |
| 2. 衍生工具    | -                           | -                                |
| ——权证投资     | -                           | -                                |
| 3. 其他      | -                           | -                                |
| 合计         | -492,010,775.48             | -435,174,020.63                  |

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|    |                             |                                  |

|         |              |               |
|---------|--------------|---------------|
| 基金赎回费收入 | 905,909.71   | 14,140,629.77 |
| 基金转换费收入 | 128,436.99   | 3,741,718.96  |
| 合计      | 1,034,346.70 | 17,882,348.73 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其 A 类份额赎回费部分的 25% 归入基金资产，C 类份额所收取的赎回费全额计入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

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 |
| 交易所市场交易费用 | 12,241,231.82                    | 41,128,482.94                    |
| 银行间市场交易费用 | -                                | 5,950.00                         |
| 合计        | 12,241,231.82                    | 41,134,432.94                    |

#### 7.4.7.20 其他费用

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 |
| 审计费用     | 110,000.00                       | 110,000.00                       |
| 信息披露费    | 300,000.00                       | 300,000.00                       |
| 其他       | 1,200.00                         | 350.00                           |
| 银行汇划费用   | 21,466.08                        | 50,051.92                        |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00                        | 18,000.00                        |
| 上清所账户维护费 | 18,000.00                        | 15,000.00                        |
| 合计       | 468,666.08                       | 493,401.92                       |

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

本基金无需披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号), 要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

2. 本基金的基金管理人于 2017 年 1 月 12 日宣告 2017 年度第 1 次分红, 向截至 2017 年 1 月 16 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人, 按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元。

3. 本基金的基金管理人于 2017 年 3 月 15 日宣告 2017 年度第 2 次分红, 向截至 2017 年 3 月 17 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人, 按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元。

### 7.4.9 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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  | 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。

#### 7.4.10.2.2 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 | 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。

#### 7.4.10.2.3 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<br>混合 A | 宝盈核心优势<br>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。

#### 7.4.10.3 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

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日      |        |      |          |          |                |            |
|---|--------|------|----------|----------|----------------|------------|
| 银行间市场交<br>易的<br>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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出       |
| 中国银行  | -      | -    | -        | -        | -              | -          |
| 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |        |      |          |          |                |            |
| 银行间市场交<br>易的<br>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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出       |
| 中国银行  | -      | -    | -        | -        | 887,600,000.00 | 376,946.85 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015<br>年 12 月 31 日 |
|----|---|--|
|    |   | 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%        |

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

宝盈核心优势混合A

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日/除息日  | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|------------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1  | 2016年6月15日 | 0.1000          | 11,628,799.83 | 6,118,507.51  | 17,747,307.34 |    |
| 2  | 2016年5月31日 | 0.1000          | 11,602,403.31 | 6,058,472.00  | 17,660,875.31 |    |
| 3  | 2016年5月18日 | 0.1000          | 11,542,858.43 | 5,968,668.25  | 17,511,526.68 |    |
| 4  | 2016年5月5日  | 0.1000          | 11,436,129.96 | 6,068,768.50  | 17,504,898.46 |    |

|    |            |        |                |               |                |  |
|----|------------|--------|----------------|---------------|----------------|--|
| 5  | 2016年4月21日 | 0.1000 | 11,349,083.90  | 6,012,224.10  | 17,361,308.00  |  |
| 6  | 2016年4月8日  | 0.1000 | 11,359,867.70  | 5,917,734.88  | 17,277,602.58  |  |
| 7  | 2016年3月25日 | 0.1000 | 9,666,877.55   | 5,860,094.19  | 15,526,971.74  |  |
| 8  | 2016年3月14日 | 0.1000 | 9,680,313.76   | 5,792,288.35  | 15,472,602.11  |  |
| 9  | 2016年3月1日  | 0.1000 | 9,644,506.05   | 5,670,210.91  | 15,314,716.96  |  |
| 10 | 2016年2月17日 | 0.1000 | 9,626,006.07   | 5,567,602.91  | 15,193,608.98  |  |
| 11 | 2016年1月28日 | 0.1000 | 9,572,940.45   | 5,455,945.71  | 15,028,886.16  |  |
| 12 | 2016年1月15日 | 0.1000 | 9,586,844.08   | 5,576,020.22  | 15,162,864.30  |  |
| 合计 |            | 1.2000 | 126,696,631.09 | 70,066,537.53 | 196,763,168.62 |  |

## 宝盈核心优势混合 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日/除息日  | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计 | 备注 |
|----|------------|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 1  | 2016年6月15日 | 0.1000                | 0.1000       | 193,087.42    | 164,838.02   |    |
| 2  | 2016年5月31日 | 0.1000                | 0.1000       | 196,953.21    | 162,862.67   |    |
| 3  | 2016年5月18日 | 0.1000                | 0.1000       | 207,054.21    | 162,587.69   |    |
| 4  | 2016年5月5日  | 0.1000                | 0.1000       | 203,960.39    | 159,941.72   |    |
| 5  | 2016年4月21日 | 0.1000                | 0.1000       | 208,676.29    | 153,868.86   |    |
| 6  | 2016年4月8日  | 0.1000                | 0.1000       | 210,540.08    | 151,550.69   |    |
| 7  | 2016年3月25日 | 0.1000                | 0.1000       | 217,519.20    | 151,863.53   |    |
| 8  | 2016年3月14日 | 0.1000                | 0.1000       | 230,477.25    | 148,119.56   |    |
| 9  | 2016年3月1日  | 0.1000                | 0.1000       | 235,278.24    | 148,743.42   |    |
| 10 | 2016年2月17日 | 0.1000                | 0.1000       | 245,822.98    | 146,305.97   |    |
| 11 | 2016年1月28日 | 0.1000                | 0.1000       | 260,043.07    | 147,357.05   |    |
| 12 | 2016年1月15日 | 0.1000                | 0.1000       | 272,135.73    | 134,214.75   |    |
| 合计 |            | 1.2000                | 1.2000       | 2,681,548.07  | 1,832,253.93 |    |

## 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 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。

### 7.4.12.2 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<br>估值<br>单价 | 复牌<br>日期        | 复牌<br>开盘<br>单价 | 数量（股）     | 期末<br>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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程

中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 3.24%(2015 年 12 月 31 日：无)。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

##### **7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计             |
|-------------------------|----------------|-------|-------|-----|----------------|
| 资产                      |                |       |       |     |                |
| 银行存款                    | 163,586,566.57 | -     | -     | -   | 163,586,566.57 |

|                          |                |                |                |                  |                  |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 结算备付金                    | 1,761,822.26   | -              | -              | -                | 1,761,822.26     |
| 存出保证金                    | 426,517.36     | -              | -              | -                | 426,517.36       |
| 交易性金融资产                  | -              | 235,135,757.40 | 56,730,113.46  | 1,289,149,718.75 | 1,581,015,589.61 |
| 应收利息                     | -              | -              | -              | 8,921,575.72     | 8,921,575.72     |
| 应收申购款                    | 30,970.54      | -              | -              | 238,011.93       | 268,982.47       |
| 资产总计                     | 165,805,876.73 | 235,135,757.40 | 56,730,113.46  | 1,298,309,306.40 | 1,755,981,053.99 |
| 负债                       |                |                |                |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -              | 1,645,486.63     | 1,645,486.63     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | 2,261,853.83     | 2,261,853.83     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | 376,975.63       | 376,975.63       |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -              | 33,941.01        | 33,941.01        |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -              | 1,291,242.71     | 1,291,242.71     |
| 应交税费                     | -              | -              | -              | 70,261.60        | 70,261.60        |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 259,118.86       | 259,118.86       |
| 负债总计                     | -              | -              | -              | 5,938,880.27     | 5,938,880.27     |
| 利率敏感度缺口                  | 165,805,876.73 | 235,135,757.40 | 56,730,113.46  | 1,292,370,426.13 | 1,750,042,173.72 |
| 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息              | 合计               |
| 资产                       |                |                |                |                  |                  |
| 银行存款                     | 286,307,091.42 | -              | -              | -                | 286,307,091.42   |
| 结算备付金                    | 5,244,046.14   | -              | -              | -                | 5,244,046.14     |
| 存出保证金                    | 2,559,966.99   | -              | -              | -                | 2,559,966.99     |
| 交易性金融资产                  | 60,108,000.00  | 168,471,709.90 | 147,548,291.10 | 1,806,253,770.03 | 2,182,381,771.03 |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -              | 17,681,730.23    | 17,681,730.23    |
| 应收利息                     | -              | -              | -              | 12,099,023.32    | 12,099,023.32    |
| 应收申购款                    | 1,767,800.00   | -              | -              | 7,031,973.33     | 8,799,773.33     |
| 资产总计                     | 355,986,904.55 | 168,471,709.90 | 147,548,291.10 | 1,843,066,496.91 | 2,515,073,402.46 |
| 负债                       |                |                |                |                  |                  |
| 应付证券清算款                  | -              | -              | -              | 29,856,964.90    | 29,856,964.90    |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -              | 12,488,441.10    | 12,488,441.10    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | 2,720,712.20     | 2,720,712.20     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | 453,452.01       | 453,452.01       |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -              | 75,931.89        | 75,931.89        |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -              | 3,191,760.47     | 3,191,760.47     |
| 应交税费                     | -              | -              | -              | 70,261.60        | 70,261.60        |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 254,606.93       | 254,606.93       |
| 负债总计                     | -              | -              | -              | 49,112,131.10    | 49,112,131.10    |
| 利率敏感度缺口                  | 355,986,904.55 | 168,471,709.90 | 147,548,291.10 | 1,793,954,365.81 | 2,465,961,271.36 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。



#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 16.68% (2015 年 12 月 31 日：15.25%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 30%-80%，债券为 15%-65%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,289,149,718.75        | 73.66                    | 1,806,253,770.03         | 73.25                 |

|               |                  |       |                  |       |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 交易性金融资产—基金投资  | -                | -     | -                | -     |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                | -     | -                | -     |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                | -     | -                | -     |
| 其他            | -                | -     | -                | -     |
| 合计            | 1,289,149,718.75 | 73.66 | 1,806,253,770.03 | 73.25 |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设                | 除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                       |
|-------------------|--------------------------------|---------------------------------|-----------------------|
| 分析                | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额(单位:人民币元) |                       |
|                   |                                | 本期末(2016年12月<br>31日)            | 上年度末(2015年12月<br>31日) |
|                   | 1. 沪深 300 指数上升 5%              | 66,841,789.00                   | 91,618,147.00         |
| 2. 沪深 300 指数下降 5% | -66,841,789.00                 | -91,618,147.00                  |                       |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,301,795,893.24 元，属于第二层次的余额为 279,219,696.37 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,710,819,285.99 元，第二层次 471,562,485.04 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -             |
| P  | 教育               | -                | -             |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -             |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -             |
| S  | 综合               | -                | -             |
|    | 合计               | 1,289,149,718.75 | 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所有股票投资明细**

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 |
| 11 | 300068 | 南都电源   | 2,205,200 | 42,494,204.00  | 2.43 |
| 12 | 600315 | 上海家化   | 1,500,000 | 40,665,000.00  | 2.32 |
| 13 | 002358 | 森源电气   | 2,099,958 | 40,277,194.44  | 2.30 |
| 14 | 002664 | 信质电机   | 1,534,200 | 38,953,338.00  | 2.23 |
| 15 | 300325 | 德威新材   | 4,912,198 | 32,715,238.68  | 1.87 |
| 16 | 002368 | 太极股份   | 1,020,600 | 31,240,566.00  | 1.79 |
| 17 | 000913 | *ST 钱江 | 1,857,800 | 30,950,948.00  | 1.77 |
| 18 | 603589 | 口子窖    | 907,439   | 29,156,015.07  | 1.67 |
| 19 | 600529 | 山东药玻   | 1,294,301 | 27,516,839.26  | 1.57 |
| 20 | 603008 | 喜临门    | 1,499,902 | 27,448,206.60  | 1.57 |
| 21 | 000421 | 南京公用   | 3,045,129 | 27,071,196.81  | 1.55 |
| 22 | 300476 | 胜宏科技   | 1,046,000 | 23,901,100.00  | 1.37 |
| 23 | 000401 | 冀东水泥   | 2,000,000 | 23,800,000.00  | 1.36 |
| 24 | 000861 | 海印股份   | 4,902,971 | 23,779,409.35  | 1.36 |
| 25 | 002519 | 银河电子   | 1,000,000 | 22,400,000.00  | 1.28 |
| 26 | 000049 | 德赛电池   | 499,954   | 21,023,065.70  | 1.20 |
| 27 | 600060 | 海信电器   | 1,200,000 | 20,544,000.00  | 1.17 |
| 28 | 300342 | 天银机电   | 864,649   | 19,886,927.00  | 1.14 |
| 29 | 002698 | 博实股份   | 1,000,000 | 15,570,000.00  | 0.89 |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 30 | 603456 | 九洲药业 | 700,000   | 15,099,000.00 | 0.86 |
| 31 | 000980 | 金马股份 | 1,000,000 | 14,430,000.00 | 0.82 |
| 32 | 300232 | 洲明科技 | 639,478   | 9,541,011.76  | 0.55 |
| 33 | 002576 | 通达动力 | 255,100   | 6,221,889.00  | 0.36 |
| 34 | 300537 | 广信材料 | 101,024   | 4,928,960.96  | 0.28 |
| 35 | 603986 | 兆易创新 | 1,133     | 201,640.01    | 0.01 |

#### 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所有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 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |       |
|------|-------|-----------|-------|-------|
|      |       |           | 机构投资者 | 个人投资者 |
|      |       |           |       |       |

|            | (户)     |           | 持有份额           | 占总份额<br>比例 | 持有份额             | 占总份<br>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<br>比例 |
|----------------------|------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员<br>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<br>投资和研究部门负责人持<br>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<br>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 | 宝盈核心优势 |
|----|--------|--------|
|----|--------|--------|

|                                | 混合 A             | 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   | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                     | 法定披露方式                   | 法定披露日期     |
|----|--|--------------------------|------------|
| 1  | 宝盈基金管理有限公司关于指数触发不可恢复熔断当日旗下部分基金开放时间调整的公告  | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年1月4日  |
| 2  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年1月5日  |
| 3  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告    | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年1月5日  |
| 4  | 宝盈基金管理有限公司关于指数触发不可恢复熔断当日旗下部分基金开放时间调整的公告  | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年1月7日  |
| 5  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年1月8日  |
| 6  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年1月12日 |
| 7  | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十六次分红公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年1月13日 |
| 8  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年1月14日 |
| 9  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年1月16日 |



|    |  |                     |            |
|----|--|---------------------|------------|
| 10 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十七次分红公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年1月23日 |
| 11 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年1月27日 |
| 12 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年1月28日 |
| 13 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月2日  |
| 14 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月3日  |
| 15 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月5日  |
| 16 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十八次分红公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月15日 |
| 17 | 宝盈基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告       | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月16日 |
| 18 | 宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月19日 |
| 19 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月24日 |
| 20 | 宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职领薪情况的公告                | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月24日 |
| 21 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告                   | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月25日 |
| 22 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月26日 |
| 23 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十九次分红公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 | 2016年2月27日 |
| 24 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票                      | 中国证券报 证券时报          | 2016年3月1日  |

|    |  |                          |            |
|----|--|--------------------------|------------|
|    | 采用指数收益法进行估值的提示性公告                        | 上海证券报                    |            |
| 25 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十次分红公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年3月11日 |
| 26 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年3月18日 |
| 27 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年3月22日 |
| 28 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十一次分红公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年3月23日 |
| 29 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年3月26日 |
| 30 | 关于宝盈基金管理有限公司网上交易平台开通富友支付及费率优惠的公告         | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年3月28日 |
| 31 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年3月31日 |
| 32 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年4月6日  |
| 33 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十三次分红公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年4月7日  |
| 34 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十三次分红公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年4月19日 |
| 35 | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                  | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年4月29日 |
| 36 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十四次分红公告             | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年5月3日  |
| 37 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年5月10日 |
| 38 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年5月11日 |

|    |   |                          |            |
|----|---|--------------------------|------------|
| 39 | 关于增加申万宏源西部证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告                    | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年5月13日 |
| 40 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告            | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年5月14日 |
| 41 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十五次分红公告                        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年5月16日 |
| 42 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告  | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年5月16日 |
| 43 | 宝盈基金管理有限公司关于新增珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告   | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年5月18日 |
| 44 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十六次分红公告                        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年5月27日 |
| 45 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告            | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年6月2日  |
| 46 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告            | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年6月4日  |
| 47 | 宝盈基金管理有限公司关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告  | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年6月6日  |
| 48 | 宝盈基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告   | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年6月6日  |
| 49 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海凯石财富基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年6月6日  |
| 50 | 宝盈基金管理有限公司关于新增大泰金石投资管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告   | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年6月6日  |

|    |   |                          |            |
|----|---|--------------------------|------------|
|    | 的公告   |                          |            |
| 51 | 关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的更正公告                           | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年6月8日  |
| 52 | 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第四十七次分红公告                          | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年6月13日 |
| 53 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年6月28日 |
| 54 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年6月29日 |
| 55 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报      | 2016年6月30日 |
| 56 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年7月7日  |
| 57 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年7月8日  |
| 58 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告     | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年7月13日 |
| 59 | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                               | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年8月6日  |
| 60 | 宝盈基金管理有限公司关于新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年8月10日 |
| 61 | 宝盈基金管理有限公司关于调整从业人员在子公司兼职情况的公告                         | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年8月12日 |
| 62 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告              | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年8月16日 |
| 63 | 宝盈基金管理有限公司关于新增诺亚正行（上海）基                               | 中国证券报 证券时报               | 2016年8月25日 |

|    |  |                          |             |
|----|--|--------------------------|-------------|
|    | 金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告                       | 上海证券报 证券日报               |             |
| 64 | 宝盈基金管理有限公司关于新增北京格上富信投资顾问有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年9月7日   |
| 65 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年9月14日  |
| 66 | 宝盈基金管理有限公司关于新增北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年9月19日  |
| 67 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年9月20日  |
| 68 | 宝盈基金管理有限公司关于新增浙江金观诚财富管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告       | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年9月29日  |
| 69 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年10月10日 |
| 70 | 宝盈基金管理有限公司关于新增和耕传承基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年10月12日 |
| 71 | 宝盈基金管理有限公司关于新增深圳富济财富管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年10月20日 |
| 72 | 宝盈基金管理有限公司关于调整从业人员在子公司兼职情况的公告                            | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年10月26日 |
| 73 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海万得投资顾问有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016年10月31日 |

|    |  |                          |                  |
|----|--|--------------------------|------------------|
| 74 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海联泰资产管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 11 月 10 日 |
| 75 | 宝盈基金管理有限公司关于新增天津国美基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告        | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 11 月 11 日 |
| 76 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 11 月 17 日 |
| 77 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 11 月 29 日 |
| 78 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 11 月 29 日 |
| 79 | 宝盈基金管理有限公司关于新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 1 日  |
| 80 | 宝盈基金管理有限公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 1 日  |
| 81 | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                  | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 3 日  |
| 82 | 宝盈基金管理有限公司关于新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告    | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 7 日  |
| 83 | 宝盈基金管理有限公司关于新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告    | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 7 日  |
| 84 | 宝盈基金管理有限公司关于新增北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠           | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 9 日  |

|    |  |                          |                  |
|----|--|--------------------------|------------------|
|    | 活动的公告  |                          |                  |
| 85 | 宝盈基金管理有限公司关于新增杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 9 日  |
| 86 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 13 日 |
| 87 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海中正达广投资管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告      | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 14 日 |
| 88 | 宝盈基金管理有限公司关于调整从业人员在子公司兼职情况的公告                            | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 15 日 |
| 89 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 15 日 |
| 90 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 22 日 |
| 91 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司开放式公募基金交易优惠活动的公告           | 中国证券报 证券时报<br>上海证券报 证券日报 | 2016 年 12 月 30 日 |

## § 12 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人及基金托管人的住所。

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

### **13.3 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 3 月 27 日**