宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月25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10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈鸿利收益混合
基金主代码	213001
交易代码	213001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年10月8日
报告期末基金份额总额	507,354,450.70份
投资目标	在严格控制风险的前提下,为基金投资人谋求长期资本增值收益。
投资策略	本基金主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益: (一)战略资产配置策略 基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标,对不同市场的风险收益状况做出判断,据此调整股票、债券和现金等大类资产的配置比例。 (二)股票投资策略 1、行业资金配置策略。首先由行业分析师估计各行业未来的期望增长速度,以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整,寻找总体投资价值被相对低估的行业。根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标,结合经济发展不同阶段对不同行业的影响,决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。 2、公司选择策略。本基金对上市公司投资价值的判断,主要依赖于两方面的基础工作:一是从行业发展趋势、公司核心竞争优势、公司运营管理效率的角度对公司进行定性分析,二是通过选择适当的估值模型对公司的投资价值进行定量测算。在筛选过程中,更强调公司长期(3-5年)的发展和竞争优势,稳定成长的市场,可持续的主营业务利润、良好的现金流和满意的红利分配政策。在对行业内上市公司进行合理排序的基础上,重点投资于位于行业前列的收益率上市公司,排序所依据的主要指标为红利收益率和增长率调整后的市盈率。 (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)权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
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	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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,473,948.54
2.本期利润	-42,097,604.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0809
4.期末基金资产净值	492,586,204.50
5.期末基金份额净值	0.971

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。

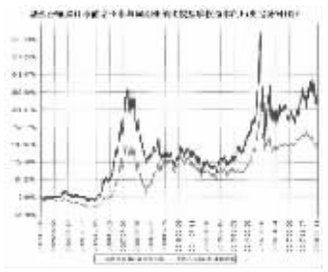
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.61%	1.57%	-1.01%	0.88%	-6.60%	0.69%

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



§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		
李进	本基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年1月4日	-	8年	李进先生,武汉大学金融学专业硕士。2007年7月至2010年2月任职于中国农业银行深圳分行,担任信贷审批员,2010年3月至2013年8月任职于华泰联合证券研究所,担任研究员。自2013年8月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理。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

2018年第三季度本基金收益率为-7.61%。

2018年第三季度本基金保持中性仓位,配置方面以医药、新能源、高端制造、军工、通信等行业为主。基于对市场的判断和产业的发展趋势,2018年第四季度的组合配置大概率会与2018年第三季度相同,同时精选业绩可持续成长的个股。

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0.971元;本报告期基金份额净值增长率为-7.61%,业绩比较基准收益率为-1.01%。

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	366,969,420.68	74.21
	其中:股票	366,969,420.68	74.21
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	114,328,278.46	23.12
8	其他资产	13,230,178.19	2.68
9	合计	494,527,877.33	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	320,743,396.86	65.11
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	-	-
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	40,884,723.82	8.30
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	5,341,300.00	1.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	366,969,420.68	74.50

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	300122	智飞生物	990,963	48,517,548.48	9.85
2	300567	精测电子	665,014	45,320,704.10	9.20
3	300450	先导智能	1,625,696	42,723,290.88	8.67
4	300601	康泰生物	877,443	38,168,770.50	7.75
5	300357	我武生物	587,701	26,358,389.85	5.35
6	002463	沪电股份	3,731,283	24,066,775.35	4.89
7	300308	中际旭创	504,000	21,823,200.00	4.43
8	600967	内蒙一机	1,449,956	20,067,391.04	4.07
9	002410	广联达	695,084	18,614,349.52	3.78
10	300571	平治信息	279,802	15,990,684.30	3.25

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	285,784.76
2	应收证券清算款	12,079,802.66
3	应收股利	-
4	应收利息	27,948.24
5	应收申购款	836,642.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,230,178.19

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

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	548,158,318.48
报告期期间基金总申购份额	72,422,550.76
减:报告期期间基金总赎回份额	113,226,418.54
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	507,354,450.70

§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鸿利收益证券投资基金变更注册为宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金的文件。

《宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈鸿利收益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28号凯晨世贸中心东座F9

9.3 查阅方式

上述备查文件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10月25日

宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月25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10月24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2018年7月1日起至9月30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	2,934,474,981.69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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-160,829,325.91
2.本期利润	-155,142,702.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0526
4.期末基金资产净值	1,722,366,468.70
5.期末基金份额净值	0.587

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。

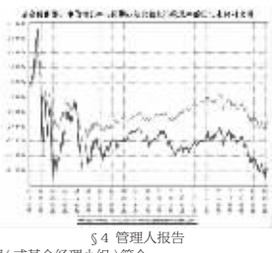
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.28%	1.53%	-1.99%	0.92%	-6.29%	0.61%

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



§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		
黎晓晖	本基金基金经理	2017年9月19日	-	9年	黎晓晖先生,香港中文大学MBA,2009年6月至2013年6月任职于嘉实基金管理有限公司,担任交易员;2013年7月至2017年8月任职于银华基金管理有限公司,先后担任研究员、投资经理。2017年8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

2018年三季度末,本基金股票仓位为89.99%,较上季度末上升2.85个百分点。在报告期内,采取了较高的仓位策略,主要区间为75%-90%。本基金的持仓结构在三季度出现了一定的调整:减仓了房地产和受房地产政策影响比较大的家具行业,加仓了银行至标配,加仓了航空。

2018年三季度,宏观经济表现出一定的韧性,经济增速基本平稳。政策方面,财税改革在内的扩大内需政策出台,部分对冲了贸易摩擦对于经济的影响;多次降准也部分对冲了金融去杠杆带来的流动性紧缩;人民银行重启人民币逆周期因子,暂时稳定住了人民币汇率。现在市场的主要矛盾在于改革预期是否能落地和对于贸易摩擦的应对政策。

我们看到,管理层在应对市场系统性风险过程中,主要着力点在金融改革、财税改革、扩大开放和对于基本经济制度的明确。四季度,随着政策的落地,在A股低估值的背景下,叠加市场前期累计了较大的跌幅,市场有一定的反弹需求。

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0.587元;本报告期基金份额净值增长率为-8.28%,业绩比较基准收益率为-1.99%。

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	1,550,008,072.84	88.82
	其中:股票	1,550,008,072.84	88.82
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	79,990,239.99	4.58
	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	113,870,260.02	6.53
8	其他资产	1,256,637.09	0.07
9	合计	1,745,125,209.94	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	22,490,370.00	1.31
C	制造业	686,483,227.13	39.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,956,660.00	0.98
E	建筑业	108,232.20	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	141,889,382.00	8.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,862,773.78	9.75
J	金融业	352,313,191.25	20.46
K	房地产业	53,432,678.00	3.10
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	91,363,108.80	5.30
R	文化、体育和娱乐业	17,108,449.68	0.99
S	综合	-	-
	合计	1,550,008,072.84	89.99

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	002202	金风科技	8,100,731	97,289,779.31	5.65
2	002044	美年健康	5,302,560	91,363,108.80	5.30
3	600036	招商银行	2,692,024	82,618,216.56	4.80
4	300059	东方财富	7,200,298	81,003,352.50	4.70
5	600030	中信证券	3,972,548	66,301,826.12	3.85
6	601939	建设银行	8,926,989	64,631,400.36	3.75
7	000001	平安银行	5,767,300	63,728,665.00	3.70
8	002456	欧菲科技	4,416,400	59,577,236.00	3.46
9	601398	工商银行	9,834,600	57,034,142.00	3.31
10	300003	乐普医疗	1,809,676	56,744,666.60	3.29

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投资。

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除欧菲科技外未受到公开谴责、处罚。

欧菲科技股份有限公司(以下简称"欧菲科技")于2018年1月收到《深圳证监局关于对欧菲科技股份有限公司采取监管谈话措施的决定》,主要原因是子公司苏州欧菲光科技有限公司在2016年2月3日与苏州市相城区签订框架性意向协议后未做及时的信息披露。考虑到上述投资协议的签署及后续投资未对公司的资产、负债、权益和经营成果产生重要影响,并且上市公司在短期也采取了签订《补充协议》并予以公告的补救措施,根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条第二项的规定,监管机构对公司采取了监管谈话的行政监管措施。

欧菲科技股份有限公司(以下简称"公司")于2018年5月14日收到深圳证券交易所中小板公司管理部向公司出具的《关于对欧菲科技股份有限公司2017年年报的问询函》。后于2018年6月1日,公司披露《关于会计差错更正的公告》,称在2017年度报告中,误将控股股东业绩承诺补偿金额220,233,953.14元确认为营业外收入,对应的所得税影响33,035,092.97元确认为所得税费用。本次会计差错更正调减公司2017年度合并资产负债表未分配利润项目179,097,645.74元,调增资本公积项目187,198,860.17元,调减盈余公积项目8,101,214.43元;调减公司2017年度合并利润表营业外收入、所得税费用、净利润项目分别为220,233,953.14元、33,035,092.97元、187,198,860.17元,净利润项目调整金额占更正后当年净利润的比例为22.8%。深圳交易所称上述行为违反了《股票上市规则(2018年修订)》第1.4条和第2.1条的规定,因此给予监管关注。

本基金关注到以上事件是欧菲科技公司在管理细节上的问题,在事件发生后,欧菲科技也立即启动了签订补充协议的措施,事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注欧菲科技自身业务发展的同时,也会持续关注公司在公司治理方面的改善,并将公司治理加入到对该公司的长期价值评估中。

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	962,803.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,892.11
5	应收申购款	235,941.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,256,637.09

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。

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	2,967,760,150.02
报告期期间基金总申购份额	21,686,733.45
减:报告期期间基金总赎回份额	54,941,901.78
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	2,934,474,981.69

§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	13,810,773.48
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	13,810,773.48
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.47

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转型动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈转型动力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28号凯晨世贸中心东座F9

9.3 查阅方式

上述备查文件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10月25日

东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴阿尔法灵活配置混合
基金主代码	000531
交易代码	000531
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月19日
报告期末基金份额总额	321,255,086.88份
投资目标	本基金为混合型基金,坚持以大类资产轮动为主、金融衍生品对冲投资为辅的投资策略,在有效控制风险的前提下,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则,强调投资纪律,避免因随意性投资带来的风险或损失。在大类资产配置方面,通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需及其体行业发展情况、证券市场估值水平等方面问题的深入研究,分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益,通过公司数量化模型确定资产配置比例并动态地优化管理。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于预期风险较高,预期收益也较高的基金产品。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-39,471,376.20
2.本期利润	-53,145,856.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1699
4.期末基金资产净值	366,180,682.32
5.期末基金份额净值	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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上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。

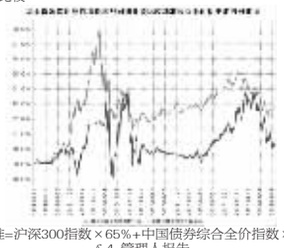
3.2 基金净值表现

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	-13.44%	1.51%	-1.14%	0.88%	-12.30%	0.63%

注:比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

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:比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

§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		
程涛	公司总经理助理兼投资总监、基金经理	2018年2月27日	-	15年	程涛,博士。曾任联合证券有限责任公司投资银行部高级经理,泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理,农银汇理基金管理有限公司基金经理、投资部总经理;2013年3月起阳光照耀同志加入东吴基金管理有限公司,曾任公司基金经理、总经理助理、首席投资官、专户投资总监等职,现任公司总经理助理兼投资总监,基金经理。其中,自2017年6月21日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2018年2月27日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2018年4月19日起担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(2017年12月25日由原东吴配置优化混合型证券投资基金转型)基金经理。其中,2013年8月1日至2015年2月6日任东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理,2013年8月1日至2015年2月6日任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理,2013年8月13日至2015年2月6日任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理,2014年3月19日至2015年4月14日任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

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