

宝盈国家安全战略沪港深股票型
证券投资基金
2017 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 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 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。

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53

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	53
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	53
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12	投资组合报告附注	54
§9	基金份额持有人信息	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§10	开放式基金份额变动	56
§11	重大事件揭示	57
11.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4	基金投资策略的改变	58
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8	其他重大事件	59
§12	影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1	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	65
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§13	备查文件目录	66
13.1	备查文件目录	66
13.2	存放地点	66
13.3	查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金
基金简称	宝盈国家安全沪港深股票
基金主代码	001877
交易代码	001877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 20 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	107,082,961.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
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和金融衍生品投资策略四部分组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>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，并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服务；（3）信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。</p> <p>（三）固定收益类资产投资策略</p>

	<p>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、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略，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>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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。</p> <p>本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p>

注：根据深圳证监局发布的《深圳证监局关于参与港股通交易相关事项的通知》（深证局机构字[2017]80 号，以下简称“《通知》”）的规定，2017 年 7 月 12 日，我司发布《宝盈基金管理有限公司关于修改旗下沪港深基金法律文件的公告》，调整本基金相关法律文件。其中根据《通知》要求对于基金名称带有“沪港深”等类似字样且港股投资比例下限为零的股票型及混合型基金，基金管理人应当在基金合同、招募说明书的显著位置进行特别风险揭示，修改了本基金合同中产品风险收益特征。

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一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518034	100818
法定代表人		李文众	陈四清

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）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 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 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	2017 年	2016 年 1 月 20 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-39,002,832.61	37,331,743.88
本期利润	-25,192,980.91	24,583,216.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1839	0.1163
本期加权平均净值利润率	-18.38%	10.64%
本期基金份额净值增长率	-15.71%	11.40%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-6,516,332.90	18,262,747.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0609	0.1143
期末基金资产净值	100,566,628.92	177,987,270.80
期末基金份额净值	0.939	1.114
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-6.10%	11.40%

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、期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

3、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。

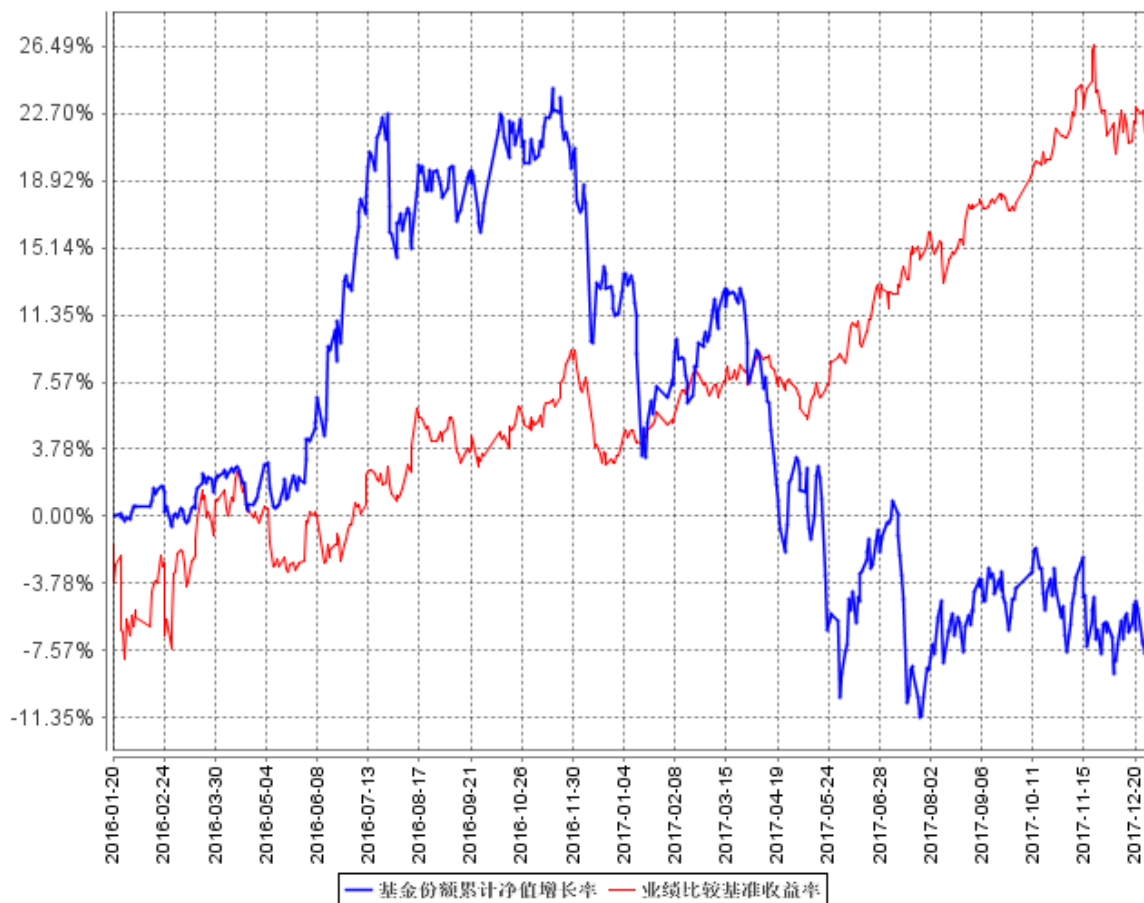
3.2 基金净值表现

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	-2.09%	1.18%	4.28%	0.61%	-6.37%	0.57%
过去六个月	-4.96%	1.21%	8.73%	0.53%	-13.69%	0.68%
过去一年	-15.71%	1.24%	18.67%	0.48%	-34.38%	0.76%
自基金合同生效起至今	-6.10%	1.13%	22.73%	0.70%	-28.83%	0.43%

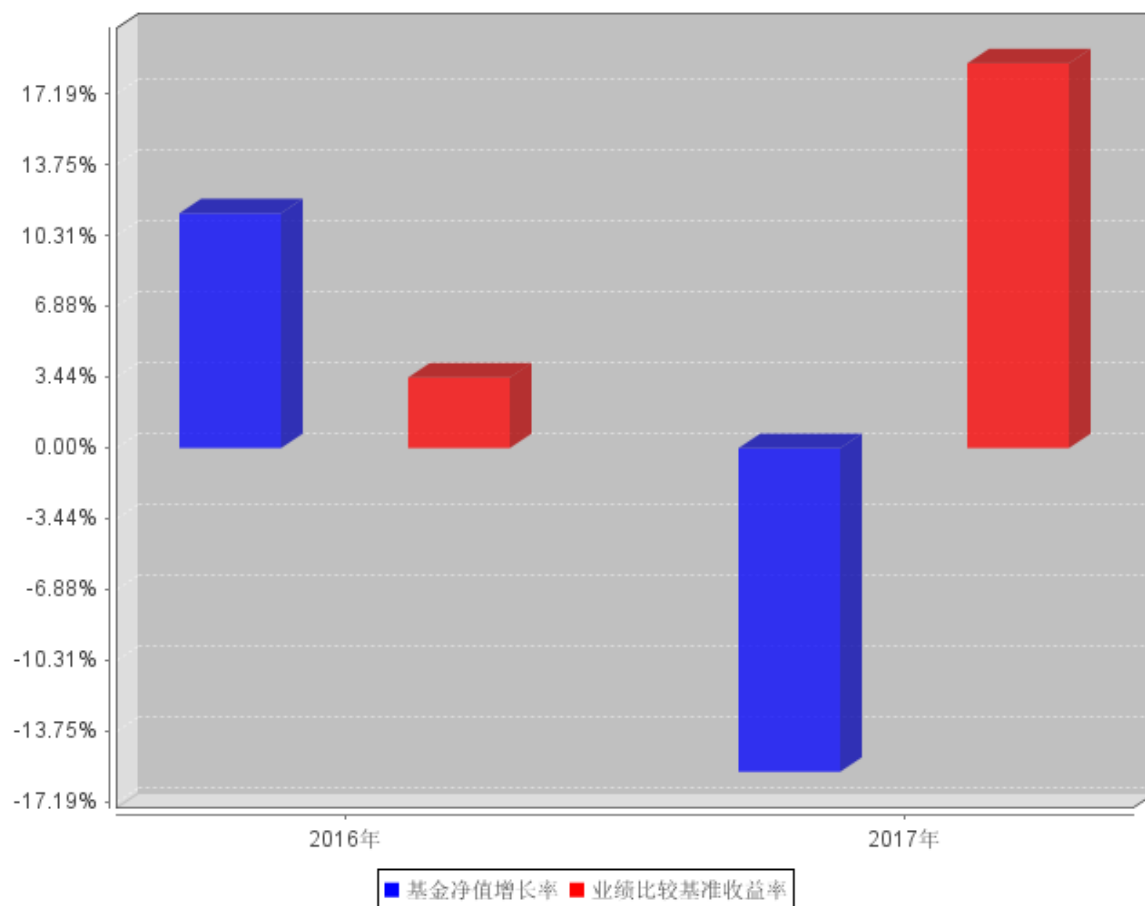
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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		
易祚兴	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理	2016 年 6 月 30 日	-	6 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；宝盈核心优势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、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。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	2016 年 1 月 20	2017 年 3 月 8	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

	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、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理	日	日		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、易祚兴为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、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。

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 年市场整体向好，上证综指、深证成指和沪深 300 分别录得 6.56%、8.48%和 21.78%的涨幅，中小板指涨 16.73%，惟创业板指较为疲软，全年震荡下跌 10.67%。

本基金管理人认为造成 2017 年优质大盘蓝筹股连续上涨，高估值小市值股票连续下跌的原因主要有以下几点：1、货币偏紧环境、定增解禁高峰、金融去杠杆等使得市场处于存量博弈过程，亏损股、概念股在缺少流动性的情况下很难翻身；2、监管趋严、制度完善以及定增、重组规则的改变使得伪成长股被一一证伪；3、优质蓝筹估值低、盈利反转，迎来戴维斯双击，具备更好的投资价值；4、海、内外机构投资者影响力不断加强，价值投资理念被愈发认可。

对于本轮蓝筹行情的本质，本基金管理人认为并非市场所谓的风格切换，而是实实在在的基本面改善驱动。在需求端，经济复苏，人均可支配收入上升，GDP 超预期，地产财富效应等使得居民消费不断升级，对于品牌、品质的要求更高，而优质的龙头具备更优的产品，更好的品牌，更强的研发，从而可以更好的满足消费者的需求。在供给端，通过供给侧改革，实体去杠杆等驱使大多数行业洗牌，落后产能被淘汰，行业龙头在市场份额、利润水平等方面都得到大幅提升，马太效应出现，再加上技术升级，龙头企业的优势不断扩大，定价能力更加突出，在规模已经很大的情况下业绩依然可以不断超预期，出现了大象起舞的现象。相信未来这一趋势仍将延续，优质的中国龙头公司将继续扩张，成为世界级的优质资产。

本基金管理人根据这一趋势对持仓做了较大的调整，主要集中在 TMT、军工、新能源、汽车电子行业的龙头公司。

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 0.939 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.71%，业绩比较基准收益率为 18.67%。

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，本基金管理人认为宏观方面，经济复苏的趋势没有改变，金融去杠杆、供给侧改革持续将会带来长远的经济基本面的结构性利好，但短期会有一些扰动，带来波动率会上升。市场方面，上证指数估值合理，盈利增长确定，优质蓝筹行情没有结束，各个产业强者恒强的趋势持续中，高估值小盘股和题材股会继续下跌。制度方面，十九大提出的核心矛盾、开放市场、回归实业本质、两地互通、大湾区等举措会给各行业带来新的活力。行业方面，移动互联网相关技术的继续深化和普及仍然是大机会，科技与传统行业的结合也会产生颠覆性改变，在 TMT、新能源、军工、AI、大数据等领域会有更多创新的产品面世。

本基金管理人也将围绕上述领域，重点关注、跟踪具备核心竞争优势、业绩确定且估值合理的龙头优质公司，努力为持有人获取较好的收益。

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投资监控、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。

4.8 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。

4.9 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”）在宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（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(2018)第 20843 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	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金(以下简称“宝盈国家安全战略沪港深基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了宝盈国家安全战略沪港深基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于宝盈国家安全战略沪港深基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>宝盈国家安全战略沪港深基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估宝盈国家安全战略沪港深基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算宝盈国家安全战略沪港深基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督宝盈国家安全战略沪港深基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水

	<p>平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对宝盈国家安全战略沪港深基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致宝盈国家安全战略沪港深基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	薛竞 罗佳
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2018 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	11,296,439.94	8,505,418.49
结算备付金		264,949.37	1,927,274.83
存出保证金		94,771.53	176,450.43
交易性金融资产	7.4.7.2	90,613,315.41	168,285,416.77
其中：股票投资		90,542,447.41	168,212,189.77
基金投资		-	-
债券投资		70,868.00	73,227.00
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		-	3,125,019.05
应收利息	7.4.7.5	6,830.59	7,302.05
应收股利		-	-
应收申购款		34,448.95	206,177.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		102,310,755.79	182,233,058.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		2.55	1,873,739.98
应付赎回款		1,303,377.74	929,617.91
应付管理人报酬		130,454.81	233,469.65
应付托管费		21,742.48	38,911.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	127,444.22	1,053,932.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	161,105.07	116,116.49
负债合计		1,744,126.87	4,245,787.84
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	107,082,961.82	159,724,523.33
未分配利润	7.4.7.10	-6,516,332.90	18,262,747.47
所有者权益合计		100,566,628.92	177,987,270.80
负债和所有者权益总计		102,310,755.79	182,233,058.64

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.939 元，基金份额总额 107,082,961.82 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

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	附注号	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 20 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-19,043,841.00	34,029,040.64
1. 利息收入		112,709.49	867,939.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	108,621.49	644,308.47
债券利息收入		4,088.00	1,769.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	221,861.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-33,320,691.50	44,186,005.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-33,642,632.27	43,793,775.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	321,940.77	392,230.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,809,851.70	-12,748,527.49
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	354,289.31	1,723,622.93
减：二、费用		6,149,139.91	9,445,824.25
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,066,984.42	3,288,087.14
2. 托管费	7.4.10.2.2	344,497.36	548,014.58
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	3,362,191.04	5,267,804.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	375,467.09	341,918.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,192,980.91	24,583,216.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,192,980.91	24,583,216.39

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

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）	159,724,523.33	18,262,747.47	177,987,270.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-25,192,980.91	-25,192,980.91
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）	-52,641,561.51	413,900.54	-52,227,660.97
其中：1. 基金申购款	83,456,288.28	-401,445.56	83,054,842.72
2. 基金赎回款	-136,097,849.79	815,346.10	-135,282,503.69
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）	107,082,961.82	-6,516,332.90	100,566,628.92
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 20 日（基金合同生效日）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）	291,448,737.30	-	291,448,737.30

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,583,216.39	24,583,216.39
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）	-131,724,213.97	-6,320,468.92	-138,044,682.89
其中：1. 基金申购款	296,183,519.64	46,358,847.76	342,542,367.40
2. 基金赎回款	-427,907,733.61	-52,679,316.68	-480,587,050.29
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）	159,724,523.33	18,262,747.47	177,987,270.80

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 基金基本情况

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金(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”)监许可[2015]1995号《关于准予宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的批复》,由宝盈基金管理有限公司根据经批准的《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》和《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金招募说明书》向社会公开募集。募集期结束经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并出具普华永道中天验字(2016)第075号验资报告。经向中国证监会备案,《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》于2016年1月20日正式生效。本基金为契约开放式,存续期限不定。本基金募集期间为2015年12月21日至2016年1月15日止,首次发售募集有效认购金额为人民币291,375,943.50元,折合291,375,943.50份基金份额;有效资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币72,793.80元,折合72,793.80份基金份额;以上收到的资金共计人民币291,448,737.30元,折合291,448,737.30份基金份额。本基金管理人为宝盈基金管理有限公司,注册登记机构为本基金管理人,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》、《宝盈国家安全战略沪港深股票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具有较好流动性的金融工具,包括:本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中

国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:股票(包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票)投资占基金资产的比例不低于 80%,其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%,投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持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%;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%;本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 65%+恒生综合指数收益率 \times 15%+中债综合指数收益率 \times 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

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》、《宝盈国家安全战略沪港深股票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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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。比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资和权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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或资产支持证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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资和权证投资)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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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和托管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

每一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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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[2017]13号《中国证监会关于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）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	11,296,439.94	8,505,418.49
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	11,296,439.94	8,505,418.49

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	89,476,373.20	90,542,447.41	1,066,074.21	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	75,618.00	70,868.00	-4,750.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	75,618.00	70,868.00	-4,750.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	89,551,991.20	90,613,315.41	1,061,324.21	
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	180,958,326.26	168,212,189.77	-12,746,136.49	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	75,618.00	73,227.00	-2,391.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	75,618.00	73,227.00	-2,391.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	181,033,944.26	168,285,416.77	-12,748,527.49	

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	2,586.79	2,195.08
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	131.23	954.03
应收债券利息	4,065.60	4,065.60
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	46.97	87.34
合计	6,830.59	7,302.05

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	127,444.22	1,053,932.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	127,444.22	1,053,932.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
预提费用	160,000.00	115,000.00

应付手续费	1,105.07	1,116.49
合计	161,105.07	116,116.49

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	159,724,523.33	159,724,523.33
本期申购	83,456,288.28	83,456,288.28
本期赎回（以“-”号填列）	-136,097,849.79	-136,097,849.79
本期末	107,082,961.82	107,082,961.82

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,901,247.23	-17,638,499.76	18,262,747.47
本期利润	-39,002,832.61	13,809,851.70	-25,192,980.91
本期基金份额交易产生的变动数	-1,210,507.14	1,624,407.68	413,900.54
其中：基金申购款	4,301,148.02	-4,702,593.58	-401,445.56
基金赎回款	-5,511,655.16	6,327,001.26	815,346.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,312,092.52	-2,204,240.38	-6,516,332.90

7.4.7.11 存款利息收入

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20日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
	活期存款利息收入	85,533.18
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	20,373.21	28,227.48
其他	2,715.10	3,572.61
合计	108,621.49	644,308.47

7.4.7.12 股票投资收益

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20日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日
卖出股票成交总额	1,123,486,808.23	1,711,042,181.39
减：卖出股票成本总额	1,157,129,440.50	1,667,248,405.83
买卖股票差价收入	-33,642,632.27	43,793,775.56

7.4.7.13 债券投资收益

无。

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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月20日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	321,940.77	392,230.06
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	321,940.77	392,230.06

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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20日(基金合同 生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	13,809,851.70	-12,748,527.49
——股票投资	13,812,210.70	-12,746,136.49
——债券投资	-2,359.00	-2,391.00
——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	13,809,851.70	-12,748,527.49

7.4.7.18 其他收入

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20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	306,874.58	1,666,112.94
基金转换费收入	47,414.73	57,509.99
合计	354,289.31	1,723,622.93

7.4.7.19 交易费用

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20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	3,362,191.04	5,267,804.00
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,362,191.04	5,267,804.00

7.4.7.20 其他费用

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20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	270,000.00
银行汇划费用	15,467.09	21,918.53
合计	375,467.09	341,918.53

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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须披露的资产负债表日后事项。

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”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

基金公司”)	
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

本基金本报告期内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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,066,984.42	3,288,087.14
其中：支付销售机构的客户维护费	1,020,541.25	1,465,662.04

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 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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

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20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	344,497.36	548,014.58

注：支付基金托管人中国银行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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月20日(基金合同生效日)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
中国银行	11,296,439.94	85,533.18	8,505,418.49	612,508.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017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

无。

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	856,700	4,889,490.00	5,714,189.00	-

600903	贵州燃气	2017年12月28日	临时停牌	16.86	2018年1月2日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
--------	------	-------------	------	-------	-----------	-------	-------	----------	-----------	---

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。

7.4.12.3 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

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

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(包括港股通标的股票)、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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行，与该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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。（2016 年 12 月 31 日：同）。

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。

于 2017 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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	11,296,439.94	-	-	-	11,296,439.94
结算备付金	264,949.37	-	-	-	264,949.37
存出保证金	94,771.53	-	-	-	94,771.53
交易性金融资产	-	70,868.00	-	90,542,447.41	90,613,315.41
应收利息	-	-	-	6,830.59	6,830.59
应收申购款	-	-	-	34,448.95	34,448.95
资产总计	11,656,160.84	70,868.00	-	90,583,726.95	102,310,755.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2.55	2.55
应付赎回款	-	-	-	1,303,377.74	1,303,377.74
应付管理人报酬	-	-	-	130,454.81	130,454.81
应付托管费	-	-	-	21,742.48	21,742.48
应付交易费用	-	-	-	127,444.22	127,444.22
其他负债	-	-	-	161,105.07	161,105.07
负债总计	-	-	-	1,744,126.87	1,744,126.87
利率敏感度缺口	11,656,160.84	70,868.00	-	88,839,600.08	100,566,628.92
上年度末 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	8,505,418.49	-	-	-	8,505,418.49
结算备付金	1,927,274.83	-	-	-	1,927,274.83
存出保证金	176,450.43	-	-	-	176,450.43
交易性金融资产	-	73,227.00	-	168,212,189.77	168,285,416.77
应收证券清算款	-	-	-	3,125,019.05	3,125,019.05
应收利息	-	-	-	7,302.05	7,302.05
应收申购款	-	-	-	206,177.02	206,177.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,609,143.75	73,227.00	-	171,550,687.89	182,233,058.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,873,739.98	1,873,739.98
应付赎回款	-	-	-	929,617.91	929,617.91
应付管理人报酬	-	-	-	233,469.65	233,469.65

应付托管费	-	-	-	38,911.58	38,911.58
应付交易费用	-	-	-	1,053,932.23	1,053,932.23
其他负债	-	-	-	116,116.49	116,116.49
负债总计	-	-	-	4,245,787.84	4,245,787.84
利率敏感度缺口	10,609,143.75	73,227.00	-	167,304,900.05	177,987,270.80

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

于 2017 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 0.07% (2016 年 12 月 31 日：0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2016 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	12,157,725.81	-	12,157,725.81
资产合计	-	12,157,725.81	-	12,157,725.81
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,157,725.81	-	12,157,725.81
项目	上年度末			
	2016 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，基金持有不以记账本位币计价资产的公允价值占基金资产净值的比例为 12.09% (2016 年 12 月 31 日：无)，因此外汇汇率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2016 年 12 月 31 日：同)。

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，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，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港 (港股通标的股票) 两地股票配置比例；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 (包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票) 投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，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%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	90,542,447.41	90.03	168,212,189.77	94.51
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	90,542,447.41	90.03	168,212,189.77	94.51

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,716,264.03	2,973,387.00
沪深 300 指数下降 5%	-2,716,264.03	-2,973,387.00	

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 2017 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 84,762,032.33 元，属于第二层次的余额为 5,851,283.08 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 148,136,620.86 元，第二层次 20,148,795.91 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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	90,542,447.41	88.50
	其中：股票	90,542,447.41	88.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,868.00	0.07
	其中：债券	70,868.00	0.07
	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	11,561,389.31	11.30
8	其他各项资产	136,051.07	0.13
9	合计	102,310,755.79	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	74,754,161.52	74.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,872.64	0.10
E	建筑业	546.00	0.00
F	批发和零售业	34,141.44	0.03
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	-	-
J	金融业	3,499,000.00	3.48
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,384,721.60	77.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	5,681,095.13	5.65
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	6,476,630.68	6.44
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	12,157,725.81	12.09

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

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	600038	中直股份	201,000	9,352,530.00	9.30
2	601233	桐昆股份	367,190	8,258,103.10	8.21
3	000768	中航飞机	400,100	6,757,689.00	6.72
4	002050	三花智控	354,700	6,505,198.00	6.47
5	03888	金山软件	298,000	6,476,630.68	6.44
6	601600	中国铝业	856,700	5,714,189.00	5.68
7	300447	全信股份	302,880	5,703,230.40	5.67
8	01316	耐世特	365,000	5,681,095.13	5.65
9	600893	航发动力	193,500	5,207,085.00	5.18
10	600990	四创电子	78,700	4,571,683.00	4.55
11	300487	蓝晓科技	259,150	4,410,733.00	4.39
12	601318	中国平安	50,000	3,499,000.00	3.48
13	600372	中航电子	227,900	3,119,951.00	3.10
14	300604	长川科技	50,000	3,100,000.00	3.08
15	300567	精测电子	23,000	3,066,820.00	3.05

16	002025	航天电器	119,800	2,703,886.00	2.69
17	300136	信维通信	40,000	2,028,000.00	2.02
18	600416	湘电股份	160,000	1,998,400.00	1.99
19	300097	智云股份	59,960	1,702,864.00	1.69
20	600903	贵州燃气	3,928	66,226.08	0.07
21	603055	台华新材	2,658	44,441.76	0.04
22	603937	丽岛新材	1,662	43,610.88	0.04
23	603083	剑桥科技	877	41,473.33	0.04
24	603278	大业股份	1,624	37,498.16	0.04
25	603912	佳力图	1,226	34,609.98	0.03
26	603970	中农立华	1,046	34,141.44	0.03
27	603378	亚士创能	1,465	33,519.20	0.03
28	603856	东宏股份	1,619	33,302.83	0.03
29	603507	振江股份	819	32,923.80	0.03
30	603809	豪能股份	900	32,436.00	0.03
31	603848	好太太	1,377	31,244.13	0.03
32	002893	华通热力	1,176	30,646.56	0.03
33	603289	泰瑞机器	1,596	30,403.80	0.03
34	603607	京华激光	734	29,873.80	0.03
35	603722	阿科力	707	27,954.78	0.03
36	603829	洛凯股份	1,281	23,160.48	0.02
37	603683	晶华新材	1,095	22,776.00	0.02
38	603110	东方材料	847	22,420.09	0.02
39	603499	翔港科技	812	20,097.00	0.02
40	000423	东阿阿胶	200	12,054.00	0.01
41	000065	北方国际	30	546.00	0.00

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	300613	富瀚微	34,389,299.78	19.32
2	002174	游族网络	29,145,370.44	16.37
3	600373	中文传媒	23,759,355.79	13.35
4	300188	美亚柏科	23,625,461.37	13.27
5	300545	联得装备	21,502,274.45	12.08
6	300456	耐威科技	18,608,078.34	10.45
7	603816	顾家家居	17,402,476.84	9.78

8	300315	掌趣科技	16,852,000.43	9.47
9	600293	三峡新材	15,833,785.09	8.90
10	300212	易华录	14,722,395.95	8.27
11	002555	三七互娱	14,546,892.69	8.17
12	603703	盛洋科技	14,276,664.00	8.02
13	300097	智云股份	14,216,459.14	7.99
14	300075	数字政通	13,838,008.12	7.77
15	300170	汉得信息	13,613,736.58	7.65
16	002745	木林森	13,579,363.97	7.63
17	300120	经纬电材	13,310,959.03	7.48
18	300364	中文在线	13,139,298.94	7.38
19	300473	德尔股份	13,072,451.52	7.34
20	300207	欣旺达	12,755,734.38	7.17
21	300241	瑞丰光电	12,739,873.28	7.16
22	601118	海南橡胶	12,625,728.58	7.09
23	300619	金银河	12,489,245.00	7.02
24	300219	鸿利智汇	12,476,805.24	7.01
25	601900	南方传媒	12,135,007.32	6.82
26	002522	浙江众成	11,729,814.10	6.59
27	002496	辉丰股份	11,530,158.00	6.48
28	600598	北大荒	11,477,913.27	6.45
29	300618	寒锐钴业	11,325,196.00	6.36
30	600549	厦门钨业	11,028,644.00	6.20
31	300298	三诺生物	10,868,590.43	6.11
32	00400	科通芯城	10,480,240.68	5.89
33	300589	江龙船艇	10,310,308.11	5.79
34	300236	上海新阳	10,212,256.25	5.74
35	600038	中直股份	10,063,666.00	5.65
36	600893	航发动力	9,801,260.00	5.51
37	603444	吉比特	9,799,777.00	5.51
38	02333	长城汽车	9,588,282.87	5.39
39	300113	顺网科技	9,531,973.41	5.36
40	600995	文山电力	9,289,416.00	5.22
41	603377	东方时尚	9,288,875.90	5.22
42	300038	梅泰诺	9,247,868.40	5.20
43	603799	华友钴业	9,237,425.00	5.19

44	300058	蓝色光标	8,960,245.42	5.03
45	600990	四创电子	8,917,138.58	5.01
46	600104	上汽集团	8,807,189.78	4.95
47	002637	赞宇科技	8,566,027.21	4.81
48	600108	亚盛集团	8,242,694.00	4.63
49	000630	铜陵有色	8,037,841.00	4.52
50	300567	精测电子	8,025,354.00	4.51
51	002439	启明星辰	7,917,572.90	4.45
52	000157	中联重科	7,725,663.81	4.34
53	601628	中国人寿	7,565,947.90	4.25
54	000768	中航飞机	7,409,565.00	4.16
55	000581	威孚高科	7,357,537.00	4.13
56	300447	全信股份	7,299,079.35	4.10
57	300600	瑞特股份	6,939,949.52	3.90
58	002833	弘亚数控	6,917,439.00	3.89
59	300334	津膜科技	6,749,409.00	3.79
60	01316	耐世特	6,659,955.93	3.74
61	600029	南方航空	6,607,488.00	3.71
62	002340	格林美	6,519,688.00	3.66
63	300605	恒锋信息	6,445,390.54	3.62
64	600021	上海电力	6,413,826.64	3.60
65	002373	千方科技	6,269,770.74	3.52
66	600885	宏发股份	6,206,131.00	3.49
67	600219	南山铝业	6,072,748.00	3.41
68	601009	南京银行	6,068,200.00	3.41
69	002497	雅化集团	6,044,309.00	3.40
70	002440	闰土股份	6,042,689.01	3.40
71	000065	北方国际	6,034,162.40	3.39
72	601689	拓普集团	6,019,736.30	3.38
73	002050	三花智控	5,995,796.96	3.37
74	600819	耀皮玻璃	5,977,749.00	3.36
75	002368	太极股份	5,957,124.00	3.35
76	601233	桐昆股份	5,854,170.00	3.29
77	03888	金山软件	5,657,924.05	3.18
78	600894	广日股份	5,368,227.00	3.02
79	300487	蓝晓科技	4,946,636.00	2.78

80	000546	金圆股份	4,941,097.00	2.78
81	002448	中原内配	4,896,520.00	2.75
82	002765	蓝黛传动	4,895,344.00	2.75
83	601600	中国铝业	4,889,490.00	2.75
84	601111	中国国航	4,836,437.00	2.72
85	00604	深圳控股	4,805,965.19	2.70
86	600068	葛洲坝	4,741,204.00	2.66
87	603336	宏辉果蔬	4,683,134.00	2.63
88	603337	杰克股份	4,668,401.40	2.62
89	603111	康尼机电	4,642,656.00	2.61
90	000823	超声电子	4,622,043.00	2.60
91	000797	中国武夷	4,573,673.12	2.57
92	02238	广汽集团	4,450,788.68	2.50
93	603066	音飞储存	4,436,145.00	2.49
94	300525	博思软件	4,402,538.00	2.47
95	600262	北方股份	4,264,352.00	2.40
96	600808	马钢股份	4,252,687.00	2.39
97	300308	中际旭创	4,238,521.06	2.38
98	600782	新钢股份	4,203,000.00	2.36
99	600581	八一钢铁	4,083,882.00	2.29
100	300588	熙菱信息	4,081,764.00	2.29
101	000063	中兴通讯	3,973,753.45	2.23
102	600999	招商证券	3,962,899.00	2.23
103	000418	小天鹅A	3,822,768.00	2.15
104	300630	普利制药	3,796,818.74	2.13
105	600372	中航电子	3,734,680.00	2.10
106	603997	继峰股份	3,630,560.50	2.04

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	002174	游族网络	33,263,250.41	18.69
2	300613	富瀚微	32,803,960.40	18.43
3	300456	耐威科技	25,212,446.02	14.17

4	600373	中文传媒	23,938,373.75	13.45
5	300038	梅泰诺	23,177,951.29	13.02
6	300236	上海新阳	22,343,905.70	12.55
7	300188	美亚柏科	22,094,647.99	12.41
8	300525	博思软件	20,529,407.60	11.53
9	300545	联得装备	18,362,820.72	10.32
10	603816	顾家家居	17,556,585.91	9.86
11	300118	东方日升	16,779,974.08	9.43
12	000058	深赛格	16,555,942.99	9.30
13	300315	掌趣科技	15,748,742.00	8.85
14	002655	共达电声	15,709,333.74	8.83
15	002745	木林森	15,318,250.87	8.61
16	300071	华谊嘉信	15,195,827.02	8.54
17	603703	盛洋科技	14,954,443.79	8.40
18	002555	三七互娱	14,233,653.45	8.00
19	600293	三峡新材	14,161,192.57	7.96
20	600549	厦门钨业	13,955,986.10	7.84
21	300075	数字政通	13,790,041.27	7.75
22	300170	汉得信息	13,539,255.38	7.61
23	300212	易华录	13,135,726.00	7.38
24	300207	欣旺达	13,113,639.80	7.37
25	002522	浙江众成	13,075,146.61	7.35
26	300473	德尔股份	13,025,963.33	7.32
27	300241	瑞丰光电	12,929,324.38	7.26
28	300364	中文在线	12,596,022.76	7.08
29	601118	海南橡胶	12,390,469.78	6.96
30	601900	南方传媒	11,859,392.68	6.66
31	300120	经纬电材	11,701,952.30	6.57
32	300219	鸿利智汇	11,687,416.00	6.57
33	002496	辉丰股份	11,649,601.70	6.55
34	600598	北大荒	11,563,782.18	6.50
35	300450	先导智能	11,409,946.00	6.41
36	300298	三诺生物	11,361,533.16	6.38
37	300097	智云股份	11,218,558.00	6.30
38	300589	江龙船艇	11,135,226.05	6.26
39	300618	寒锐钴业	10,748,943.09	6.04
40	002617	露笑科技	10,568,169.98	5.94
41	300619	金银河	10,543,580.00	5.92

42	603799	华友钴业	9,833,256.95	5.52
43	600995	文山电力	9,667,738.00	5.43
44	300113	顺网科技	9,507,014.87	5.34
45	603444	吉比特	9,275,934.00	5.21
46	603377	东方时尚	9,030,067.00	5.07
47	002637	赞宇科技	8,938,033.00	5.02
48	02333	长城汽车	8,769,491.89	4.93
49	600104	上汽集团	8,644,159.01	4.86
50	002439	启明星辰	8,635,965.25	4.85
51	300058	蓝色光标	8,385,311.46	4.71
52	600108	亚盛集团	8,380,000.00	4.71
53	000157	中联重科	7,998,916.76	4.49
54	000630	铜陵有色	7,907,926.14	4.44
55	002497	雅化集团	7,560,066.00	4.25
56	601628	中国人寿	7,474,302.00	4.20
57	002833	弘亚数控	7,406,413.40	4.16
58	00400	科通芯城	7,220,084.02	4.06
59	000581	威孚高科	7,181,038.72	4.03
60	600029	南方航空	6,816,233.00	3.83
61	002340	格林美	6,772,500.00	3.81
62	600267	海正药业	6,671,089.00	3.75
63	600885	宏发股份	6,532,360.00	3.67
64	300334	津膜科技	6,503,739.00	3.65
65	002373	千方科技	6,466,663.79	3.63
66	300605	恒锋信息	6,446,421.88	3.62
67	600219	南山铝业	6,436,026.00	3.62
68	600021	上海电力	6,419,180.28	3.61
69	002440	闰土股份	6,161,548.69	3.46
70	601009	南京银行	6,103,911.78	3.43
71	300600	瑞特股份	6,009,188.40	3.38
72	002368	太极股份	5,984,290.00	3.36
73	600819	耀皮玻璃	5,600,303.00	3.15
74	000065	北方国际	5,435,396.00	3.05
75	300567	精测电子	5,307,347.00	2.98
76	601689	拓普集团	5,133,527.00	2.88
77	601111	中国国航	5,103,198.00	2.87
78	603066	音飞储存	5,052,096.00	2.84
79	002765	蓝黛传动	5,029,641.00	2.83

80	600894	广日股份	4,872,248.14	2.74
81	002448	中原内配	4,852,471.00	2.73
82	000546	金圆股份	4,806,981.00	2.70
83	603337	杰克股份	4,806,589.92	2.70
84	000823	超声电子	4,804,087.00	2.70
85	300630	普利制药	4,794,051.12	2.69
86	603111	康尼机电	4,783,098.00	2.69
87	00604	深圳控股	4,777,423.82	2.68
88	600262	北方股份	4,661,258.00	2.62
89	300308	中际旭创	4,573,954.04	2.57
90	600068	葛洲坝	4,523,860.60	2.54
91	000797	中国武夷	4,411,249.35	2.48
92	300348	长亮科技	4,402,861.00	2.47
93	600581	八一钢铁	4,378,565.00	2.46
94	300588	熙菱信息	4,245,365.00	2.39
95	600808	马钢股份	4,224,882.00	2.37
96	603997	继峰股份	4,113,550.00	2.31
97	02238	广汽集团	4,102,392.81	2.30
98	603336	宏辉果蔬	4,081,666.00	2.29
99	600782	新钢股份	3,936,000.00	2.21
100	600999	招商证券	3,779,212.00	2.12
101	600990	四创电子	3,753,378.00	2.11
102	000063	中兴通讯	3,735,784.40	2.10
103	600893	航发动力	3,728,548.00	2.09
104	603881	数据港	3,651,561.99	2.05
105	000418	小天鹅A	3,596,536.00	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	1,065,647,487.45
卖出股票收入（成交）总额	1,123,486,808.23

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,868.00	0.07
	其中：政策性金融债	70,868.00	0.07
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,868.00	0.07

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	700	70,868.00	0.07

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。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

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

本基金所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	94,771.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,830.59
5	应收申购款	34,448.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,051.07

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

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	601600	中国铝业	5,714,189.00	5.68	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
5,002	21,408.03	2,482,682.72	2.32%	104,600,279.10	97.68%

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	19,384.97	0.0181%

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（2016年1月20日）基金份额总额	291,448,737.30
本报告期期初基金份额总额	159,724,523.33
本报告期基金总申购份额	83,456,288.28
减：本报告期基金总赎回份额	136,097,849.79
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	107,082,961.82

§ 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 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。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 60,000 元，目前事务所为第 2 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、托管人的托管业务部门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	
平安证券	1	1924,187,976.02	42.26%	842,213.94	42.17%	-
天风证券	2	484,067,857.14	22.13%	441,133.48	22.09%	-
华泰证券	2	261,822,347.27	11.97%	237,348.43	11.88%	-
中泰证券	1	176,683,629.91	8.08%	161,011.35	8.06%	-
兴业证券	1	145,239,515.35	6.64%	132,356.78	6.63%	-
长城证券	1	74,946,903.76	3.43%	73,894.43	3.70%	-
招商证券	1	50,562,288.58	2.31%	46,076.30	2.31%	-
广州证券	2	37,055,888.57	1.69%	33,768.85	1.69%	-
国泰君安证券	1	32,341,106.92	1.48%	29,472.58	1.48%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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，并能为本基金提供全面的信息服。
- (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) 本报告期内新租中泰证券上海交易单元一个。新租东兴证券深圳交易单元一个。新租华泰证券深圳交易单元一个。新租华泰证券上海交易单元一个。
- (2) 本报告期内未退租交易单元。

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

无。

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新增深圳新华信通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 上海证券报 证券日报	2017 年 1 月 4 日
2	宝盈基金管理有限公司关于高级管理	中国证券报 证券时报	2017 年 1 月 10 日

	人员变更的公告	上海证券报 证券日报	
3	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 上海证券报 证券日报	2017年1月13日
4	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 上海证券报 证券日报	2017年1月17日
5	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年1月26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 上海证券报 证券日报	2017年2月7日
7	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 上海证券报 证券日报	2017年2月23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 上海证券报 证券日报	2017年3月2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 上海证券报 证券日报	2017年3月8日
10	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2017年3月8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 上海证券报 证券日报	2017年3月16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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年3月25日

	估值的提示性公告		
13	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年3月31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 上海证券报 证券日报	2017年4月12日
15	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月14日
16	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月14日
17	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 上海证券报 证券日报	2017年4月22日
18	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 上海证券报 证券日报	2017年5月9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 上海证券报 证券日报	2017年5月11日
20	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 上海证券报 证券日报	2017年5月17日
21	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 上海证券报 证券日报	2017年6月21日
22	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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年7月1日

	申购费率优惠活动的公告		
23	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 上海证券报 证券日报	2017年7月1日
24	宝盈基金管理有限公司关于投资者适当性管理业务变更及开展非居民金融账户涉税信息尽职调查的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年7月4日
25	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 上海证券报 证券日报	2017年7月4日
26	宝盈基金管理有限公司关于修改旗下沪港深基金法律文件的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2017年7月12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 上海证券报 证券日报	2017年8月12日
28	宝盈基金管理有限公司关于新增北京蛋卷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 上海证券报 证券日报	2017年8月25日
29	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中泰证券股份有限公司开展的基金费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年8月29日
30	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报 证券时报 上海证券报	2017年9月1日
31	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金销售有限公司开展的基金费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年9月13日
32	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金	中国证券报 证券时报	2017年9月16日

	采用指数收益法进行估值的提示性公告	上海证券报 证券日报	
33	宝盈基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2017年9月19日
34	宝盈基金管理有限公司关于新增上海挖财金融信息服务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 上海证券报 证券日报	2017年9月29日
35	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 上海证券报 证券日报	2017年10月13日
36	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 上海证券报 证券日报	2017年11月2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 上海证券报 证券日报	2017年11月7日
38	宝盈基金管理有限公司关于新增南京苏宁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 上海证券报 证券日报	2017年11月14日
39	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 上海证券报 证券日报	2017年11月16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 上海证券报 证券日报	2017年11月28日
41	宝盈基金管理有限公司关于新增天津万家财富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 上海证券报 证券日报	2017年12月19日

42	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 12 月 26 日
43	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 上海证券报 证券日报	2017 年 12 月 29 日
44	宝盈基金管理有限公司关于公开募集证券投资基金缴纳增值税的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票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

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

2018 年 3 月 31 日