

宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金

金

2017 年第 2 季度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 7 月 19 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈科技 30 混合
基金主代码	000698
交易代码	000698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 13 日
报告期末基金份额总额	1,820,918,363.47 份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于以科技创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司

基金托管人	中国农业银行股份有限公司
-------	--------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年4月1日—2017年6月30日）
1. 本期已实现收益	-124,093,108.53
2. 本期利润	16,307,350.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0087
4. 期末基金资产净值	2,670,181,987.91
5. 期末基金份额净值	1.466

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

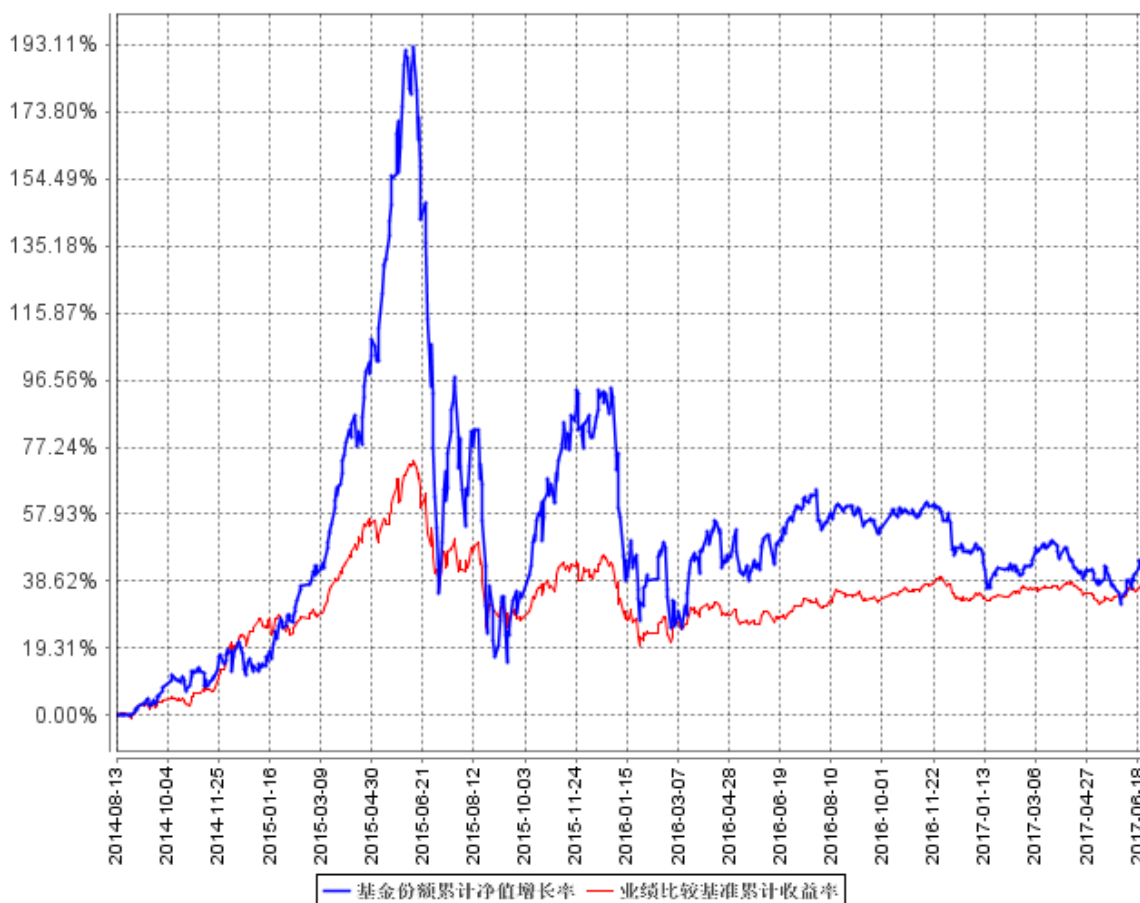
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.69%	1.02%	1.97%	0.40%	-1.28%	0.62%

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张仲维	本基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2016 年 9 月 21 日	-	7 年	张仲维先生，台湾政治大学国际贸易硕士。曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司国际部研究员、基金经理，华润元大基金管理有限公司研究员、基金经理；自 2015 年 5 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究

					部研究员、投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	--	--	--	--	------------------------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 2 季度，沪深 300 和创业板指的收益率分别为 6.1%、-4.68%。在金融监管去杠杆的大环境下，市场风险偏好降低。以大盘蓝筹为主的沪深 300 表现亮眼，而创业板指持续下跌，A 股纳入 MSCI 后或更加强化此趋势。行业上，稳健保守的白酒、家电行业表现良好，TMT 等成长股持续下跌。本基金主要投资 TMT 行业中高增长的公司，在报告期内微幅上涨 0.69%。

报告期内主要投资在四个方向：A. 苹果 iphone8 将带来两年的创新周期：iphone8 预计在 9 月份发布，前后玻璃机壳和不锈钢金属中框带来外观改变，更重要的是，全新的规格与功能将带来相关领域两年的成长期，主要包括：OLED 带来显示行业的设备投资高峰；双镜头和 3d sensing 将持续带动光学行业；无线充电行业即将爆发。

B. 特斯拉为首的新能源汽车行业带来的投资机会：特斯拉下半年将量产 model3，计划

2018 年 50 万辆、2020 年 100 万辆。海外主流车企都将新能源汽车列为重点发展方向，而国内 2020 年 200 万辆的产量目标在持续推进。新能源汽车和辅助驾驶的长期趋势带来汽车电子化的比例提高，因此看好的汽车电子部件增加包含：电子控制器、摄像头、传感器、电子仪表板、中控屏等。

C. 网络流量持续增长带来的投资机会：网络内容从文字转为视频化、视频观赏持续高清化、云计算等带来网络传输需求爆发，网络流量的持续高增长带来相关光通讯厂商投资机会。

D. 人工智能各行业应用落地：人工智能将深入我们生活各方面，带来相关的行业应用投资机会，如棋牌游戏、金融智能投顾、watson 医疗辅助、汽车无人驾驶、智能音响 echo 等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是 0.69%，同期业绩比较基准收益率是 1.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,298,702,269.60	85.32
	其中：股票	2,298,702,269.60	85.32
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	100,084,270.04	3.71
	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	281,254,456.48	10.44
8	其他资产	14,181,620.32	0.53
9	合计	2,694,222,616.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,038,002,222.48	76.32

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	160,175,834.55	6.00
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	-	-
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	100,524,212.57	3.76
S	综合	-	-
	合计	2,298,702,269.60	86.09

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	300450	先导智能	3,000,000	155,310,000.00	5.82
2	300252	金信诺	6,000,000	139,560,000.00	5.23
3	300097	智云股份	4,820,000	130,140,000.00	4.87
4	300567	精测电子	1,439,857	115,087,770.01	4.31
5	300308	中际装备	2,711,685	111,531,604.05	4.18
6	002833	弘亚数控	1,800,000	105,300,000.00	3.94
7	002773	康弘药业	1,900,000	99,370,000.00	3.72
8	002456	欧菲光	5,000,000	90,850,000.00	3.40
9	300367	东方网力	3,976,434	82,033,833.42	3.07
10	002273	水晶光电	3,900,000	80,457,000.00	3.01

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投资。

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投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

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	646,736.20
2	应收证券清算款	13,285,029.00

3	应收股利	-
4	应收利息	81,312.80
5	应收申购款	168,542.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,181,620.32

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	300252	金信诺	139,560,000.00	5.23	重大事项
2	300367	东方网力	82,033,833.42	3.07	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,912,705,821.06
报告期期间基金总申购份额	23,959,163.59
减：报告期期间基金总赎回份额	115,746,621.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,820,918,363.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

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

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

9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2017 年 7 月 19 日