

# 宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金 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	宝盈先进制造混合
基金主代码	000924
交易代码	000924
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 17 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	525,102,828.68 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于先进制造业上市公司的相关证券，力求把握先进制造业的发展契机，在严格控制风险的前提下，分享上市公司发展带来的投资收益，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。

	本基金所定义的先进制造业上市公司是指具有较高技术附加值、能够引领产业发展方向的制造业企业。 本基金将以中国证监会公布的《上市公司行业分类指引》中界定的制造业上市公司为基础，依照以上标准进行进一步筛选或增补。
业绩比较基准	申银万国制造业指数×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。

### 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	-58,192,337.86	67,480,258.10	511,612,554.58
本期利润	-19,730,832.20	-204,646,597.82	727,941,765.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0325	-0.2403	0.4349
本期基金份额净值增长率	-2.01%	-18.95%	40.42%
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	0.1234	0.1464	0.2181
期末基金资产净值	589,880,870.83	766,518,531.73	1,130,429,130.74
期末基金份额净值	1.123	1.146	1.414

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括份额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。

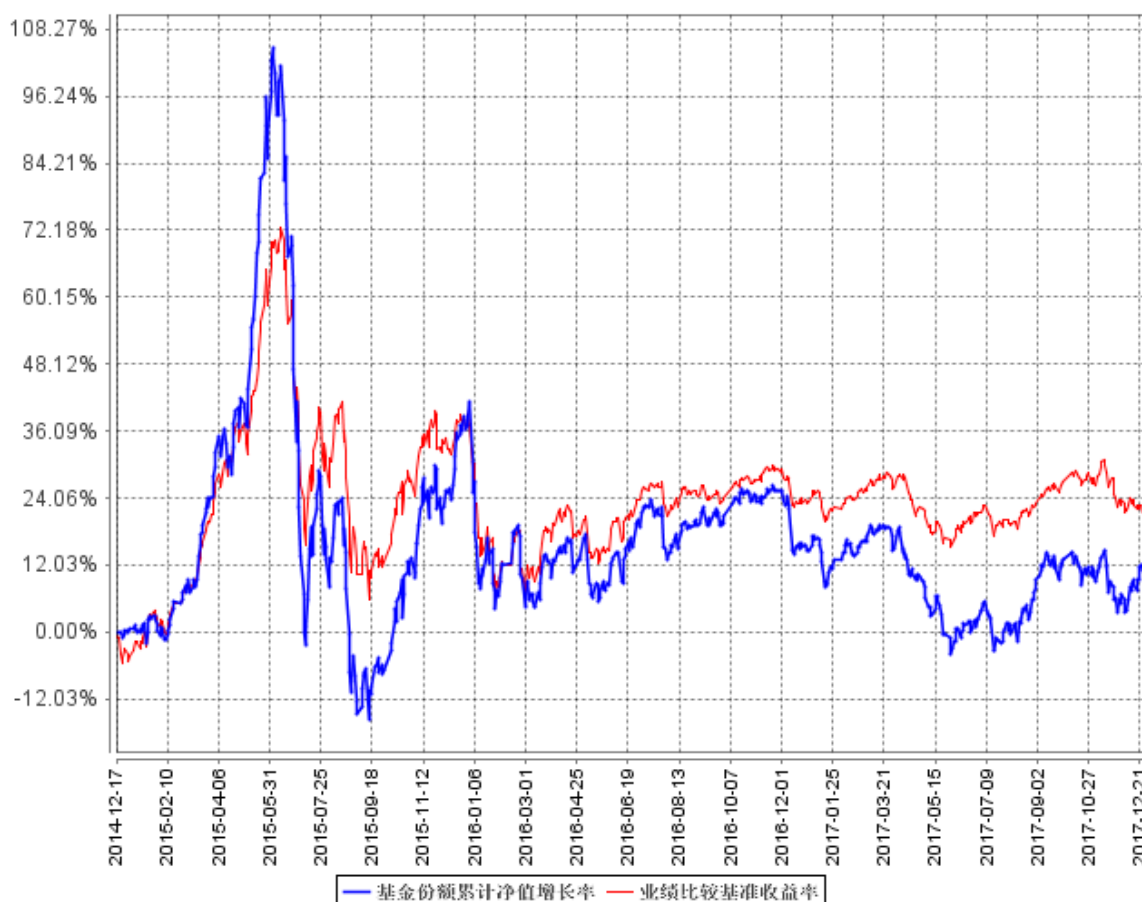
## 3.2 基金净值表现

### 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	-0.53%	1.30%	-3.71%	0.79%	3.18%	0.51%
过去六个月	9.78%	1.29%	0.88%	0.70%	8.90%	0.59%
过去一年	-2.01%	1.21%	-0.78%	0.68%	-1.23%	0.53%
过去三年	11.52%	2.09%	28.05%	1.46%	-16.53%	0.63%
自基金合同生效起至今	12.30%	2.07%	22.49%	1.46%	-10.19%	0.61%

### 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 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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

本基金未进行利润分配。

## §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		
李进	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017 年 12 月 15 日	-	7 年	李进先生，CFA，武汉大学金融学硕士。2007 年 7 月至 2010 年 2 月任职于中国农业银行深圳分行，2010 年 3 月至 2013 年 8 月任职于华泰联合证券研究所。2013 年 8 月，李进先生加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
李健伟	本基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017 年 1 月 25 日	-	6 年	李健伟先生，华南理工大学工学硕士。2007 年 8 月至 2010 年 4 月，在普华永道咨询有限公司任职高级顾问。2010 年 4 月至 2012 年 12 月，在广发证券股份有限公司任职稽核员、行业研究员。2012 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，先后任职研究部研究员、专户投资部投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
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、宝盈核心优势灵活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	2014 年 12 月 17 日	2017 年 1 月 26 日	10 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. 张小仁为首任基金经理，其“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2. 李进、李健伟均非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券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 年股票市场总体风险偏好较低，业绩确定性增长的股票总体表现不错，高估值的成长股总体表现偏弱。2017 年本基金下跌 2.01%，低于预期。

### 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 1.123 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.01%，业绩比较基准收益率为-0.78%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于对市场的判断和产业的发展趋势，2017 年年底本基金的配置主要集中在以下 3 个方向：

①环保。

②成长股：注重增速和估值的匹配，同时考虑稀缺性。集中配置的行业是：半导体、5G、智能制造、光伏等。

③受益于经济复苏的建材、房地产等。

## 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。

本报告期内，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 20836 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：宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	107,169,306.84	44,571,248.59

结算备付金	1,357,965.98	909,346.86
存出保证金	316,665.52	356,541.14
交易性金融资产	463,778,765.81	723,609,974.78
其中：股票投资	463,778,765.81	723,609,974.78
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	27,485,413.61	-
应收利息	30,761.57	12,957.01
应收股利	-	-
应收申购款	271,195.98	57,235.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	600,410,075.31	769,517,303.38
<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	7,115,617.11	-
应付赎回款	1,023,415.91	644,044.28
应付管理人报酬	731,815.57	1,102,818.51
应付托管费	121,969.28	183,803.05
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,376,038.05	817,296.67
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,348.56	250,809.14
负债合计	10,529,204.48	2,998,771.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	525,102,828.68	668,613,130.38
未分配利润	64,778,042.15	97,905,401.35
所有者权益合计	589,880,870.83	766,518,531.73
负债和所有者权益总计	600,410,075.31	769,517,303.38

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.123 元，基金份额总额 525,102,828.68 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>	1,249,587.74	-179,251,060.86
1. 利息收入	449,779.56	1,553,167.78
其中：存款利息收入	449,779.56	1,477,618.48
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	75,549.30
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-37,830,179.94	90,334,580.87
其中：股票投资收益	-41,158,838.06	88,335,113.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	3,328,658.12	1,999,467.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	38,461,505.66	-272,126,855.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	168,482.46	988,046.41
<b>减：二、费用</b>	20,980,419.94	25,395,536.96
1. 管理人报酬	9,972,387.47	14,918,258.46
2. 托管费	1,662,064.59	2,486,376.47
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,957,927.44	7,562,431.97
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	388,040.44	428,470.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-19,730,832.20	-204,646,597.82
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-19,730,832.20	-204,646,597.82

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金

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）	668,613,130.38	97,905,401.35	766,518,531.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,730,832.20	-19,730,832.20
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）	-143,510,301.70	-13,396,527.00	-156,906,828.70
其中：1. 基金申购款	55,044,382.43	5,484,814.08	60,529,196.51
2. 基金赎回款	-198,554,684.13	-18,881,341.08	-217,436,025.21
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）	525,102,828.68	64,778,042.15	589,880,870.83
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）	799,376,574.32	331,052,556.42	1,130,429,130.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-204,646,597.82	-204,646,597.82
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）	-130,763,443.94	-28,500,557.25	-159,264,001.19
其中：1. 基金申购款	303,486,193.58	47,325,628.71	350,811,822.29
2. 基金赎回款	-434,249,637.52	-75,826,185.96	-510,075,823.48
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）	668,613,130.38	97,905,401.35	766,518,531.73
-----------------	----------------	---------------	----------------

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 2016 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（“宝盈基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“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

无。

##### 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	9,972,387.47	14,918,258.46
其中：支付销售机构的客户维护费	4,115,473.24	5,301,968.84

注：支付基金管理人宝盈基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 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	1,662,064.59	2,486,376.47

注：支付基金托管人中国建设银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	11,428,000.00	11,428,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	11,428,000.00	11,428,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.18%	1.71%

#### 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

无。

### 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	107,169,306.84	407,184.77	44,571,248.59	1,432,843.81

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**

无。

**7.4.5.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**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
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项	6.67	2018年2月26日	7.28	720,000	5,833,394.00	4,802,400.00	-
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**

无。



## §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	463,778,765.81	77.24
	其中：股票	463,778,765.81	77.24
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	108,527,272.82	18.08
8	其他各项资产	28,104,036.68	4.68
9	合计	600,410,075.31	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	6,879,724.80	1.17
C	制造业	343,452,298.90	58.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
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	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,395,842.95	7.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	18,819,500.00	3.19
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	49,197,313.20	8.34
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	463,778,765.81	78.62

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300203	聚光科技	1,520,227	54,044,069.85	9.16
2	002573	清新环境	2,163,000	49,164,990.00	8.33
3	600388	龙净环保	2,585,400	44,727,420.00	7.58
4	600585	海螺水泥	1,299,928	38,126,888.24	6.46
5	300373	扬杰科技	1,114,907	33,413,762.79	5.66
6	002439	启明星辰	1,363,200	31,830,720.00	5.40
7	300308	中际旭创	407,500	23,838,750.00	4.04
8	601877	正泰电器	829,973	21,703,793.95	3.68
9	601012	隆基股份	550,000	20,042,000.00	3.40
10	600048	保利地产	1,330,000	18,819,500.00	3.19

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	002439	启明星辰	96,127,018.56	12.54
2	002637	赞宇科技	82,379,897.32	10.75
3	600388	龙净环保	74,747,324.12	9.75
4	002766	索菱股份	73,832,973.81	9.63
5	000063	中兴通讯	68,478,591.77	8.93
6	300588	熙菱信息	68,180,299.80	8.89
7	600985	雷鸣科化	67,825,462.81	8.85
8	300603	立昂技术	67,768,063.71	8.84
9	300203	聚光科技	63,310,702.33	8.26
10	300476	胜宏科技	62,229,826.66	8.12
11	300567	精测电子	55,259,219.67	7.21

12	000786	北新建材	55,208,694.11	7.20
13	002738	中矿资源	55,110,705.20	7.19
14	002573	清新环境	52,780,293.00	6.89
15	300308	中际旭创	49,833,694.11	6.50
16	300568	星源材质	48,481,873.13	6.32
17	300422	博世科	44,800,252.49	5.84
18	000612	焦作万方	43,819,752.56	5.72
19	300613	富瀚微	42,840,865.00	5.59
20	603186	华正新材	41,927,902.17	5.47
21	002045	国光电器	41,847,565.24	5.46
22	002709	天赐材料	41,055,065.62	5.36
23	600585	海螺水泥	38,786,468.72	5.06
24	300166	东方国信	36,115,573.97	4.71
25	600019	宝钢股份	34,501,009.27	4.50
26	600068	葛洲坝	34,484,841.44	4.50
27	603337	杰克股份	33,637,301.42	4.39
28	300322	硕贝德	33,532,521.58	4.37
29	002110	三钢闽光	33,521,917.96	4.37
30	300473	德尔股份	32,928,157.05	4.30
31	300373	扬杰科技	31,468,007.17	4.11
32	601688	华泰证券	29,956,573.23	3.91
33	300671	富满电子	26,409,877.22	3.45
34	002634	棒杰股份	25,117,196.78	3.28
35	300059	东方财富	24,762,824.49	3.23
36	300033	同花顺	24,562,219.81	3.20
37	603737	三棵树	23,578,344.88	3.08
38	603197	保隆科技	23,449,318.05	3.06
39	002402	和而泰	23,374,116.28	3.05
40	600498	烽火通信	23,150,688.23	3.02
41	603993	洛阳钼业	23,097,688.80	3.01
42	002850	科达利	22,884,158.04	2.99
43	600030	中信证券	22,878,174.39	2.98
44	601989	中国重工	22,846,540.00	2.98
45	300298	三诺生物	22,834,503.38	2.98
46	002343	慈文传媒	21,880,686.50	2.85
47	601877	正泰电器	21,832,476.18	2.85

48	601600	中国铝业	21,716,989.94	2.83
49	000630	铜陵有色	21,654,424.00	2.83
50	601012	隆基股份	20,861,380.08	2.72
51	000933	神火股份	20,699,130.60	2.70
52	002833	弘亚数控	20,482,343.95	2.67
53	603690	至纯科技	20,319,939.50	2.65
54	300296	利亚德	19,081,368.00	2.49
55	002368	太极股份	19,080,996.74	2.49
56	002222	福晶科技	18,665,350.60	2.44
57	300450	先导智能	18,376,601.84	2.40
58	600048	保利地产	18,042,981.00	2.35
59	300369	绿盟科技	17,996,499.96	2.35
60	600352	浙江龙盛	17,887,985.00	2.33
61	000768	中航飞机	17,175,377.00	2.24
62	000825	太钢不锈	16,498,302.50	2.15
63	300409	道氏技术	15,987,707.00	2.09
64	000980	众泰汽车	15,645,797.00	2.04
65	300316	晶盛机电	15,529,061.49	2.03
66	002831	裕同科技	15,362,554.83	2.00
67	600282	南钢股份	15,340,246.00	2.00
68	600038	中直股份	15,336,118.96	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	86,282,495.48	11.26
2	300476	胜宏科技	77,643,698.68	10.13
3	002766	索菱股份	71,479,729.27	9.33
4	002637	赞宇科技	71,141,575.88	9.28
5	002439	启明星辰	68,151,130.68	8.89
6	000070	特发信息	67,433,959.19	8.80
7	300588	熙菱信息	67,273,833.48	8.78
8	300567	精测电子	62,490,626.20	8.15
9	300603	立昂技术	61,333,714.00	8.00

10	600985	雷鸣科化	59,539,895.40	7.77
11	300316	晶盛机电	56,367,858.06	7.35
12	600682	南京新百	53,686,406.00	7.00
13	000786	北新建材	51,657,679.84	6.74
14	300342	天银机电	46,254,473.73	6.03
15	300613	富瀚微	45,342,307.00	5.92
16	300097	智云股份	43,105,843.82	5.62
17	000612	焦作万方	42,232,148.02	5.51
18	002045	国光电器	40,854,762.43	5.33
19	300568	星源材质	40,236,641.08	5.25
20	002110	三钢闽光	39,786,854.60	5.19
21	603337	杰克股份	39,213,729.74	5.12
22	600038	中直股份	38,231,237.39	4.99
23	002709	天赐材料	38,197,124.41	4.98
24	300422	博世科	37,778,727.88	4.93
25	000980	众泰汽车	36,031,934.14	4.70
26	002738	中矿资源	35,628,201.15	4.65
27	002733	雄韬股份	35,500,273.89	4.63
28	603186	华正新材	35,125,181.45	4.58
29	300166	东方国信	34,672,158.86	4.52
30	300322	硕贝德	34,333,290.79	4.48
31	300308	中际旭创	34,329,271.70	4.48
32	002368	太极股份	34,141,355.08	4.45
33	300228	富瑞特装	33,287,008.61	4.34
34	600068	葛洲坝	33,136,729.57	4.32
35	002023	海特高新	31,428,191.91	4.10
36	600019	宝钢股份	30,874,135.12	4.03
37	600388	龙净环保	29,681,799.08	3.87
38	002634	棒杰股份	29,434,442.56	3.84
39	601688	华泰证券	29,282,207.45	3.82
40	300455	康拓红外	28,247,720.23	3.69
41	600693	东百集团	27,747,521.40	3.62
42	300143	星普医科	27,507,613.33	3.59
43	600529	山东药玻	25,529,868.73	3.33
44	300325	德威新材	24,307,368.30	3.17
45	600498	烽火通信	24,153,454.85	3.15
46	600030	中信证券	23,653,874.00	3.09
47	300473	德尔股份	23,179,660.51	3.02

48	601600	中国铝业	22,968,767.98	3.00
49	300059	东方财富	22,739,801.28	2.97
50	300298	三诺生物	22,671,436.26	2.96
51	002402	和而泰	22,502,928.40	2.94
52	300450	先导智能	22,470,051.21	2.93
53	000049	德赛电池	22,364,666.07	2.92
54	300033	同花顺	21,976,812.41	2.87
55	002850	科达利	21,945,446.64	2.86
56	601989	中国重工	21,677,215.00	2.83
57	603737	三棵树	20,993,614.14	2.74
58	600338	西藏珠峰	20,696,417.21	2.70
59	002343	慈文传媒	20,603,383.40	2.69
60	002222	福晶科技	20,556,897.00	2.68
61	002812	创新股份	20,146,114.08	2.63
62	000933	神火股份	19,114,539.12	2.49
63	300296	利亚德	18,442,252.00	2.41
64	002712	思美传媒	18,275,254.90	2.38
65	000630	铜陵有色	18,016,738.00	2.35
66	000825	太钢不锈	16,703,688.00	2.18
67	603993	洛阳钼业	16,568,142.00	2.16
68	002434	万里扬	16,060,456.32	2.10
69	000768	中航飞机	15,560,055.46	2.03

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	2,816,272,776.54
卖出股票收入（成交）总额	3,073,406,653.11

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**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	316,665.52
2	应收证券清算款	27,485,413.61
3	应收股利	-

4	应收利息	30,761.57
5	应收申购款	271,195.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,104,036.68

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
20,892	25,134.16	11,428,000.00	2.18%	513,674,828.68	97.82%

#### 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	4,125.27	0.0008%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年12月17日）基金份额总额	4,257,052,685.91
本报告期期初基金份额总额	668,613,130.38
本报告期基金总申购份额	55,044,382.43



减:本报告期基金总赎回份额	198,554,684.13
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	525,102,828.68

## § 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。

(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 60,000 元，目前事务所为第 3 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	
中金公司	2	1,305,547,278.24	22.19%	1,189,747.37	22.19%	-
招商证券	1	711,040,573.29	12.08%	647,967.76	12.08%	-
东北证券	1	690,696,909.41	11.74%	629,434.12	11.74%	-
万和证券	1	688,341,650.52	11.70%	627,286.26	11.70%	-
国信证券	1	673,942,983.31	11.45%	614,163.97	11.45%	-
广发证券	2	631,231,266.19	10.73%	575,241.75	10.73%	-
兴业证券	2	225,725,716.84	3.84%	205,705.24	3.84%	-
国金证券	2	198,893,925.25	3.38%	181,251.70	3.38%	-
华泰证券	1	197,482,636.99	3.36%	179,965.30	3.36%	-
东吴证券	1	156,890,875.54	2.67%	142,974.15	2.67%	-
平安证券	1	109,170,581.75	1.86%	99,487.51	1.86%	-

国泰君安	2	106,482,004.39	1.81%	97,037.07	1.81%	-
财通证券	2	106,228,052.20	1.81%	96,807.99	1.81%	-
东方证券	2	82,783,227.38	1.41%	75,441.92	1.41%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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。

2、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。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

- (1) 本报告期内新租万和证券深圳交易单元一个。新租财通证券上海、深圳交易单元各一个。  
新租中信建投证券上海、深圳交易单元各一个。新租西南证券上海交易单元一个。
- (2) 本报告期内退租首创证券上海、深圳交易单元各一个。

**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**  
无。

宝盈基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日