宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 1 月 20 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 2018 年 1 月 19 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 2017 年 10 月 1 日起至 12 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	110,422,115.14 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 本基金遵循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。
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(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	2,735,569.03
2.本期利润	7,225,897.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0679
4.期末基金资产净值	130,651,525.87
5.期末基金份额净值	1.183

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。

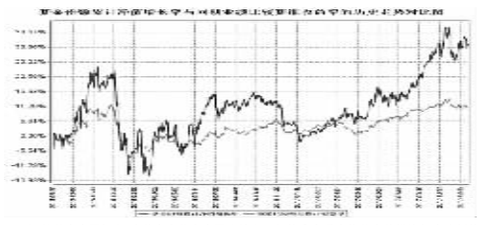
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.77%	1.39%	1.25%	0.50%	5.52%	0.89%

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		
段鹏程	本基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金(由原鸿阳证券投资基金转型而来)、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理;权益投资部执行总经理	2016 年 8 月 20 日	-	13年	段鹏程先生,厦门大学生物学硕士。曾任职于厦门国际信托投资公司,天同证券深圳中心营业部总经理助理、副总经理,诺安基金管理有限公司基金经理,特定客户资产管理部总监。2004 年 5 月加入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、副总监、研究部核心研究员、副总监、总监,权益投资部总监,现任宝盈基金管理有限公司权益投资部执行总经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
肖肖	本基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017 年 1 月 7 日	-	9年	肖肖先生,北京大学金融学硕士。2008 年 7 月至 2011 年 4 月任职于联合证券有限责任公司,担任研究员;2011 年 5 月至 2014 年 5 月任职于民生证券有限责任公司,担任研究员;2014 年 6 月至 2015 年 2 月任职于方正证券股份有限公司,担任研究员,自 2015 年 2 月加入宝盈基金管理有限公司研究部,担任研究员。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,本基金股票仓位整体维持在较高位水平,本报告期内净值增长率是 6.77%,对应基准收益 1.25%,相对基准有 5.52%的超额收益。本基金采取稳健成长的价值投资策略,行业配置以家电、食品饮料、电子、零售等方向为主。

四季度市场观点与投资策略:

1、限价限购等差异化房地产调控政策,一定程度上延长了地产景气维持在高位的时间,下半年地产 + 基建 + 外需齐发力,经济复苏的韧劲要比市场预期更长久。

2、严格的资本管制和强劲的基本面数据,人民币汇率在下半年大概率维持强势。

3、货币政策和信贷政策偏紧但不会显著收紧,名义利率大概率不会上行,市场对此基本反映充分。

4、需警惕高估值板块持续的解禁压力和新股发行提速的冲击。

5、市场风格越来越偏向估值偏低或合理的优质细分行业龙头。

6、继续看好家电、食品饮料、保险、定制家居、跨境电商、新能源汽车、苹果产业链、汽车及汽车零部件等行业。

4.5 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 1.183 元;本报告期基金份额净值增长率为 6.77%,业绩比较基准收益率为 1.25%。

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	123,155,332.84	93.84
	其中:股票	123,155,332.84	93.84
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	7,473,956.02	5.69
8	其他资产	616,638.04	0.47
9	合计	131,245,926.90	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	11,719,062.00	8.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	78,665,245.09	60.21
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	10,718,400.00	8.20
G	交通运输、仓储和邮政业	10,166,568.00	7.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.03
J	金融业	11,819,622.00	9.05
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	32,323.20	0.02
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	123,155,332.84	94.26

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	000333	美的集团	229,300	12,710,099.00	9.73
2	601318	中国平安	168,900	11,819,622.00	9.05
3	002714	牧原股份	221,700	11,719,062.00	8.97
4	600887	伊利股份	357,800	11,517,582.00	8.82
5	002640	跨境通	560,000	10,718,400.00	8.20
6	600872	中炬高新	420,000	10,399,200.00	7.96
7	600029	南方航空	852,900	10,166,568.00	7.78
8	000651	格力电器	226,600	9,902,420.00	7.58
9	002273	水晶光电	357,000	8,421,630.00	6.45
10	002456	欧菲科技	341,000	7,021,190.00	5.37

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	76,817.67
2	应收证券清算款	223,849.94
3	应收股利	-
4	应收利息	1,850.31
5	应收申购款	314,120.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	616,638.04

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

本基金本报告期末前十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	96,547,385.93
报告期期间基金总申购份额	41,310,855.07
减:报告期期间基金总赎回份额	27,436,125.86
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	110,422,115.14

§ 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

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈优势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:北京市西城区复兴门内大街 55 号

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

2018 年 1 月 20 日

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金

2017年第四季度报告

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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 1 月 20 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 2018 年 1 月 19 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 2017 年 10 月 1 日起至 12 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	152,469,957.68 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约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积极配置策略。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	本基金属于中证 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(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	6,945,783.91
2.本期利润	16,786,894.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.1076
4.期末基金资产净值	220,324,603.83
5.期末基金份额净值	1.445

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。

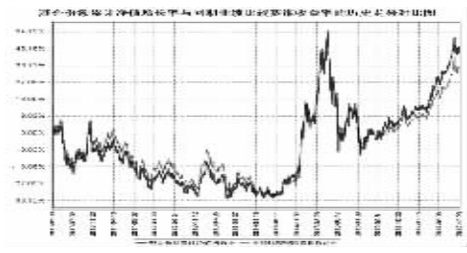
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	8.40%	0.87%	7.85%	0.86%	0.55%	0.01%

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		
蔡丹	本基金基金经理	2017年 8 月 5 日	-	7年	蔡丹女士,CFA、中山大学概率论与数理统计硕士,曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司,2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司,先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司。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

2017 年 4 季度,A 股市场冲高回落,上证综指于 2017 年 11 月 14 日盘中创出新高 3450.5 点,之后开始震荡回落。从指数来看,上证 50 上涨 7.04%,沪深 300 上涨 5.07%,上证综指下跌 1.25%,中小板下跌 0.09%,创业板下跌 6.12%。从行业看,申万 28 个一级行业中仅有 8 个行业上涨,其中,食品饮料、家用电器、医药生物、银行涨幅超 1%,综合、计算机、国防军工、轻工制造、传媒、有色金属和纺织服装跌幅均超 9%。从板块来看,本季度消费板块相对强势,成长板块从 11 月份开始相对走弱。

从风格来看,创业板于 10 月 13 日结束日线级别上涨,进入一波日线级别下跌,上证 50 指数从 5 月 9 日进入日线级别上涨直至 11 月 22 日结束这一波上涨。大小盘指数走势的差异,最终导致本季度市场风格分化较为明显,大盘蓝筹占优,小盘风格相对大盘风格持续走弱。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子,构建多维度、多策略的选股体系。当前在成份股内构建了大类增强策略,在实现主要风险因子中性的基础上,严格控制与基准指数的偏离度,通过增强策略来增强产品收益。此外,本基金还积极参与网下新股申购,通过打新来提供稳定的增强收益。

报告期内,本基金的股票仓位维持在较高位水平,在复制中证 100 指数成份股的基础上,配置了部分增强策略。本基金 2017 年 4 季度的单位净值增长率为 8.4%,相对基准超额收益为 0.55%,年化跟踪误差为 0.79%。

4.5 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 1.445 元;本报告期基金份额净值增长率为 8.40%,业绩比较基准收益率为 7.85%。

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	207,487,181.86	93.34
	其中:股票	207,487,181.86	93.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,987,400.00	4.04
	其中:债券	8,987,400.00	4.04
	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	1,565,247.92	0.70
8	其他资产	222,280,118.53	100.00
9	合计		

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按指数投资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	6,089,277.00	2.76
C	制造业	69,295,422.50	31.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,919,307.00	2.23
E	建筑业	8,511,568.00	3.86
F	批发和零售业	1,409,663.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	3,204,403.00	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,215,324.40	1.46
J	金融业	96,036,735.43	43.59
K	房地产业	9,684,250.00	4.40
L	租赁和商务服务业	1,587,660.80	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	937,296.00	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	1,382,493.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	206,273,400.13	93.62

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
C	制造业	683,692.02	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
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	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	253,072.55	0.11
J	金融业	210,608.00	0.10
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	32,323.20	0.01
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	1,213,781.73	0.55

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	290,490	20,328,490.20	9.23
2	600519	贵州茅台	13,400	9,346,366.00	4.24
3	600036	招商银行	280,600	8,143,012.00	3.70
4	000333	美的集团	118,750	6,582,312.50	2.99
5	601166	兴业银行	343,500	5,836,065.00	2.65
6	000651	格力电器	132,300	5,781,510.00	2.62
7	600016	民生银行	617,200	5,178,308.00	2.35
8	600887	伊利股份	155,700	5,011,983.00	2.27
9	601328	交通银行	758,900	4,712,769.00	2.14
10	601668	中国建筑	488,600	4,407,172.00	2.00

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

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	600485	信威集团	17,000	248,030.00	0.11
2	300104	乐视网	56,000	218,960.00	0.10
3	601198	东兴证券	13,000	187,200.00	0.08
4	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.08
5	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02

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	8,987,400.00	4.08
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	8,987,400.00	4.08

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	019557	17国债03	90,000	8,987,400.00	4.08

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	32,708.33
2	应收证券清算款	151,037.15
3	应收股利	-
4	应收利息	224,370.56
5	应收申购款	1,157,131.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,565,247.92

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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	600485	信威集团	248,030.00	0.11	重大事项
2	300104	乐视网	218,960.00	0.10	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	151,493,982.09
报告期期间基金总申购份额	45,295,349.18
减:报告期期间基金总赎回份额	44,319,373.59
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	152,469,957.68

§ 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

8.1 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。

8.2 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。

§ 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:北京市西城区阜内大街 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

2018 年 1 月 20 日

宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 1 月 20 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 2018 年 1 月 19 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 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈互联网沪港深混合
基金主代码	002482
交易代码	002482
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 6 月 16 日
报告期末基金份额总额	111,198,254.86 份
投资目标	本基金重点关注互联网主题的投资机会,在严格控制风险的前提下,分享互联网行业发展带来的投资机会,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 本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心,一方面规避相关资产的下行风险,另一