宝盈新兴产业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	宝盈新兴产业混合
基金主代码	001128
交易代码	001128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月13日
报告期末基金份额总额	4,101,217,330.92份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,精选新兴产业及其相关行业中的优质企业进行投资,分享新兴产业发展所带来的投资机会,力争为投资者带来长期的超额收益。
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等部分组成。 本基金所指的新兴产业是指随着科研、技术、工艺、产品、服务、商业模式以及管理等方面的创新和变革而产生和发展起来的新兴产业部门。当前所指的新兴产业主要包括:新能源、节能环保、新能源汽车、信息产业、生物医药、国防军工、新材料、高端装备制造、现代服务业及海洋产业等。本基金管理人将重点投资新兴产业及其上下游延伸产业的相关个股,深入挖掘主题投资机会,分享这一投资机遇。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%
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	-125,965,146.33
2.本期利润	-697,863,707.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1695
4.期末基金资产净值	2,588,896,841.18
5.期末基金份额净值	0.631

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。

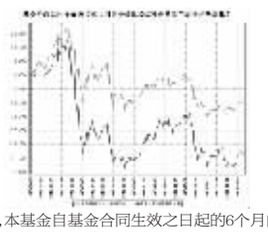
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-21.22%	3.23%	-10.91%	1.94%	-10.31%	1.29%

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		
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、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理,宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理	2015年4月13日	-	11年	盖俊龙先生,经济学硕士。2006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。

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

2016年1季度在"熔断机制"的助推下,A股市场在1月份经历了一轮快速下跌,在2、3月份有所企稳反弹。本基金重点投资在新兴产业领域,所以持仓以成长股为主。

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-21.22%,同期业绩比较基准收益率是-10.91%。

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	1,647,755,556.38	62.84
	其中:股票	1,647,755,556.38	62.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,050,000.00	3.82
	其中:债券	100,050,000.00	3.82
	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	870,638,106.18	33.20
8	其他资产	3,677,864.33	0.14
9	合计	2,622,121,526.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,298,427,765.67	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	-
F	批发和零售业	52,354,816.33	2.02
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	169,362,739.90	6.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	44,820,000.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	82,754,000.00	3.20
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	1,647,755,556.38	63.65

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	002123	荣信股份	8,800,000	152,152,000.00	5.88
2	002546	新联电子	9,000,000	137,520,000.00	5.31
3	300342	天银机电	3,506,944	128,985,400.32	4.98
4	300322	硕贝德	7,600,000	113,544,000.00	4.39
5	002519	银河电子	5,799,693	110,020,176.21	4.25
6	300366	创意信息	1,755,330	104,529,901.50	4.04
7	300327	中颖电子	2,860,634	92,684,541.60	3.58
8	300384	三联虹普	1,400,000	82,754,000.00	3.20
9	000801	四川九洲	3,000,000	80,700,000.00	3.12
10	300078	思创医惠	2,100,000	70,245,000.00	2.71

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	100,050,000.00	3.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,050,000.00	3.86

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	019509	15国债09	1,000,000	100,050,000.00	3.86

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	848,510.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,553,090.43
5	应收申购款	276,262.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,677,864.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300366	创意信息	104,529,901.50	4.04	重大事项
2	300384	三联虹普	82,754,000.00	3.20	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,102,849,407.05
报告期期间基金总申购份额	111,372,818.23
减:报告期期间基金总赎回份额	113,004,894.36
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	4,101,217,330.92

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,835,311.57
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,835,311.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.36

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

中国证监会批准宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街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

宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金

【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	宝盈医疗健康沪港深股票
基金主代码	001915
交易代码	001915
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月2日
报告期末基金份额总额	404,564,455.40份
投资目标	本基金将深入挖掘医疗健康产业发展过程中带来的投资机会,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、金融衍生品投资策略和参与融资业务投资策略五部分组成。 (一)大类资产配置策略 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国内A股和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例。 (二)股票投资策略 本基金所指的医疗健康产业包括医疗服务产业、保健养生服务产业和健康管理产业三个方面。在子行业配置方面,本基金着眼分析医疗健康产业涵盖的各行业技术成熟度、行业所处生命周期、行业内外竞争空间、行业盈利前景、行业成长空间及行业估值水平等多层面的观察,在此基础上判断行业的可持续发展能力,从而确定本基金的行业配置。本基金在子行业配置的基础上,通过定性分析与定量分析相结合的方法,精选出医疗健康产业相关的优质上市公司进行投资。 本基金将对港股通标的进行系统性分析,在采用子行业配置策略和个股精选策略的基础上,结合香港股票市场情况,重点投资于港股通标的范围内受惠于我国宏观经济环境改善或医疗健康产业快速发展,且处于合理价位的具备核心竞争力的股票。 (三)固定收益类资产投资策略 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、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。 (四)金融衍生品投资策略 本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用,降低投票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而更好的实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	申银万国医药生物行业指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于高收益/风险特征的基金。 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,还需承担汇率风险以及境外市场的风险。
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	-29,753,800.40
2.本期利润	-83,840,633.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1933
4.期末基金资产净值	343,294,583.77
5.期末基金份额净值	0.849

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。

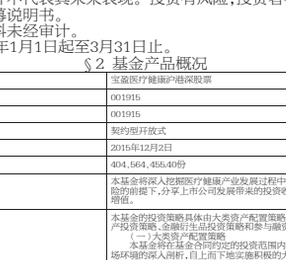
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-16.02%	2.98%	-13.98%	2.27%	-2.04%	0.71%

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		
段鹏程	本基金基金经理、研究部总监	2015年12月2日	-	12年	段鹏程先生,理学硕士。曾就职于厦门国际信托投资有限公司和天同证券。2004年5月至2007年3月任职于宝盈基金管理有限公司,担任行业研究员。2007年3月至2008年3月任职于新安基金管理有限公司,现任新安价值增长股票证券投资基金基金经理(2007年6月16日至2008年1月10日)、专户部总监。2008年4月起任职于宝盈基金管理有限公司,历任特定客户资产管理部投资经理,特定客户资产管理部副总监、总监,研究部核心研究员、副总监,现任宝盈基金管理有限公司研究部总监。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

2016年一季度,A股市场呈现快速、深幅调整之后的企稳趋势。上证指数跌幅15.1%、沪深300跌幅13.8%、深成指跌幅17.5%、创业板指数跌幅17.5%、中小板指数跌幅18.2%。同期,申万生物医药指数跌幅18.6%。整体上看,中小板、创业板在一季度落后于主板,而医药行业表现尤为不佳,本基金在一季度实现收益为-16.02%。

本基金属于医药行业股票投资基金,按照基金契约与法规规定,在本报告期内,重点投资行业限定于医疗健康产业,并基于行业的发展前景分析,投资了部分TMT、环保和新能源汽车企业。

报告期内,行业政策频出,医改大步迈进。国家医改专题工作会议中初步确定将陕西省、上海市、浙江省、四川省列为第二批试点省份,推广"三明医改经验"。更严格的管理和控费虽然使得行业增速放缓,但市场存在结构性投资机会。药品一致性评价将致使低质无效仿制药和辅助用药退出市场,而高品质仿制药企有望填补市场空白而成长。器械管理趋严有利于龙头企业扩大规模优势,提升行业集中度。而三明医改经验推广将加速我国分级诊疗和医保控费的发展,催化医药商业企业模式再造及升级。

从行业数据来看,2016年1-2月医药制造业累计收入增速8%,累计利润增速10.1%,相比2015年:收入增速下降1.1pp,利润增速下降2.7pp,行业增速放缓的趋势仍在持续。从过去两年历史数据看,1-2月份的数据基本能反映全年的基调。

本基金认为:医疗健康行业是一个创造财富、积累财富的热范行业。医疗技术的进步、人口老龄化进程、国民财富的增加以及国家医保政策的实施是推动这一行业持续、稳定发展的强大内生动力。当下,国家医改深入推行,其中的产业政策虽对行业发展有结构性影响,但不改其长期增长趋势。基于以上认知,本基金的投资策略是:通过自上而下的研究,选择行业景气高、符合技术进步与盈利模式演化趋势的子行业为重点投资领域,并通过考量企业的收入增速、利润增速等财务指标,以及盈利模式的稀缺性等分析来锁定具体的目标企业。具体实践上,本基金在报告期内重点投资了精准医疗、养老康复、医疗服务、血液制品、医药商业和糖尿病治疗产业链等行业景气度高的子领域,相反对受产业政策负面影响较大的制药行业持较为谨慎的投资态度。

基于医疗健康行业的长期、稳定增长特征,本基金主要通过长期持有优质企业为投资手段、以实现分享企业增长成果的投资目标。

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-16.02%,同期业绩比较基准收益率是-13.98%。

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	317,586,534.96	91.42
	其中:股票	317,586,534.96	91.42
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	29,601,238.82	8.52
8	其他资产	203,416.19	0.06
9	合计	347,391,189.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	114,020.85	0.03
C	制造业	237,105,258.74	69.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,401,707.80	5.36
E	建筑业	119,709.48	0.03
F	批发和零售业	35,394,437.00	10.31
G	交通运输、仓储和邮政业	187,880.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,679,021.09	3.40
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	14,584,500.00	4.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	317,586,534.96	92.51

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

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	300322	硕贝德	1,701,900	25,426,386.00	7.41
2	300246	宝莱特	850,000	22,771,500.00	6.63
3	000078	海王生物	1,300,000	21,320,000.00	6.21
4	002007	华兰生物	459,920	20,415,848.80	5.95
5	002426	胜利精密	899,940	20,041,663.80	5.84
6	002675	东诚药业	450,000	19,287,000.00	5.62
7	000722	湖南发展	1,202,726	18,401,707.80	5.36
8	300363	博腾股份	847,850	18,313,560.00	5.33
9	600594	益佰制药	1,000,000	16,250,000.00	4.73
10	300009	安科生物	500,000	14,825,000.00	4.32

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	146,233.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,402.87
5	应收申购款	49,779.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,416.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002675	东诚药业	19,287,000.00	5.62	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	571,198,472.55
报告期期间基金总申购份额	15,213,506.27
减:报告期期间基金总赎回份额	181,847,522.42
报告期期末基金份额总额	404,564,455.40

§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

中国证监会批准宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈医疗健康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。

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

宝盈优势产业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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	宝盈优势产业混合
基金主代码	001487
交易代码	001487
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月25日
报告期末基金份额总额	152,457,988.55份
投资目标	本基金将通过积极的大类资产配置,重点关注我国的优势产业,深入研究行业个股,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略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。 (一)大类资产配置策略 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。 (二)股票投资策略 本基金遴选重点投资优势产业与行业内精选个股相结合的股票投资策略,包括行业配置策略和个股投资策略。 (三)固定收益类资产投资策略 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。 (四)金融衍生品投资策略 本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用,降低投票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而更好的实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证800指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%
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	中国工商银行股份有限公司

§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	-7,366,945.56
2.本期利润	-23,088,623.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1565
4.期末基金资产净值	137,880,614.59
5.期末基金份额净值	0.904

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