

# 宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈中证 100 指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 8 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	152,469,957.68 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在基金合同规定的范围内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 100 指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术，适当参与金融衍生产品的投资。
业绩比较基准	中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
---------------------	-----------------

基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处
------------	--------------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	17,896,586.53	-3,282,245.83	60,370,860.56
本期利润	51,720,741.64	-4,266,405.73	9,633,028.49
加权平均基金份额本期利润	0.3512	-0.0605	0.0429
本期基金份额净值增长率	34.04%	-3.84%	-0.09%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1617	0.0386	0.0843
期末基金资产净值	220,324,603.83	81,901,829.27	79,770,378.93
期末基金份额净值	1.445	1.078	1.121

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

#### 3.2 基金净值表现

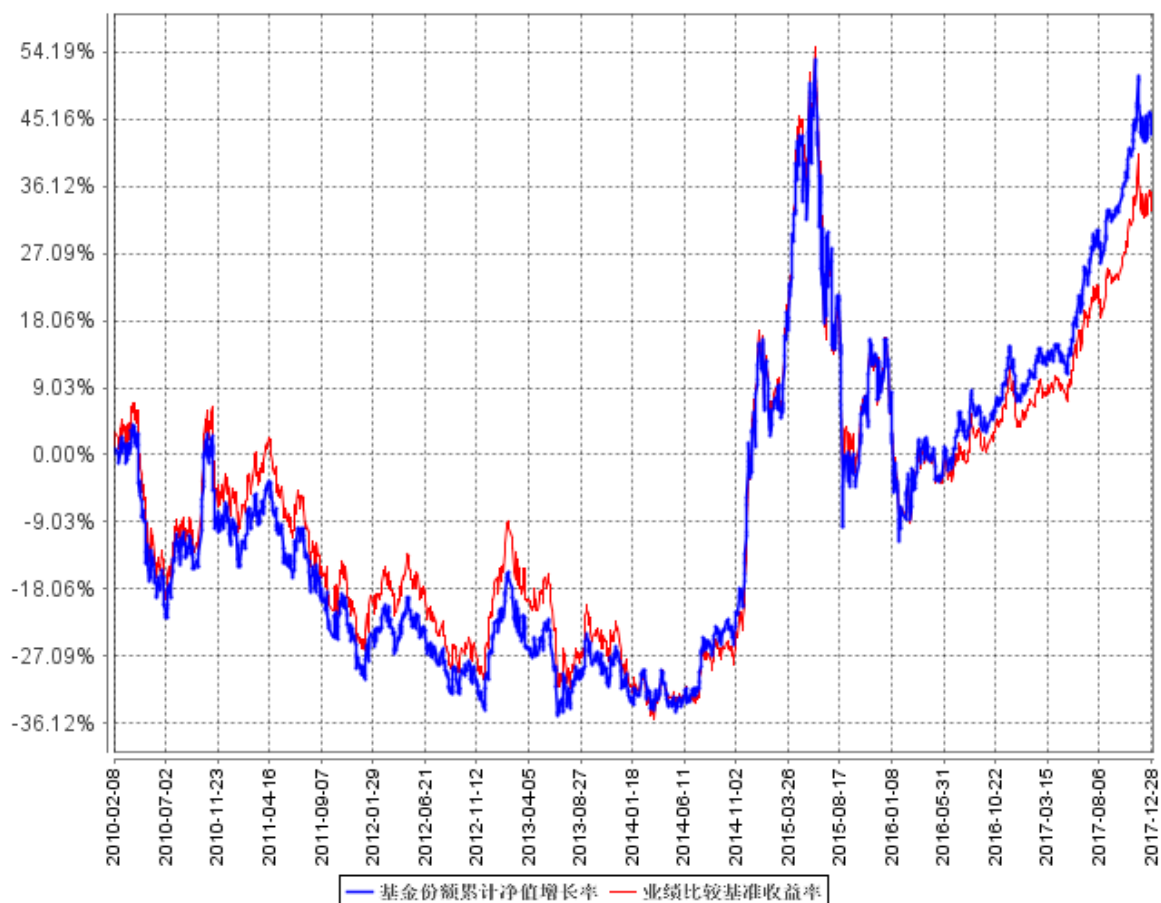
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	8.40%	0.87%	7.85%	0.86%	0.55%	0.01%
过去六个月	15.69%	0.74%	12.43%	0.73%	3.26%	0.01%
过去一年	34.04%	0.66%	28.56%	0.65%	5.48%	0.01%
过去三年	28.79%	1.57%	18.24%	1.56%	10.55%	0.01%
过去五年	86.69%	1.46%	61.76%	1.47%	24.93%	-0.01%

自基金合同 生效起至今	44.50%	1.39%	33.70%	1.41%	10.80%	-0.02%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

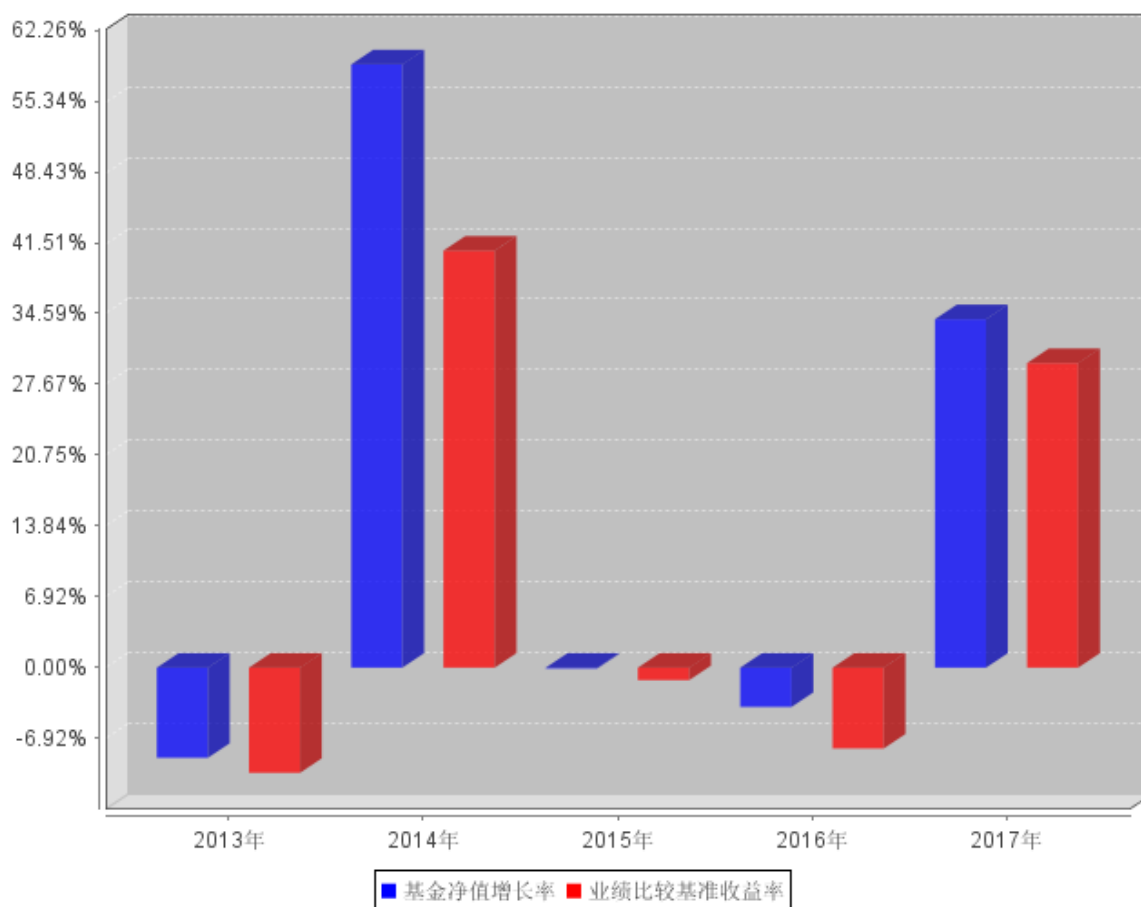
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

## § 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、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）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		
蔡丹	本基金基金经理	2017 年 8 月 5 日	-	7 年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
郭骁	本基金基金经理	2015 年 8 月 27 日	2017 年 8 月 17 日	5 年	郭骁先生，经济学硕士。2012 年 7 月起加入宝盈基金管理有限公司任金融工程部研究员，负责数量化选股、衍生品投资等量化策略研究。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

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 2017 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组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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



### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，A 股市场二八分化明显，大盘蓝筹走势强劲，创业板跌幅明显。从主要指数来看：中证 100 指数年内涨幅最大，达到 30.21%，上证 50 指数上涨 25.08%，沪深 300 指数上涨 21.78%，上证综指上涨 6.56%，中小板指上涨 16.73%，创业板指下跌 10.67%，中证 1000 指数下跌 17.35%。分行业来看，申万 28 个一级行业中仅有 11 个行业上涨，其中涨幅前五的行业有：食品饮料（涨 53.85%），家用电器（涨 43.03%），钢铁（涨 19.74%），非银金融（涨 17.3%），有色金属（涨 15.39%）；17 个行业下跌，跌幅前五的行业有：纺织服装（跌 23.85%）、传媒（跌 23.10%）、综合（跌 21.47%）、国防军工（跌 16.65%）和商业贸易（跌 13.6%）。

从 2015 年 6 月开始中证 500 相对中证 100 周线级别持续走弱，整体均线趋势持续向下，创业板于 2015 年 6 月进入周线级别下跌通道，2017 年中证 100 的风格优势非常明显，年内小盘相对大盘的风格优势曲线呈现三段式下跌结构：从年初持续回落到 7 月中下旬，之后创业板迎来一波反弹，直至 9 月下旬风格优势曲线小幅反弹，之后进入第三段下跌段，年底极端的二八分化使得小盘风格优势曲线再次快速回落。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子，构建多维度、多策略的选股体系。2017 年在成份股内构建了行业内增强策略，在实现主要风险因子中性的基础上，严格控制与基准指数的偏离度，通过增强策略来增强产品收益。此外，本基金还积极参与网下新股申购，通过打新来提供稳定的增强收益。

报告期内，本基金的股票仓位维持 94%左右的水平，在复制中证 100 指数成份股的基础上，配置了部分增强策略。本基金 2017 年单位净值增长率为 34.04%，相对基准超额收益为 5.48%，年化跟踪误差为 1.29%。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.445 元；本报告期基金份额净值增长率为 34.04%，业绩比较基准收益率为 28.56%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，随着中国资管新规正式稿后续落地，中国利率水平仍将维持高位震荡，债券市场难以形成趋势性机会，权益类资产在大类资产中仍具有比较优势。从股票市场内部结构来看，创业板剔除温氏、乐视 17 年报盈利增速 15.9%，截至 2018/2/22 创业板 PE（TTM）44.1 倍，

2015 年是 A 股市场并购的高峰年，随着 3 年业绩兑现期的到来，在高商誉、并购到期后的财务“洗澡”等制约下，创业板业绩中期仍较难改善。根据 wind 一致预期数据，截至 2018/2/22，创业板预期 PEG 在 1.33 倍，在主要指数中处于最高水平，而中证 100 指数的 PEG 在 0.87 倍，相对创业板估值优势明显。

中性的流动性环境下，中小创的估值水平偏高，盈利和估值匹配度较低，从技术层面看，当前小盘风格优势还处于周线下行通道中，目前还看不到任何拐点迹象，我们预计 2018 年中期风格难以切换，风格存在从一线蓝筹扩散到二线蓝筹的可能。后续随着养老金、机构资金入市比例的持续放大，基本面因子、质量因子和流动性因子都是持续关注的重点。

我们将严格按照基金合同的规定，在严格控制与基准指数偏离的基础上，依托我们的多维度选股策略体系，控制主要风险因子，运用数量化选股模型，构建增强部分投资组合，以增强产品业绩。我们将继续努力尽责地做好本基金的管理工作，尽力为投资者谋取较好的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。基金托管人根据法律法规要求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委员会，由公司投研、运营的分管领导及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部负责人共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20829 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,998,209.42	1,432,778.98
结算备付金	242,079.33	96,920.18

存出保证金	32,708.33	14,699.39
交易性金融资产	216,474,581.86	79,633,141.34
其中：股票投资	207,487,181.86	76,003,141.34
基金投资	-	-
债券投资	8,987,400.00	3,630,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	151,037.15	1,800,911.50
应收利息	224,370.56	70,568.62
应收股利	-	-
应收申购款	1,157,131.88	99,754.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	222,280,118.53	83,148,774.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	497,297.04	-
应付赎回款	1,060,736.17	925,642.11
应付管理人报酬	143,120.84	52,638.92
应付托管费	28,624.16	10,527.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	74,019.32	36,380.13

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	151,717.17	221,756.63
负债合计	1,955,514.70	1,246,945.57
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	152,469,957.68	76,010,760.38
未分配利润	67,854,646.15	5,891,068.89
所有者权益合计	220,324,603.83	81,901,829.27
负债和所有者权益总计	222,280,118.53	83,148,774.84

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.445 元，基金份额总额 152,469,957.68 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	54,372,246.49	-2,995,739.30
1. 利息收入	209,768.44	54,352.19
其中：存款利息收入	72,421.51	39,073.12
债券利息收入	137,346.93	11,231.77
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	4,047.30
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	20,039,945.19	-2,119,145.16
其中：股票投资收益	15,886,002.32	-3,775,552.55

基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,942.56	-793.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,162,885.43	1,657,200.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	33,824,155.11	-984,159.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	298,377.75	53,213.57
<b>减：二、费用</b>	<b>2,651,504.85</b>	<b>1,270,666.43</b>
1. 管理人报酬	1,378,528.25	540,580.81
2. 托管费	275,705.58	108,116.21
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	629,887.12	276,582.48
5. 利息支出	11,216.74	1,660.15
其中：卖出回购金融资产支出	11,216.74	1,660.15
6. 其他费用	356,167.16	343,726.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>51,720,741.64</b>	<b>-4,266,405.73</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>51,720,741.64</b>	<b>-4,266,405.73</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	76,010,760.38	5,891,068.89	81,901,829.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,720,741.64	51,720,741.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	76,459,197.30	10,242,835.62	86,702,032.92
其中：1. 基金申购款	282,203,000.48	64,701,488.11	346,904,488.59
2. 基金赎回款	-205,743,803.18	-54,458,652.49	-260,202,455.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 （净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	152,469,957.68	67,854,646.15	220,324,603.83
项目	上年度可比期间		
	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）	71,169,736.92	8,600,642.01	79,770,378.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,266,405.73	-4,266,405.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	4,841,023.46	1,556,832.61	6,397,856.07
其中：1. 基金申购款	52,832,836.47	2,961,751.95	55,794,588.42
2. 基金赎回款	-47,991,813.01	-1,404,919.34	-49,396,732.35

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	76,010,760.38	5,891,068.89	81,901,829.27

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：

张啸川                                      丁宁                                      何瑜  
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

#### 7.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券



的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司(以下简称“宝盈基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.5.2 关联方报酬

###### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	1,378,528.25	540,580.81
其中：支付销售机构的客户维护费	304,888.80	169,190.53

注：支付基金管理人宝盈基金公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	275,705.58	108,116.21

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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×0.15%/当年天数。

#### 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,998,209.42	64,267.95	1,432,778.98	36,933.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.6 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

##### 7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项	45.93	-	-	30,100	1,769,013.56	1,382,493.00	-
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大事项	37.94	-	-	25,000	948,745.00	948,500.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.59	-	-	17,000	421,972.84	248,030.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项	3.91	2018 年 1 月 24 日	13.80	56,000	987,116.30	218,960.00	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	临时停牌	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	临时停牌	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停

牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

##### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	207,487,181.86	93.34
	其中：股票	207,487,181.86	93.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,987,400.00	4.04
	其中：债券	8,987,400.00	4.04
	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	4,240,288.75	1.91
8	其他各项资产	1,565,247.92	0.70
9	合计	222,280,118.53	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	6,089,277.00	2.76
C	制造业	69,295,422.50	31.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,919,307.00	2.23
E	建筑业	8,511,568.00	3.86
F	批发和零售业	1,409,663.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	3,204,403.00	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,215,324.40	1.46
J	金融业	96,036,735.43	43.59
K	房地产业	9,684,250.00	4.40
L	租赁和商务服务业	1,587,660.80	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	937,296.00	0.43
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	1,382,493.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	206,273,400.13	93.62

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	683,692.02	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	253,072.55	0.11
J	金融业	210,608.00	0.10
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	32,323.20	0.01
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	1,213,781.73	0.55

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	290,490	20,328,490.20	9.23
2	600519	贵州茅台	13,400	9,346,366.00	4.24
3	600036	招商银行	280,600	8,143,012.00	3.70
4	000333	美的集团	118,750	6,582,312.50	2.99
5	601166	兴业银行	343,500	5,836,065.00	2.65
6	000651	格力电器	132,300	5,781,510.00	2.62
7	600016	民生银行	617,200	5,178,308.00	2.35
8	600887	伊利股份	155,700	5,011,983.00	2.27
9	601328	交通银行	758,900	4,712,769.00	2.14

10	601668	中国建筑	488,600	4,407,172.00	2.00
----	--------	------	---------	--------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司 <http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	17,000	248,030.00	0.11
2	300104	乐视网	56,000	218,960.00	0.10
3	601198	东兴证券	13,000	187,200.00	0.08
4	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.08
5	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
6	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
7	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
8	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
9	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
10	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司 <http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	15,376,757.71	18.77
2	600036	招商银行	9,321,702.79	11.38
3	600016	民生银行	8,890,093.00	10.85
4	000776	广发证券	7,182,954.30	8.77
5	000002	万科 A	6,657,790.00	8.13
6	600000	浦发银行	6,404,191.49	7.82

7	600519	贵州茅台	6,087,255.78	7.43
8	000001	平安银行	5,994,566.80	7.32
9	601601	中国太保	5,617,546.00	6.86
10	601328	交通银行	5,498,568.00	6.71
11	600837	海通证券	5,263,521.00	6.43
12	000651	格力电器	5,201,644.00	6.35
13	601668	中国建筑	5,176,237.00	6.32
14	601166	兴业银行	4,956,874.50	6.05
15	000333	美的集团	4,686,864.00	5.72
16	600030	中信证券	3,676,262.99	4.49
17	600887	伊利股份	3,542,180.64	4.32
18	601288	农业银行	3,508,013.00	4.28
19	601169	北京银行	3,433,375.41	4.19
20	000858	五粮液	3,334,489.80	4.07
21	000063	中兴通讯	3,044,222.00	3.72
22	000895	双汇发展	2,839,581.64	3.47
23	000625	长安汽车	2,813,553.00	3.44
24	600104	上汽集团	2,795,202.84	3.41
25	002024	苏宁易购	2,767,664.55	3.38
26	601186	中国铁建	2,720,492.00	3.32
27	601766	中国中车	2,717,091.00	3.32
28	601211	国泰君安	2,706,897.00	3.31
29	601398	工商银行	2,680,723.00	3.27
30	002415	海康威视	2,624,528.00	3.20
31	601988	中国银行	2,580,135.00	3.15
32	600900	长江电力	2,461,971.50	3.01
33	000725	京东方 A	2,320,632.00	2.83
34	002304	洋河股份	2,307,087.40	2.82



35	600276	恒瑞医药	2,263,920.41	2.76
36	601818	光大银行	2,197,461.00	2.68
37	600019	宝钢股份	2,157,902.00	2.63
38	300059	东方财富	2,074,106.16	2.53
39	600048	保利地产	2,063,480.00	2.52
40	000166	申万宏源	2,039,145.65	2.49
41	600028	中国石化	2,029,568.00	2.48
42	600585	海螺水泥	2,025,528.29	2.47
43	000027	深圳能源	1,999,937.20	2.44
44	601618	中国中冶	1,986,649.00	2.43
45	002736	国信证券	1,933,746.58	2.36
46	601989	中国重工	1,838,953.00	2.25
47	601688	华泰证券	1,758,092.00	2.15
48	600219	南山铝业	1,699,461.00	2.07

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601318	中国平安	9,534,261.00	11.64
2	000002	万科 A	6,313,731.12	7.71
3	600036	招商银行	6,175,016.97	7.54
4	000776	广发证券	5,868,283.30	7.17
5	600016	民生银行	5,699,637.00	6.96
6	000001	平安银行	5,036,031.37	6.15
7	601601	中国太保	4,213,038.18	5.14
8	600000	浦发银行	4,007,632.83	4.89
9	000063	中兴通讯	3,593,021.68	4.39

10	000651	格力电器	3,149,228.90	3.85
11	600837	海通证券	3,100,221.00	3.79
12	601328	交通银行	2,800,973.00	3.42
13	000895	双汇发展	2,572,112.00	3.14
14	000858	五粮液	2,549,670.00	3.11
15	000333	美的集团	2,532,529.53	3.09
16	600519	贵州茅台	2,513,236.27	3.07
17	601668	中国建筑	2,288,489.90	2.79
18	002024	苏宁易购	2,124,757.00	2.59
19	600030	中信证券	2,096,489.00	2.56
20	000027	深圳能源	2,055,243.69	2.51
21	601186	中国铁建	1,892,828.00	2.31
22	000625	长安汽车	1,876,991.00	2.29
23	601166	兴业银行	1,792,556.00	2.19
24	002013	中航机电	1,767,000.00	2.16
25	000039	中集集团	1,701,646.68	2.08
26	600887	伊利股份	1,673,881.00	2.04
27	601288	农业银行	1,656,028.00	2.02
28	601766	中国中车	1,649,234.00	2.01
29	002304	洋河股份	1,643,936.32	2.01

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	266,224,092.96
卖出股票收入（成交）总额	184,438,955.91

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	8,987,400.00	4.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	8,987,400.00	4.08

## 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	019557	17 国债 03	90,000	8,987,400.00	4.08

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,708.33
2	应收证券清算款	151,037.15
3	应收股利	-
4	应收利息	224,370.56
5	应收申购款	1,157,131.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,565,247.92

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	248,030.00	0.11	重大事项
2	300104	乐视网	218,960.00	0.10	重大事项

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,141	21,351.35	18,065,347.03	11.85%	134,404,610.65	88.15%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	24,559.65	0.0161%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 2 月 8 日) 基金份额总额	281,241,387.65
---------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	76,010,760.38
本报告期基金总申购份额	282,203,000.48
减:本报告期基金总赎回份额	205,743,803.18
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	152,469,957.68

## § 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) 根据宝盈基金管理有限公司第四届董事会第六次现场会议决议，同意张新元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，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(2) 根据宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十六次临时会议决议，同意汪钦辞去总经理职务，在新聘总经理聘任到位之前，暂由公司董事长李文众先生代为履行公司总经理相关职责。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报告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) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第一次现场会议决议，同意张啸川先生任宝盈基金管理有限公司总经理，丁宁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，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(4) 宝盈基金管理有限公司原独立董事贺颖奇、屈文洲先生任职届满，不再担任公司独立董事。根据宝盈基金管理有限公司股东会 2017 年第一次现场会议，同意张苏彤、廖振中和王艳艳担任宝盈基金管理有限公司独立董事，拟任公司总经理张啸川先生担任宝盈基金管理有限公司经营管理层董事，同意刘郁飞担任宝盈基金管理有限公司股东监事、魏玲玲和汪兀担任宝盈基金管理有限公司职工监事。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报告以及向中国证券投资基金业协会报备。

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：

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行股份有限公司发布公告，聘任纪伟为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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 50,000 元，目前事务所已连续 9 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

在本报告期内，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	
长江证券	1	267,600,392.42	60.08%	243,864.47	60.08%	-
华泰证券	1	177,803,839.60	39.92%	162,032.56	39.92%	-

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、本基金本报告期末租用和退租交易单元。

### 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
长江证券	38,766,888.60	100.00%	90,600,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司

2018年3月31日