宝盈增强收益债券型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈增强收益债券	
基金主代码	213007	
交易代码	213007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月15日	
报告期末基金份额总额	2,293,656,033.40份	
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。	
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股(含增发)申购以及二级市场股票投资之间的配置: ①基于对利率、信用等因素的分析,预测固定收益品种的风险和收益; ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断; ③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析,预测新股中购的风险和收益; ④股票市场走势的预测。	
业绩比较基准	中证综合债券指数	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	213007	213917
下属分级基金的前端交易代码	213007	–
下属分级基金的后端交易代码	213007	–
报告期末下属分级基金的份额总额	1,694,571,190.65份	599,084,842.75份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 – 2016年3月31日)	
	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
1. 本期已实现收益	–22,286,295.29	–12,253,111.91
2. 本期利润	–24,448,127.51	–20,548,726.53
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0156	–0.0331
4. 期末基金资产净值	2,292,507,139.35	780,011,471.35
5. 期末基金份额净值	1.3470	1.3020

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

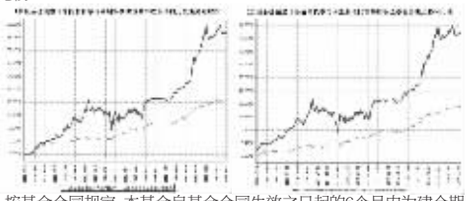
宝盈增强收益债券A/B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–2.21%	0.28%	1.16%	0.05%	–3.37%	0.23%

宝盈增强收益债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–2.32%	0.28%	1.16%	0.05%	–3.48%	0.23%

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



注:1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

2、本基金于2008年10月20日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈增强收益债券C"。

3、本基金自2015年10月1日起业绩比较基准由原"中信标普全债指数"变更为"中证综合债券指数"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2008年9月2日	–	13年	陈若劲女士,香港中文大学金融MBA,曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2006年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,在前期刺激措施累积效果下,宏观经济止住快速下滑的颓势,部分数据显示环比改善迹象。受益于持续宽松的货币政策,大宗商品和住房价格大幅反弹,以猪肉为代表的食品通胀也明显走高。报告期内,央行适度收缩了货币政策的宽松力度,仅通过实现公开市场操作日常化和下调一次存款准备金率对冲到期资金,并未采取包括降息在内的更大力度的宽松政策。

报告期内,由于央行适度收缩了货币政策的宽松力度,资金投放主要以滚动逆回购对冲公开市场到期资金为主,由于资金投放与资金需求在时间和数量上可能存在错配,报告期内市场资金面宽松程度低于前期,阶段性资金面紧张频现。债券市场方面,由于市场资金面宽松程度低于前期,资金利率难以下行,同时大宗商品、房价、食品通胀大幅上涨,中长期限债券品种收益率小幅上行,10年期政策性金融债上行幅度在10bp左右,中短期限债券品种由于避险需求,表现相对较好,收益率小幅下行,收益率曲线结构趋于陡峭化。报告期内,我们继续维持较低的组合久期,并在部分资金面紧张时段,参与了短期融资券和存单的交易性投资机会。

报告期内,权益市场先抑后扬,开年汇率的波动给股票市场带来了不稳定的因素,上证指数在1、2月份出现了较大幅度的回落。3月份,随着基本面数据的转暖和改革政策的不断推出,市场逐渐企稳,反弹渐次展开。报告期,我们对权益市场维持了谨慎的态度,继续维持较低的权益仓位,并紧密关注优质个股超跌带来的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

增强收益A/B:本基金在本报告期内净值增长率是–2.21%,同期业绩比较基准收益率是1.16%。

增强收益C:本基金在本报告期内净值增长率是–2.32%,同期业绩比较基准收益率是1.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	42,058,027.00	1.13
	其中:股票	42,058,027.00	1.13
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	3,207,184,317.70	85.81
	其中:债券	3,207,184,317.70	85.81
	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	400,001,080.00	10.70
	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	31,439,663.65	0.84
8	其他资产	57,072,501.88	1.53
9	合计	3,737,755,590.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	203,391.00	0.01
C	制造业	32,258,636.00	1.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	9,596,000.00	0.31
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	–	–
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	42,058,027.00	1.37

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600096	云天化	1,000,650	9,686,292.00	0.32
2	002727	一心堂	200,000	9,596,000.00	0.31
3	002241	歌尔声学	300,000	7,680,000.00	0.25
4	000590	启迪古汉	348,800	7,457,344.00	0.24
5	002126	银轮股份	500,000	7,435,000.00	0.24
6	601699	潞安环能	27,900	203,391.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	54,991,339.00	1.80
2	央行票据	–	–
3	金融债券	150,650,000.00	4.92
	其中:政策性金融债	150,650,000.00	4.92
4	企业债券	783,522,895.50	25.58
5	企业短期融资券	682,393,000.00	22.28
6	中期票据	1,370,288,000.00	44.74
7	可转债(可交换债)	15,909,083.20	0.52
8	同业存单	149,430,000.00	4.88
9	其他	–	–
10	合计	3,207,184,317.70	104.72

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101570007	15光明MTN001	1,000,000	102,650,000.00	3.35
2	101556031	15中建材MTN002	1,000,000	101,910,000.00	3.33
3	011517011	15华电SCP011	1,000,000	100,450,000.00	3.28
4	011599556	15福新能源SCP001	1,000,000	100,400,000.00	3.28
5	011533010	15五矿SCP010	1,000,000	100,400,000.00	3.28

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

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

5.9.2 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持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	221,123.40
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	56,333,001.90
5	应收申购款	518,326.58
6	其他应收款	50.00
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	57,072,501.88

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601699	潞安环能	203,391.00	0.01	重大事项

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	894,605,694.26	586,182,452.69
报告期期间基金总申购份额	989,914,370.60	253,628,870.50
减:报告期期间基金总赎回份额	189,948,874.21	240,726,480.44
报告期期末基金份额总额	1,694,571,190.65	599,084,842.75

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的文件。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司
2016年4月22日

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	72,742,572.62份
投资目标	在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序的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系统配置策略。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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 – 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	–1,733,128.86
2.本期利润	–8,158,290.92
3.加权平均基金份额本期利润	–0.1149
4.期末基金资产净值	73,327,357.87
5.期末基金份额净值	1.008

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

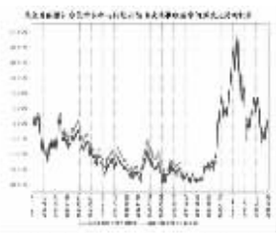
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–10.08%	2.21%	–10.64%	2.05%	0.56%	0.16%

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



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年7月10日	–	11年	盖俊龙先生,经济学硕士,2005年8月至2011年5月,在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员,2011年6月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、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。
郭晓	本基金基金经理	2015年8月27日	–	4年	郭晓先生,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、行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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面,2016年一季度,在稳增长政策的推动下,国内经济逐渐企稳。房地产投资与基础设施投资增速出现改善,制造业企业的景气度有所回升。回顾资本市场,2016年伊始,在美元加息预期和全球经济疲弱的背景下,国内外股票价格指数、大宗商品、汇率等的价格均出现了大幅波动。此外,由于对我国外汇储备流失和人民币贬值的预期、对国内经济形势和证券市场制度的担忧,A股经历了两次向下熔断,1月份出现了较大幅度的下跌。随后的2–3月,在经济基本面数据和各项稳增长政策的支持下、市场情绪逐渐企稳,证券市场价格小幅回升。

报告期内,本基金以比较基准作为参考,股票仓位整体维持在较高位水平。结构上而言,以复制中证100指数权重为主,此外在新兴成长行业中精选个股,在一二级市场上运用套利策略,进行增强投资。本基金2015年的净值增长率是–10.08%,与基准相比的超额受益为0.56%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是–10.08%,同期业绩比较基准收益率是–10.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,639,425.50	79.70
	其中:股票	65,639,425.50	79.70
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	4,000,000.00	4.86
	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	12,413,134.72	15.07
8	其他资产	307,993.54	0.37
9	合计	82,360,553.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	2,125,851.00	2.90
C	制造业	17,089,752.30	23.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,467,211.00	3.36
E	建筑业	2,904,374.00	3.96
F	批发和零售业	629,750.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,526,170.00	2.08
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,808,816.00	2.47
J	金融业	33,725,417.20	45.99
K	房地产业	2,937,018.00	4.01
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	312,646.00	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	112,420.00	0.15
S	综合	–	–
	合计	65,639,425.50	89.52

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	134,590	4,281,307.90	5.84
2	600016	民生银行	367,200	3,345,192.00	4.56
3	601166	兴业银行	165,700	2,573,321.00	3.51
4	600000	浦发银行	121,400	2,176,702.00	2.97
5	600036	招商银行	128,000	2,059,520.00	2.81
6	000002	万 科A	100,200	1,884,762.00	2.57
7	600030	中信证券	97,500	1,735,500.00	2.37
8	601328	交通银行	292,600	1,629,782.00	2.22
9	600519	贵州茅台	6,220	1,540,320.80	2.10
10	601398	工商银行	355,300	1,524,237.00	2.08

5.3.2 报告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五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,246.26
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,877.06
5	应收申购款	290,870.22
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	307,993.54

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	1,884,762.00	2.57	重大资产重组

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	71,169,736.92
报告期期间基金总申购份额	17,048,127.32
减:报告期期间基金总赎回份额	15,475,291.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	72,742,572.62

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈中证100指数增强型证券投资基金设立的文件。

《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同》。

《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司
2016年4月22日

宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈转型动力混合
基金主代码	001075
交易代码	001075
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月29日
报告期末基金份额总额	4,887,660,224.07份
投资目标	本基金在对我国经济结构转型和产业升级进行深入研究的基础上,积极投资于符合经济发展趋势、质地良好的上市公司证券,在严格控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	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。 本基金将会以经济转型作为股票投资的主线,结合对上市公司基本面和估值水平的分析,重点投资受益于经济转型、具有较高成长性及盈利质量的行业及个股,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 – 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	–778,836,241.46
2.本期利润	–803,750,354.64
3.加权平均基金份额本期利润	–0.1651
4.期末基金资产净值	3,502,319,665.76
5.期末基金份额净值	0.717

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

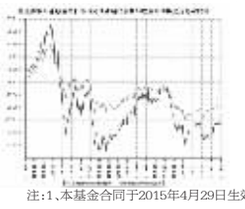
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–19.07%	3.48%	–10.35%	1.85%	–8.72%	1.63%

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



注:1、本基金合同于2015年4月29日生效,自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨凯	本基金基金经理、鸿阳证券投资基金基