

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	金额单位:人民币元
				占期初基金资产净值比例(%)
1	601669	中国水电	104,582,145.05	7.47
2	600056	中国医药	59,173,672.96	4.34
3	300059	东方财富	45,941,466.67	3.37
4	002638	鹏上光电	45,368,290.96	3.33
5	002549	凯美特气	42,720,904.31	3.21
6	002589	福临生物	31,780,467.55	2.33
7	002629	仁智油服	30,516,378.54	2.24
8	002179	中航光电	28,105,857.05	2.06
9	600331	宏达股份	21,503,893.71	1.58
10	300187	美清环保	19,488,800.13	1.43
11	300050	世纪锦联	17,891,895.30	1.32
12	002268	王中王酒	15,915,536.38	1.17
13	600011	华能国际	15,745,280.12	1.15
14	002641	永高股份	15,160,032.32	1.11
15	300223	北京君正	14,416,477.59	1.06
16	600697	欧亚集团	13,910,187.71	1.02
17	300223	瀚蓝环保	13,019,105.96	0.95
18	001318	中国平安	13,000,000.00	0.95
19	300229	拓尔思	12,443,954.36	0.91
20	300260	新莱应材	11,877,901.32	0.87

金额单位：人民币元				
关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华泰联合证券	-	-	556,757,824.22	18.55%
6.4.8.1.2应支付关联方的佣金				
金额单位：人民币元				
关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	当期 佣金	占当期佣金 总额的 比例	期末未支付 佣金	占期末未支付 佣金 总额的 比例

	利息	总账的比例	利息余额	总账的比例
关联方名称	上年度可比期间			
	2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期	占当期期末	期末应付	占期末应付
		总量的比例	佣金余额	佣金的比例
华泰联合证券	473,243.49	18.93%	-	-
6.4.8.2 关联方报酬				
6.4.8.2.1 基金管理费				

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管 理费	9,960,688.75	12,470,168.29
支付销售机构的客户维 持费	-	-

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,660,114.83	2,078,361.38

注：支付基金托管人中国农业银行的基础托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \frac{\text{基金资产净值} \times 0.25\%}{\text{当年天数}}$$
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券回购交易
本基金未参与关联方银行间同业市场的债券回购交易。

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

项目	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	0.25%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

6.4.8.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
份额单位：份		

关联方名称	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例
中国对外经济贸易 信托有限公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
华联联合证券有限 责任公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
重庆国际信托有限 公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
天津信托投资有限 责任公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
山东省国际信托有 限公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%

注：本基金以上各关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

6.2.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

[illegible]

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中待购协议余额

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末2012年6月30日止，基金从事债券正回购证券融资形成的卖出回购证券款余额为0.00元，期限为2012年7月12日至到期日。该类交易由基金在回购期内持有相应形式回购下入质押库中的债券，按证券交易所规定的比例折价有标准审核后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	999,389,847.21	69.91
	其中:股票	999,389,847.21	69.91
2	固定收益投资	284,239,715.90	19.88
	其中:债券	284,239,715.90	19.88
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	8,116,821.35	0.57
6	其他各项资产	137,754,463.85	9.64
	合计	1,429,500,848.31	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码		行业类别	公允价值	金额单位:人民币元 占基金资产净值比例(%)
A		农、林、牧、渔业	-	-
B		采掘业	25,829,565.30	1.93
C		制造业	446,510,828.96	33.28
C0		食品、饮料	80,324,838.08	5.99
C1		纺织、服装、皮毛	35,470,149.36	2.64
C2		木材、家具	-	-
C3		造纸、印刷	-	-
C4		石油、化学、塑胶、塑料	45,314,362.10	3.38
C5		电子	443,942,994.28	3.24
C6		金属、非金属	21,518,300.00	1.60
C7		机械、设备、仪表	100,916,806.90	7.52
C8		医药、生物制品	25,961,272.96	1.93
C99		其他制造业	93,562,105.28	6.97
D		电力、煤气及水的生产和供应业	33,316,091.57	2.48

E	建筑业	65,174,660.70	4.86
F	交通运输、仓储业	86,756,723.60	6.47
G	信息技术业	171,389,754.38	12.77
H	批发和零售贸易	84,031,763.81	6.26
I	金融、保险业	63,095,305.86	4.70
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	20,369,397.11	1.52
L	传播与文化业	-	-
M	综合类	2,915,755.92	0.22
	合计	999,389,847.21	74.49

7.3 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	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	002549 凯美特气	5,966,971	93,562,105.28	6.97
2	300229 拓尔思	5,966,598	82,339,050.40	6.14
3	601669 中国水电	14,914,110	65,174,660.70	4.86

4	002589	瑞康医药	1,714,116	56,480,122.20	4.21
5	002023	海特高新	6,173,595	54,821,523.60	4.09
6	300044	赛为智能	3,186,664	38,781,700.88	2.89
7	600439	瑞贝卡	6,544,308	35,470,149.36	2.64
8	002230	科大讯飞	1,795,103	32,363,529.10	2.64
9	002638	鹏上光电	2,075,832	32,798,145.60	2.44
10	000581	威孚高科	1,123,139	30,774,008.60	2.29

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于宝盈基金管理有限公司网站 <http://www.fundons.com> 网站的半年度报告全文。

7.4 报告期内基金投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

				金额单位：人民币元	
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)	
1	000581	威孚高科	43,700,353.31	3.20	
2	601601	中国太保	31,185,908.78	2.29	
3	300229	拓尔思	30,165,015.26	2.21	

4	600028	中国石化	28,799,090.75	2.11
5	600616	金枫酒业	24,150,514.02	1.77
6	002549	凯美特气	23,307,961.98	1.71
7	600029	南方航空	23,076,073.38	1.69
8	600059	古越龙山	21,496,232.10	1.58
9	601628	中国人寿	20,037,965.92	1.47
10	300323	华灿光电	20,000,000.00	1.47
11	3001318	华灿光电	19,702,490.00	1.46
12	002660	茂硕光电	17,945,000.00	1.32
13	002230	科达电源	16,942,580.82	1.24
14	000876	新希望	16,836,237.54	1.23
15	002254	泰和新材	15,872,078.24	1.16
16	000063	中兴通讯	15,455,352.42	1.13
17	000887	中鼎股份	15,204,457.57	1.11
18	600969	郴电国际	15,165,109.02	1.11
19	600795	国电电力	14,925,527.00	1.09
20	600011	华能国际	14,041,180.21	1.03

注：1.买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。
2.“买入股票成本”按买入成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

二〇一二年八月二十五日