宝盈核心优势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	宝盈核心优势混合
基金主代码	213006
交易代码	213006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月17日
报告期末基金份额总额	1,227,303,187.23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,本基金根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势,具有领先优势,具有技术优势,具有差断优势,具有管理优势的龙头企业,建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上,对于景气度提高的行业给予适当倾斜,以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量,行业市场,风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制投资组合的市场适应性,在严格控制投资风险的前提下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	1.资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2.股票投资策略 根据公司的基本面情况,根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势,具有领先优势,具有技术优势,具有差断优势、具有管理优势的企业,建立股票池。本基金在构建投资组合时,强调两端投资,价值与成长性能平衡,兼顾价值与成长型股票,以均衡资产组合策略建立动力资产组合,努力克服单一风格投资所带来的局限性,这样可以较好控制组合市场适应性,一定程度上能够排除对景气误判概率,以求多空环境中都能创造主动管理回报。 3.债券投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测,久期管理,收益率曲线预测,相对价值评估,收益率利差策略,套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金是一只灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险预算范围内追求收益最大化。
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

下属分级基金的基金简称	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
下属分级基金的交易代码	213006	000241
报告期末下属分级基金的份额总额	1,208,561,435.15份	18,741,752.08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(2017年10月1日-2017年12月31日)	
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
1. 本期已实现收益	-50,850,589.10	-836,991.53
2. 本期利润	-21,456,047.26	-395,706.45
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0172	-0.0198
4. 期末基金资产净值	1,214,892,008.11	18,259,260.45
5. 期末基金份额净值	1.0052	0.9743

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

宝盈核心优势混合A

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	-1.60%	0.97%	3.34%	0.52%	-4.94%	0.45%

宝盈核心优势混合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	-1.95%	0.97%	3.34%	0.52%	-5.29%	0.45%

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2013年8月1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"宝盈核心优势混合C"。

§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		
李健伟	本基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年1月25日	-	6年	李健伟先生,华南理工大学工学硕士。2007年8月至2010年4月,在普华永道咨询有限公司任职高级顾问,2010年4月至2012年12月,在广发证券股份有限公司任职糖核员、行业研究员,2012年12月加入宝盈基金管理有限公司,先后任职研究部研究员、专户投资部投资经理。中国籍,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 报告期内本基金投资策略和运作分析

本基金2017年三季报中,对于四季度的投资策略和方向,基金管理人认为:"展望四季度,央行定向降准意味着货币政策的宽松信号开始出现,人民币汇率走稳为货币政策预留操作空间,9月份PMI数据开始呈现反弹,这都是市场的积极信号。虽然宏观周期是否会呈现二次探底暂时没有定论,但从目前预披露情况来看,上市公司三季度净利润增速为37%,环比二季度回升14.4%。海外市场,特朗普政府的减税计划拖延了大半年后终于面世整体框架,虽力度有所减小,但仍是多年来美国历史上规模最大的减税,这将为美国经济注入一剂强心针,利多全球经济与美元,同时利多权益类市场和大宗商品。国内方面,随着十九大召开日益临近,预计明年政府工作重点将更多投入到经济工作建设中,有利于提升市场整体风险偏好。基于此,我们认为四季度仍然将是比较不错的投资窗口。我们重点看好的领域和方向包括:工业环保,5G,供给侧改革,以及跨年度估值切换的成长股。"

基于以上投资策略,本基金加大了对工业环保、周期性中游制造业和5G等领域的配置,本基金四季度宝盈核心优势混合A收益为-1.60%,宝盈核心优势混合C收益为-1.95%(同期沪深300指数收益5.07%)。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈核心优势混合A基金份额净值为1.0052元,本报告期基金份额净值增长率为-1.60%;截至本报告期末宝盈核心优势混合C基金份额净值为0.9743元,本报告期基金份额净值增长率为-1.95%;同期业绩比较基准收益率为3.34%。

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	837,682,024.95	67.18
	其中:股票	837,682,024.95	67.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	215,871,718.60	17.31
	其中:债券	215,871,718.60	17.31
	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	50,000,145.00	4.01
	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	104,933,845.06	8.41
8	其他资产	38,497,977.43	3.09
9	合计	1,246,985,711.04	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	19,773,663.52	1.60
C	制造业	598,129,129.10	48.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
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	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,652,992.75	8.65
J	金融业	58,027,000.00	4.71
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	55,065,153.62	4.47
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	837,682,024.95	67.93

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	300203	聚光科技	1,782,173	63,356,250.15	5.14
2	600388	龙净环保	3,406,805	58,937,726.50	4.78
3	002439	启明星辰	2,503,148	58,448,505.80	4.74
4	000063	中兴通讯	1,554,140	56,508,530.40	4.58
5	002573	清新环境	2,421,154	55,032,830.42	4.46
6	002709	天赐材料	1,110,000	51,048,900.00	4.14
7	300373	扬杰科技	1,673,500	50,154,795.00	4.07
8	300671	富满电子	1,192,336	48,170,374.40	3.91
9	300308	中际旭创	799,962	46,797,777.00	3.79
10	300232	洲明科技	2,569,771	36,747,725.30	2.98

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	106,269,294.60	8.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,602,424.00	8.89
	其中:政策性金融债	109,602,424.00	8.89
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	215,871,718.60	17.51

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	018002	国开1302	1,082,600	109,602,424.00	8.89
2	010107	21国债(7)	1,058,670	106,269,294.60	8.62

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	397,658.04
2	应收证券清算款	29,383,128.78
3	应收股利	-
4	应收利息	8,255,066.19
5	应收申购款	462,124.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,497,977.43

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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

项目	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
报告期期初基金份额总额	1,295,102,555.82	21,167,723.71
报告期期间基金总申购份额	46,791,972.21	1,508,073.30
减:报告期期间基金总赎回份额	133,333,092.88	3,934,044.93
报告期期末基金份额总额	1,208,561,435.15	18,741,752.08

§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

报告期初管理人持有的本基金份额	4,300,645.16
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	4,300,645.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.35

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

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核心优势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈核心优势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

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。

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

9.3 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1月20日

宝盈睿丰创新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:广发证券股份有限公司
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。

基金托管人广发证券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	宝盈睿丰创新混合
基金主代码	000794
交易代码	000794
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月26日
报告期末基金份额总额	201,647,640.72份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置,重点关注具备持续创新能力的上市公司,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	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率(全价)×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	广发证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
下属分级基金的交易代码	000794	000796
下属分级基金的前端交易代码	000794	-
下属分级基金的后端交易代码	000795	-
报告期末下属分级基金的份额总额	51,959,394.67份	149,688,246.05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(2017年10月1日-2017年12月31日)	
	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
1. 本期已实现收益	3,517,895.85	9,283,579.70
2. 本期利润	-7,465,063.44	-19,245,257.09
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1343	-0.1199
4. 期末基金资产净值	64,657,474.26	170,698,010.96
5. 期末基金份额净值	1.244	1.140

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

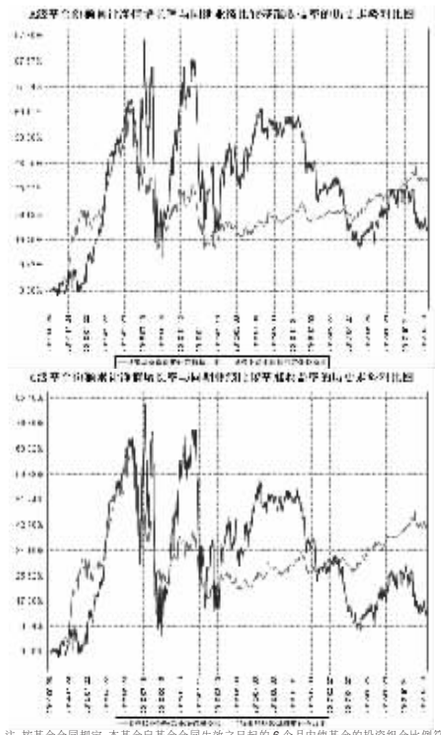
宝盈睿丰创新混合A/B

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	-9.99%	1.37%	2.89%	0.52%	-12.88%	0.85%

宝盈睿丰创新混合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	-10.17%	1.37%	2.89%	0.52%	-13.06%	0.85%

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		
朱建明	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理	2017年1月5日	-	7年	朱建明先生,中国人民银行研究生部金融学硕士。2010年7月至2011年3月任职于瀚信资产管理有限公司,担任研究员;自2011年5月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部研究员、专户投资部投资经理。中国籍,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 报告期内本基金投资策略和运作分析

本基金2017年第四季度报告,对于四季度的投资策略和方向,基金管理人认为:"稳中有进",从各项经济数据来看,经济指标的波动区间基本符合预期,中国经济进入了一个新的平台期。我们认为,十九大报告提出的中国特色社会主义进入了新时代的判断符合当前的基本面特征,中国经济由高速增长转向高质量发展,虽然量的增长较为平稳,但质的提高明显。展望2018年,经济运行呈现总体平稳特征,企业的微观盈利持续恢复,产业结构继续优化。从中长期来看,我们始终认为中国经济具备较强的韧性和广阔的空间,供给侧结构性增长潜力巨大,广阔而多层次的市场,成熟完善的工业体系,消费升级和产业创新这两大趋势将持续推进中国经济的发展和优化。

本基金管理人认为,中国正在经历产业出清和崛起的新时代。在宏观环境貌似平静的表面之下,产业和企业的分化在加剧。随着货币政策基调的收紧,过去那种借助融资杠杆,低水平增长的企业将面临瓶颈;环保督查常态化和执行标准从严,依靠低环保投入,污染环境而低质量竞争的企业将被淘汰出局,行业内真正优秀的企业就会脱颖而出。创新是未来成就伟大企业最重要的基因之一,在经济高质量发展的大浪潮中,勇于在产品创新、技术研发上持续投入的企业,将构筑越来越宽的护城河,核心竞争力和产业链地位不断加强,具备长期投资价值。

基于以上对经济周期、产业方向的认识,遵循本基金的长期投资脉络,本季度在上述重点方向继续布局优质个股,一方面,基于全球生物医药创新时代的来临和中国优质创新药企业的不断涌现,重点加仓了创新药龙头。另一方面,持续看好受益于苹果产业链的消费电子和5G产业链,虽然其中部分个股受整体行业影响,给净值带了负面影响,但从中长期的角度,本基金将持续看好。同时,本基金继续看好具备核心技术创新优势的工业环保龙头。本基金管理人将继续坚持"自上而下定产业方向,自下而上选优质个股"的投资思路,在上述方向深度研究具备核心竞争力的公司,在合理的估值水平买入且秉承长期持有的理念,为客户创造长期的稳健回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈睿丰创新混合A/B基金份额净值为1.244元,本报告期基金份额净值增长率为-9.99%;截至本报告期末宝盈睿丰创新混合C基金份额净值为1.140元,本报告期基金份额净值增长率为-10.17%;同期业绩比较基准收益率为2.89%。

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	264,478,458.69	76.55
	其中:股票	264,478,458.69	76.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,742,442.00	0.50
	其中:债券	1,742,442.00	0.50
	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	78,383,162.46	22.69
8	其他资产	872,271.24	0.25
9	合计	345,476,334.39	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	150,785,723.98	64.07
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	16,144,112.55	6.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,106,000.00	1.32
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	28,705,323.20	12.20
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	8,505,486.87	3.61
S	综合	-	-
	合计	207,280,732.56	88.07

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	002573	清新环境	1,000,000	22,730,000.00	9.66
2	600388	龙净环保	1,200,000	20,760,000.00	8.82
3	002294	信立泰	384,928	17,394,896.32	7.39
4	002384	东山精密	600,000	17,076,000.00	7.26
5	002635	安洁科技	600,000	15,654,000.00	6.65
6	300383	光环新网	1,000,000	12,120,000.00	5.15
7	600498	烽火通信	404,126	11,650,952.58	4.95
8	000100	TCL集团	2,500,000	9,750,000.00	4.14
9	600867	通化东宝	420,000	9,613,800.00	4.08
10	300558	贝达药业	140,000	8,860,600.00	3.76

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投资。

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投资。

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	397,447.49
2	应收证券清算款	2,057,888.50
3	应收股利	-
4	应收利息	6,154.58
5	应收申购款	161,319.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,622,809.83

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	300383	光环新网	12,120,000.00	5.15	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

项目	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
报告期期初基金份额总额	61,037,923.17	187,637,221.73
报告期期间基金总申购份额	2,730,050.12	13,617,179.40
减:报告期期间基金总赎回份额	11,808,578.62	51,566,155.08
报告期期末基金份额总额	51,959,394.67	149,688,246.05

§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

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睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈睿丰创新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 18楼、19楼、38楼、39楼、40楼、41楼、42楼、43楼和44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

宝盈消费主题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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	宝盈消费主题混合
基金主代码	003715
交易代码	003715
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月4日
报告期末基金份额总额	297,613,865.98份
投资目标	本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司,追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