

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:二〇一二年八月二十五日

宝盈鸿利收益证券投资基金

2012 半年度报告摘要

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈鸿利收益开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的上市股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金管理人根据新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性及报表审核意见并出具报告。

注:“买入金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额 412,811,893.00

卖出股票的收入(成交)总额 454,402,128.18

注:“买入股票成本(成交)总额、卖出股票收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有因违法违规行为立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.9.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 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。

7.9.5 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股票。

7.9.6 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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

Table with columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额, 机构投资者持有比例, 个人投资者持有比例

2.2 期末本基金基金经理的从业机构持有本基金的情况

项目 持有份额总数(份) 占基金总份额比例

基金资产管理公司所有从业人员持有本开放式基金 988,260.00 0.1167%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为:50万份至100万份(含)。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为:10万份至50万份(含)。

8 开放式基金份额变动

单位:份

Table with columns: 基金合同生效日(2002年10月8日), 基金份额总额, 本报告期初基金份额总额, 本报告期基金份额净增加额, 本报告期末基金份额总额

10 重大事件提示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金管理人的基金投资策略遵循本基金基金合同中规定的投资策略,未发生变更。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

在本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

注:1、本基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为: ①实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币; ②财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定; ③经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚; ④内部管理规范,严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求; ⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能满足本基金提供全面信息服务要求; ⑥研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经纪机构的选择,与被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况: ① 租用交易单元情况 本报告期内未租用新交易单元。 ② 租出交易单元情况 本报告期内未租出已租用的交易单元。 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易成交金额, 回购交易成交金额, 权证交易成交金额

6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:宝盈鸿利收益证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

Table with columns: 资产, 附注号, 本期期末2012年6月30日, 上期期末2011年12月31日

资产: 银行存款 42,759,400.86, 11,725,897.63

其中:应收利息 1,806,267.53, 1,104,029.95

应收股利 703,865.50, 18,380.89

其他应收款 18,380.89, 5,142.74

其他流动资产 409,844,198.15, 401,781,115.55

负债和所有者权益: 应付管理人报酬 512,753.35, 543,590.39

应付托管费 85,458.90, 90,598.33

应付销售服务费 271,942.97, 159,941.96

应付利息 720.00, 720.00

应付股利 66,979,657.76, -15,768,923.58

其他应付款 5,142,217.78, 6,443,575.97

其他收入(损失以“-”号填列) 15,026.78, 5,697.28

减:二、费用 5,142,217.78, 6,443,575.97

1.管理人报酬 3,104,451.37, 3,966,236.78

2.托管费 85,458.90, 90,598.33

3.销售服务费 271,942.97, 159,941.96

4.交易费用 1,317,176.56, 1,542,048.87

5.利息支出 13,889.58, 83,693.37

其中:卖出回购金融资产支出 13,889.58, 83,693.37

6.其他费用 189,291.70, 190,557.48

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 15,185,529.87, -6,686,048.98

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 15,185,529.87, -6,686,048.98

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈鸿利收益证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

Table with columns: 项目, 本期2012年1月1日至2012年6月30日, 上期期末2011年6月30日

一、期初所有者权益(基金净值) 632,347,700.98, -232,767,335.94, 399,580,365.04

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) -15,185,529.87, -6,686,048.98, -6,686,048.98

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) -12,326,094.77, 4,736,951.96, -7,589,142.81

其中:1.基金申购款 43,802,280.04, -15,626,640.67, 28,175,639.37

2.基金赎回款 -56,128,374.81, 20,363,592.63, -35,764,782.18

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) -

五、期末所有者权益(基金净值) 620,021,606.21, -212,844,854.11, 407,176,752.10

报告附注为财务报表的组成部分。本报告由基金管理人、托管人、主管会计工作负责人、胡坤、会计师事务所共同编制。

6.4 财务报表

宝盈鸿利收益证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]第53号《关于同意宝盈鸿利收益证券投资基金设立的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《证券投资基金法》及其实施细则、《证券投资基金合同办法》等有关规定,并经中国证监会核准,于2002年10月8日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集(包括认购利息)共募集1,446,415,713.90元,其中:宝盈华亚中关会计师事务所有限公司普华永道(中国)2002年第117号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《宝盈鸿利收益证券投资基金招募说明书》和《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金于2008年3月5日进行了基金份额折算,拆分比例为1:1.36525682,并于2008年3月5日进行了变更登记。

6.2 利润表

会计主体:宝盈鸿利收益证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

Table with columns: 项目, 本期2012年1月1日至2012年6月30日, 上期可比期间2011年1月1日至2011年6月30日

一、营业收入 20,327,747.65, -242,473.01

1.利息收入 1,567,708.05, 1,659,612.92

其中:存款利息收入 136,339.77, 63,500.51

债券利息收入 1,431,368.28, 1,596,112.41

买入返售金融资产收入 -

其他利息收入 -

2.其他业务收入 355,417.16, 95,837.36

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 66,979,657.76, -15,768,923.58

4.汇兑收益(损失以“-”号填列) -

5.其他收入(损失以“-”号填列) 15,026.78, 5,697.28

减:二、费用 5,142,217.78, 6,443,575.97

1.管理人报酬 3,104,451.37, 3,966,236.78

2.托管费 85,458.90, 90,598.33

3.销售服务费 271,942.97, 159,941.96

4.交易费用 1,317,176.56, 1,542,048.87

5.利息支出 13,889.58, 83,693.37

其中:卖出回购金融资产支出 13,889.58, 83,693.37

6.其他费用 189,291.70, 190,557.48

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 15,185,529.87, -6,686,048.98

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 15,185,529.87, -6,686,048.98

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈鸿利收益证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

Table with columns: 项目, 本期2012年1月1日至2012年6月30日, 上期可比期间2011年6月30日

一、期初所有者权益(基金净值) 632,347,700.98, -232,767,335.94, 399,580,365.04

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) -15,185,529.87, -6,686,048.98, -6,686,048.98

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) -12,326,094.77, 4,736,951.96, -7,589,142.81

其中:1.基金申购款 43,802,280.04, -15,626,640.67, 28,175,639.37

2.基金赎回款 -56,128,374.81, 20,363,592.63, -35,764,782.18

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) -

五、期末所有者权益(基金净值) 620,021,606.21, -212,844,854.11, 407,176,752.10

报告附注为财务报表的组成部分。本报告由基金管理人、托管人、主管会计工作负责人、胡坤、会计师事务所共同编制。

6.4 财务报表