

## 宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

[2017] 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:2017年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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对本基金合同约定，于2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置比例、申购赎回价格、投资组合报告等信息，保证复核后的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。

本报告期基金财务未经审计。

报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

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	300005	晶瑞股份	11,300,000	161,026,000.00	5.19
2	200400	海通国际	2,540,000	145,712,000.00	4.73
3	000717	神华宁煤	11,794,140	150,229,10,200.00	4.46
4	000020	神华宁煤	2,000,000	131,007,000.00	4.26
5	000028	合众互联	5,570,000	150,645,822,000.00	4.07
6	000067	晋能控股	2,100,000	151,101,000.00	4.03
7	001737	赛维德	13,199,441	113,262,019,795.00	3.65
8	000089	特变电工	9,699,300	109,541,048,114.00	3.50
9	002664	天科股份	8,869,362	99,402,016,614.00	3.20
10	000011	海航控股	6,699,799	96,707,506,000.00	3.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

基金简称	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 国家债券	-	-	-
2 中央票据	-	-	-
3 企业债	-	-	-
4 合同债	-	-	-
5 金融债	-	-	-
6 企业债	-	-	-
7 可转换(可交换)	12,301,000,000	0.41	
8 同业存单	-	-	-
9 其他	-	-	-
10 合计	12,301,000,000	0.41	

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贵金属投资明细

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	110011	光大转债	120,010	12,801,000,000	0.41

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益		-102,080.06302
2.本期利润		61,219,215.46
3.加权平均基金份额本期利润		0.01643
4.期末基金份额净值		3.106,139,972.48
5.期末可供分配基金份额总额		0.0744

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.本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.所列数据不包括持有人认购或交易基金份额的申购金额。

4.3.2 基金净值表现

5.2.1 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变动的比较

阶段

净值增长(%)

同期业绩比较基准收益率(%)

1(1)-①

②(4)

过去三个月

132%-0.00%

250%-0.30%

0.30%-0.07%

0.41%

5.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化图

5.2.3 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变动的比较

阶段

净值增长(%)

同期业绩比较基准收益率(%)

1(1)-①

②(4)

过去三个月

132%-0.00%

250%-0.30%

0.30%-0.07%

0.41%

5.3.1 本报告期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。

5.3.2 本报告期期末按行业分类的股票投资组合

A 农林、牧、渔业

B 采矿业

C 制造业

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业

E 建筑业

F 交通运输、仓储和邮政业

G 工业、建筑业

H 钛白粉

I 电子元件

J 通信设备

K 汽车、摩托车及履行

L 仪器仪表

M 科学研究、技术服务及专业服务业

N 水利、环境和公共设施管理业

O 国防、武警、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 保险业

T 证券业

U 其他行业

V 未分类

W 无法判别

X 未详

Y 未详

Z 未详

合计

2,772,223,265.07

89.09

5.3.3 本报告期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

5.3.4 报告期内基金投资组合变动的说明

5.3.5 本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组合

5.3.6 本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组合

5.3.7 本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组合

5.3.8 本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组合

5.3.9 本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组合

5.3.10 本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组合

5.3.11 本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组合

5.3.12 本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组合

5.3.13 本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组合

5.3.14 本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组合

5.3.15 本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组合

5.3.16 本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组合

5.3.17 本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组合

5.3.18 本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组合

5.3.19 本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组合

5.3.20 本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组合

5.3.21 本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组合

5.3.22 本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组合

5.3.23 本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组合

5.3.24 本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组合

5.3.25 本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组合

5.3.26 本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组合

5.3.27 本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组合

5.3.28 本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组合

5.3.29 本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组合

5.3.30 本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组合

5.3.31 本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组合

5.3.32 本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组合

5.3.33 本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组合

5.3.34 本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组合

5.3.35 本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组合

5.3.36 本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组合

5.3.37 本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组合

5.3.38 本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组合

5.3.39 本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组合

5.3.40 本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组合

5.3.41 本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组合