
宝盈消费主题灵活配置混合型
证券投资基金（原鸿阳证券投资基金）
2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 4 月 22 日

§1 重要提示

宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金由鸿阳证券投资基金转型而来。2016 年 11 月 3 日至 2016 年 12 月 2 日鸿阳证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议于 2016 年 12 月 5 日表决通过了鸿阳证券投资基金转型议案，内容包括鸿阳证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、投资范围和投资策略、调整收益分配原则等条款以及相应修订《鸿阳证券投资基金基金合同》等。本次持有人大会决议自表决通过之日 2016 年 12 月 5 日起生效，并报中国证监会备案。依据持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请鸿阳证券投资基金于 2017 年 1 月 4 日终止上市。自基金终止上市之日起，原《鸿阳证券投资基金基金合同》终止，《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，鸿阳证券投资基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，对基金投资目标、投资范围和投资策略、收益分配原则等予以调整，同时基金更名为“宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告编制期间说明：

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。原基金鸿阳证券投资基金的报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 1 月 3 日止，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2017 年 1 月 4 日起至 2017 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	宝盈消费主题混合
基金主代码	003715
交易代码	003715
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 4 日
报告期末基金份额总额	756,838,195.70 份
投资目标	本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生品投资策略和参与融资业务的投资策略组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面尽力规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够跟踪某类资产的上行趋势。本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、消费主题的界定</p> <p>随着社会经济、文化的发展、技术进步、人口结构的变化，消费主题在国民经济发展不同阶段将体现不同的内涵和外延。本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司，包括有形商品消费行业和以生活服务业为代表的新型泛消费行业，具体界定如下：</p> <p>（1）有形商品消费：指提供实物消费商品的行业，如食品饮料、纺织服装、家电、汽车、家用轻工等。</p> <p>（2）生活服务消费：指不以实物形式而以劳务形式作为消费载体，为居民生活提供服务的泛消费行业，具体包括餐饮旅游、医疗健康、家政服务、金融服务、教育、通信、影视传媒、文化出版、体育休闲、商贸零售等。</p> <p>基于本基金对消费主题的界定，本基金可投资的行业包括：建筑装饰、汽车、家用电器、纺织服装、轻工制造、商业贸易、农林牧渔、食品饮料、休闲服务、医疗保健、传媒、通信、金融服务等。</p> <p>未来如果由于经济发展、生活方式变化或政策调整造成消费主题行业的覆盖范围发生变动，基金</p>

	<p>管理人有权对上述界定进行调整和修订。</p> <p>2、主题投资策略 在可投资行业的基础上，本基金重点关注消费行业的两类投资机会： （1）由于社会人口构成、消费偏好或需求变化带来增长的消费主题行业公司； （2）消费行业间的融合或与其他技术、商业模式相结合衍生出的新兴消费行业蕴含的投资机会，如互联网融合、科技进步所带来的新兴消费形态，或国内人口结构变化带来的消费行业融合发展机会等。</p> <p>3、个股精选策略 本基金在主题筛选的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选上市公司进行投资。</p> <p>（三）固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。</p> <p>（四）金融衍生品投资策略</p> <p>1、权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。</p> <p>2、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>（五）参与融资业务的投资策略 本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。</p>
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率×70% +中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

转型前：

基金简称	宝盈鸿阳封闭
场内简称	基金鸿阳
交易代码	184728
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001 年 12 月 10 日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00 份
投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良而稳定的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险，在保持基金资产良好的流动性的基础上，实现基金资产的稳定增长，为基金持有人谋求长期最佳利益。
投资策略	本基金股票投资包括两部分：一部分为成长型投资，另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整，但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的 30%，最高均不得高于股票投资总额的 70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则，在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合，分散和降低投资风险，确保基金资产安全，谋求基金长期稳定的收益。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	风险水平和期望收益适中。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 1 月 4 日 — 2017 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	10,904,458.92
2. 本期利润	-19,761,610.48
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0132
4. 期末基金资产净值	752,967,128.09
5. 期末基金份额净值	0.9949

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年1月1日—2017年1月3日）
1. 本期已实现收益	116,243.12
2. 本期利润	991,491.23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0005
4. 期末基金资产净值	2,019,432,510.69
5. 期末基金份额净值	1.0097

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

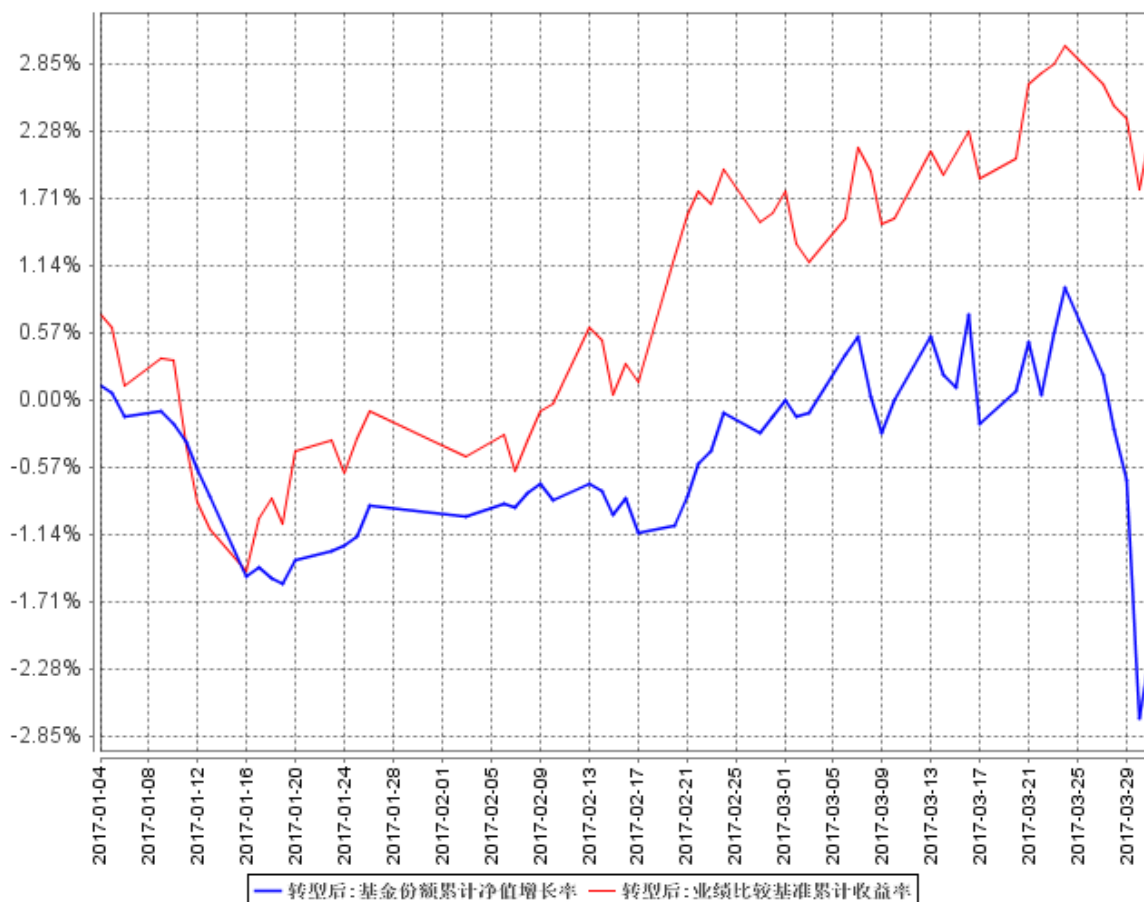
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
2017年 1月4日至 2017年 3月31日	-2.07%	0.42%	2.35%	0.38%	-4.42%	0.04%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金由基金鸿阳证券投资基金转型而来，转型生效日期为 2017 年 1 月 4 日。

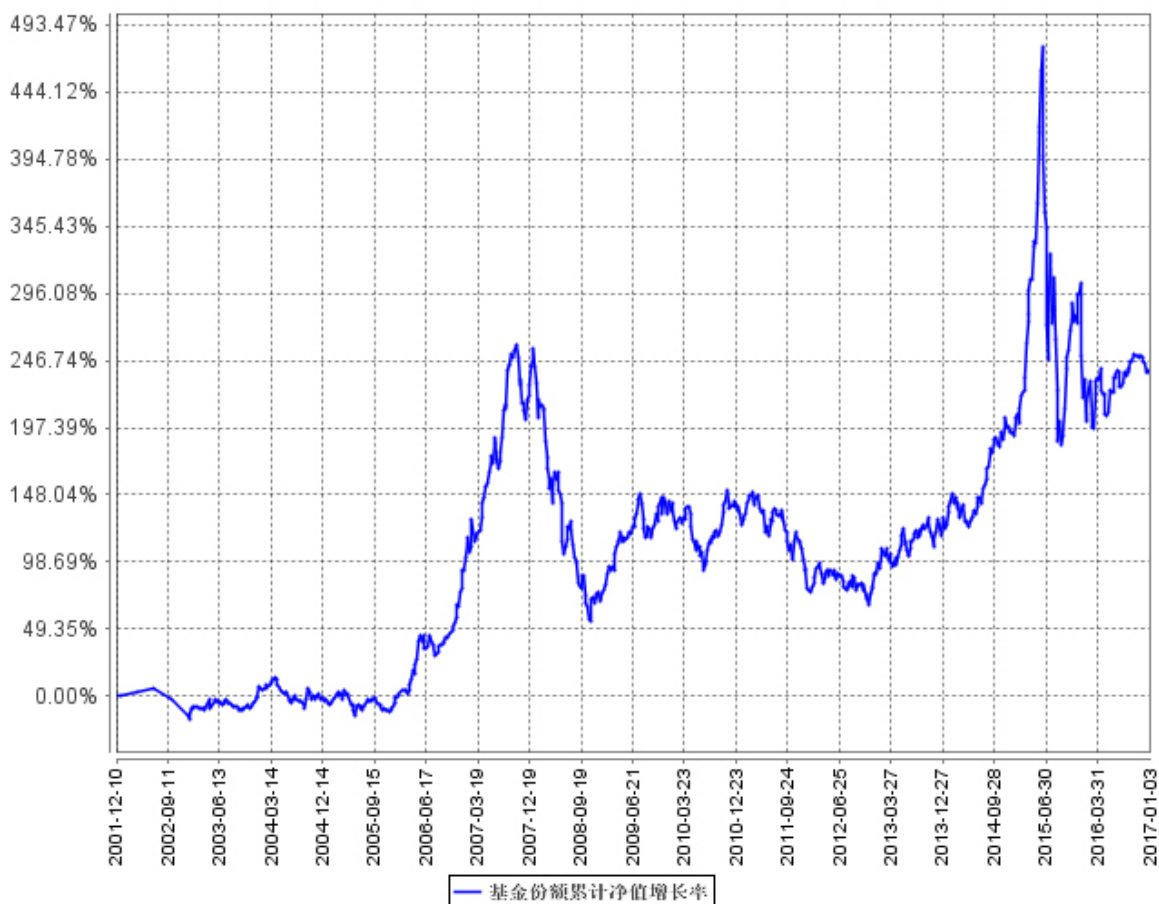
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日	0.05%	-	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金由基金鸿阳证券投资基金转型而来，转型生效日期为 2017 年 1 月 4 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段鹏程	本基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈优势产业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基金经理；权益投资部总监	2016年8月20日	-	13年	段鹏程先生，厦门大学生物学硕士。曾任职于厦门国际信托投资公司，天同证券深圳中心营业部总经理助理、副总经理，诺安基金管理有限公司基金经理，特定客户资产管理部总监。2004年5月加入宝盈基金管理有限公司，历任特定客户资产管理部投资经理、副总监，研究部核心研究员、副总监、总监，现任宝盈基金管理有限公司权益投资部总监。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：本基金由“鸿阳证券投资基金”转型而来，转型日期为 2017 年 1 月 4 日，转型前后基金经

理均为段鹏程。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年一季度，A 股市场呈现小幅、盘升趋势。上证指数涨幅 3.83%、沪深 300 涨幅 4.41%、深成指涨幅 2.47%、中小板指数涨幅 4.22%、创业板指数跌幅 2.79%。整体上看，中小板、创业板在一季度落后于主板。

本基金属大消费领域投资基金，按照基金契约与法规规定，在本报告期内，重点投资行业限定于以医疗健康产业、新能源汽车产业链、消费电子、食品、纺织服务等行业为代表的大消费领域，并基于行业的发展前景分析，投资了部分环保行业、军工行业企业。

报告期内，宏观经济数据保持平稳，从 PMI 数据看，1 季度非制造业商务活动指数均值为 54.6，制造业 PMI 均值为 51.6，均高于 2016 年 4 季度。3 月份的制造业 PMI 为 51.8，连续 8 个月维持在扩张区间，且均高于 2013 年以来历史同期水平。分项中生产指数为 54.2，连续维持在

扩张区间，创下 32 个月以来新高，制造业生产延续扩张。从高频数据看，3 月电厂耗煤量同比增幅扩大至 18.4%，较 1-2 月扩大 2.2 个百分点。综合看，1 季度经济环比增长动力依然强劲，预计 1 季度 GDP 增速维持在 6.8%左右。

从行业数据来看，17 年 1、2 月份，社会消费品零售总额为 5.80 万亿元，同比增长 9.5%（扣除价格因素实际增长 8.1%）。其中，限额以上企业消费品零售额 2.47 万亿元，同比增长 6.8%。从环比看，1-2 月份社销总额增速比 2016 年 12 月下降 1.4 个百分点。1-2 月，限额以上企业商品零售额 2.32 万亿元，同比增长 6.8%。社消增速低于预期。

本基金管理人认为：“消费升级”是大消费领域未来较长一段时间内的投资主线，到 2025 年我国的居民消费率将从目前的 45%上升到 60%。从中、短期来看，投资的重点在于：高端化、国产化以及高科技商业进程较快的领域，诸如：3D 面部识别、智能驾驶、新能源汽车等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后（2017 年 1 月 4 日-2017 年 3 月 31 日）：

本报告期基金份额净值增长率为-2.07%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%。

转型前（2017 年 1 月 1 日-2017 年 1 月 3 日）：

本报告期基金份额净值增长率为 0.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	704,846,162.02	90.86
	其中：股票	704,846,162.02	90.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	50,780,703.60	6.55
8	其他资产	20,103,216.18	2.59
9	合计	775,730,081.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,108,504.50	1.74
B	采矿业	-	-
C	制造业	545,254,729.30	72.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,900,000.00	2.78
F	批发和零售业	33,555,383.22	4.46
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	42,280,000.00	5.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,281,000.00	2.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	34,466,545.00	4.58
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	704,846,162.02	93.61

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002007	华兰生物	1,364,950	48,865,210.00	6.49

2	601689	拓普集团	1,379,878	44,970,224.02	5.97
3	002368	太极股份	1,400,000	42,280,000.00	5.62
4	002236	大华股份	2,109,500	33,688,715.00	4.47
5	600511	国药股份	1,000,000	33,540,000.00	4.45
6	002675	东诚药业	2,244,303	32,766,823.80	4.35
7	300363	博腾股份	1,761,189	32,000,804.13	4.25
8	603808	歌力思	1,000,000	31,680,000.00	4.21
9	000967	盈峰环境	1,999,989	30,779,830.71	4.09
10	002273	水晶光电	1,299,958	29,509,046.60	3.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参

与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	791,968.21
2	应收证券清算款	19,233,603.34
3	应收股利	-
4	应收利息	19,544.18
5	应收申购款	58,100.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,103,216.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002675	东诚药业	32,766,823.80	4.35	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	507,055,635.98	22.80
	其中：股票	507,055,635.98	22.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,239,463,194.40	55.72
	其中：债券	1,239,463,194.40	55.72
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	240,000,000.00	10.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	217,156,338.51	9.76
8	其他资产	20,601,171.79	0.93
9	合计	2,224,276,340.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	366,490,087.98	18.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	54,360,000.00	2.69
F	批发和零售业	-	-
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	56,591,548.00	2.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,504,000.00	0.92
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	11,110,000.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	507,055,635.98	25.11

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002366	台海核电	1,150,000	63,733,000.00	3.16
2	002368	太极股份	1,835,600	56,591,548.00	2.80
3	002482	广田集团	6,000,000	54,360,000.00	2.69
4	000070	特发信息	1,800,000	47,520,000.00	2.35
5	603808	歌力思	1,384,325	44,146,124.25	2.19
6	002007	华兰生物	999,956	35,798,424.80	1.77
7	300363	博腾股份	1,761,189	34,977,213.54	1.73
8	002675	东诚药业	2,244,303	32,093,532.90	1.59
9	002698	博实股份	2,000,000	31,320,000.00	1.55
10	300396	迪瑞医疗	664,400	25,061,168.00	1.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	639,778,194.40	31.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	599,685,000.00	29.70
	其中：政策性金融债	599,685,000.00	29.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,239,463,194.40	61.38

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	3,042,610	319,108,936.80	15.80
2	010303	03 国债(3)	3,029,240	306,680,257.60	15.19
3	160401	16 农发 01	2,000,000	200,000,000.00	9.90
4	160414	16 农发 14	2,000,000	199,720,000.00	9.89
5	160204	16 国开 04	1,500,000	149,970,000.00	7.43

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	536,922.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,064,248.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,601,171.79

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002675	东诚药业	32,093,532.90	1.59	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

转型后：

单位：份

基金合同生效日（2017 年 1 月 4 日）基金份额总额	2,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	475,448,869.64
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,706,444,447.43
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-12,166,226.51
报告期期末基金份额总额	756,838,195.70

转型前：

本基金转型前为封闭式基金，份额为 2,000,000,000.00 份，无基金份额变动。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）**

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,969,584.44
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,969,584.44
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.66

注：本基金由封闭式转为开放式，折算前基金管理人持有份额为 5,000,000.00 份，折算基准日折算比例为 0.993916887，折算后基金管理人持有份额为 4,969,584.44 份。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.3 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.25

7.4 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

备查文件目录

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳证券投资基金基金托管协议》。

中国证监会准予鸿阳证券投资基金变更注册的文件；

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

9.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2017 年 4 月 22 日