鸿阳证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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:二〇一三年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2013年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	宝盈鸿阳封闭
基金主代码	184728
交易代码	184728
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001年12月10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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2001年12月18日

2.2基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良而稳定的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险,在保持基金资产良好的流动性的基础上,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳利益。
投资策略	作为成长价值复合型基金,本基金股票投资包括两部分:一部分为成长型投资,另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整,但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的30%,最高均不得高于股票投资总额的70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则,在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合,分散和降低投资风险,确保基金资产安全,谋求基金长期稳定的收益。
业绩比较基准	–
风险收益特征	风险水平和期望收益适中。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙胜华	李芳菲
	联系电话	0755-83276688	010-66060069
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95599
传真		0755-83515599	010-63201816

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	23,077,458.58
本期利润	90,726,861.97
加权平均基金份额本期利润	0.0454
本期基金份额净值增长率	6.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2890
期末基金资产净值	1,441,085,417.81
期末基金份额净值	0.7205

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。

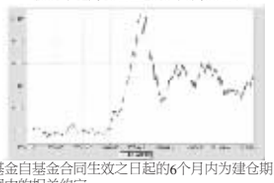
3.2基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-8.91%	2.21%	-	-	-	-
过去三个月	2.77%	2.49%	-	-	-	-
过去六个月	6.71%	2.56%	-	-	-	-
过去一年	7.41%	2.49%	-	-	-	-
过去三年	3.97%	2.40%	-	-	-	-
自基金成立起至今	102.80%	2.71%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

鸿阳证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2001年12月10日至2013年6月30日)



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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人:宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会"新的治理结构、新的内控体系"标准设立的首批基金管理公司之一,2001年5月18日成立,注册资本为人民币1亿元,注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长、宝盈增强收益、宝盈资源优选、宝盈核心优势、宝盈货币、宝盈中证100九只基金,公司恪守价值投资的投资理念,并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队,在研究方面,公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才,为公司的投资决策提供科学的研究支持;在投资方面,公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验,以自己的专业知识致力于获得良好业绩,努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
彭敢	本基金基金经理、宝盈资源优选股票型证券投资基金基金经理	2010-12-29	-	12年	彭敢先生,金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部,现同时担任宝盈资源优选股票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。
杨凯	本基金基金经理兼总经理助理	2013-02-05	-	9年	杨凯先生,中山大学岭南学院工商管理硕士。2003年7月至今在宝盈基金管理有限公司工作,先后担任产品设计师、市场部总监,特定客户资产管理部投资经理、总监,研究部总监等职务。现任宝盈基金管理有限公司总经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

注:1、本基金基金经理均非首任基金经理,其"任职日期"指根据公司决定确定的聘任日期;

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》的相关规定,证券从业年限的计算截至2013年6月30日。

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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年,我国A股市场风格指数走势显著差异,代表大盘股的沪深300指数涨幅-12.78%,而创业板指数涨幅41.71%。主要原因是投资者对我国经济转型预期强烈,对新经济满怀美好憧憬。从行业景气数据来看,以电子、传媒、环保及消费为代表的新经济经营情况比传统产业好,并持续走强,进一步强化了创业板指数及中小盘指数的上涨趋势。

本基金在今年二月份新增了基金经理参与组合管理,对组合进行了适度调整,主要是卖出了部分滞涨的大盘股(如中国水电、中国太保),增加了银行地产以均衡组合配置,增加了汽车、电子等行业的配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金的份额净值为0.7205元。本报告期内本基金的份额净值增长率为6.71%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在一季报中我们展望"在一个转型期的经济周期,我们更多是看到经济的窄幅波动甚至温和下行,直到新经济增长点的出现"。今年二季度以来,以GDP、工业增加值、PMI等经济指标衡量的整体经济景气向下,但从分行业来看,汽车、家电、消费、电子、计算机及软件、传媒和环保等行业景气继续向上。随着利率市场化的推进,融资成本会抬升,资金整体将略显紧张,依赖资本投资拉动增长的发展模式会受到进一步的制约,从而对传统金融行业、依赖资本支出的企业、依赖于固定资产投资的产业发展会受到很大的影响。随着科技进步和生活方式的改变,对提高生活质量和生产效率的科技、文化传媒、环保、高端设备制造等行业将受益。随着国内工业制造水平和创新能力的提升,进口替代会继续演进,进一步推动我国高端设备制造、消费电子制造业的发展。

一个公司的成长,无非是所在行业的持续增长或者市场份额的提升,以及规模化带来的成本优势。选择一个好标的,就本基金经理而言,更多是在做行业研究,选择那些未来3-5年有可能持续增长的行业,投资其中的龙头公司,或者在一个稳定增长的行业里中,选出那些有可能份额持续提升的公司。行业是第一位的,其次是公司质量,两者都重要。

展望下半年的投资,我们依然会重点投资景气行业的优质公司,目前,该类公司整体估值偏高,我们会根据估值适时调整参与的仓位。理论上讲,只要股价足够低,任何企业都有投资机会,传统产业受政策刺激、股价超跌等因素的影响时也具备一定的投资机会,但会以参与反弹的方式投资。在大小盘风格方面,我们会适度均衡,以平衡组合净值的波动。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新本基金管理人按照新会计准则、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发表审核意见并出具报告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查,并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组,由投资部、研究部、固定收益部、特定客户资产管理部、金融工程部、基金事务部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。投资部、研究部、固定收益部、特定客户资产管理部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价;金融工程部负责对估值模型及方法进行筛选,选择最具适用性的估值模型及参数,并负责估值模型的选择及测算;基金事务部负责进行日常估值,并与托管行的估值结果核对一致;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管鸿阳证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《鸿阳证券投资基金基金合同》、《鸿阳证券投资基金托管协议》的约定,对鸿阳证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,宝盈基金管理有限公司在鸿阳证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的鸿阳证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

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:鸿阳证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		21,468,544.79	99,515,574.45
结算备付金		2,126,602.94	880,912.48
存出保证金		443,231.18	1,750,000.00
交易性金融资产		1,415,719,009.40	1,265,629,694.94
其中:股票投资		1,104,518,353.60	971,187,172.94
基金投资		-	-
债券投资		311,200,655.80	294,442,522.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	4,378,144.69
应收利息		4,839,221.83	3,162,575.02
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,444,596,610.14	1,375,316,901.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	20,434,725.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,854,964.90	1,602,735.70
应付托管费		309,160.81	267,122.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		850,957.75	703,761.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		496,108.87	1,950,000.00
负债合计		3,511,192.33	24,958,345.74
所有者权益:			
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润		-558,914,582.19	-649,641,444.16
所有者权益合计		1,441,085,417.81	1,350,358,555.84
负债和所有者权益总计		1,444,596,610.14	1,375,316,901.58

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.7205元,基金份额总额2,000,000,000.00份。

6.2利润表

会计主体:鸿阳证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		106,947,042.54	-7,712,935.03
1.利息收入		4,990,181.42	4,754,390.20
其中:存款利息收入		182,714.35	310,477.58
债券利息收入		4,807,467.07	4,112,975.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	330,936.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		34,307,457.73	-91,334,695.51
其中:股票投资收益		28,047,634.99	-98,246,955.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益		21,933.86	169,458.41
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		6,237,888.88	6,742,801.11
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		67,649,403.39	78,867,370.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		16,220,180.57	14,299,340.48
1.管理人报酬		10,756,108.68	9,960,688.75
2.托管费		1,792,684.74	1,660,114.83
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		3,433,039.71	2,149,195.63
5.利息支出		-	287,520.95
其中:卖出回购金融资产支出		-	287,520.95
6.其他费用		238,347.44	241,820.32
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		90,726,861.97	-22,012,275.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		90,726,861.97	-22,012,275.51

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鸿阳证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-649,641,444.16	1,350,358,555.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	90,726,861.97	90,726,861.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	2,000,000,000.00	-558,914,582.19	1,441,085,417.81
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-636,289,413.37	1,363,710,586.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-22,012,275.51	-22,012,275.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	2,000,000,000.00	-658,301,688.88	1,341,698,311.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:汪钦,主管会计工作负责人:胡坤,会计机构负责人:何瑜

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

鸿阳证券投资基金(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[2001]第51号《关于同意鸿飞证券投资基金上市、扩募并续期及鸿阳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《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《鸿阳证券投资基金基金契约》(后更名为《鸿阳证券投资基金基金合同》)发起,并于2001年12月10日募集成立。本基金为契约型封闭式,发起人为中国对外经济贸易信托投资有限公司(后更名为:中国对外经济贸易信托有限公司)、联合证券有限责任公司(后更名为:华泰联合证券有限责任公司)、重庆国际信托投资有限公司(后更名为:重庆国际信托有限公司)、天津信托投资有限责任公司、山东省国际信托投资有限公司(后更名为:山东省国际信托有限公司)及宝盈基金管理有限公司,存续期限为15年,发行规模为20亿份基金份额,共计人民币20亿元,业经大华会计师事务所有限公司华业字[2001]1198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《中华人民共和国证券投资基金法》和《鸿阳证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性和收益性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。基金的投资组合为:投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。本基金无业绩比较基准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鸿阳证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,756,108.68	9,960,688.75
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,792,684.74	1,660,114.83

注:支付基金托管人中国农业银行的基金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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	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%
华泰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:1、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。

2、以上各关联方均为本基金发起人。

6.4.8.5 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

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	21,468,544.79	162,164.42	2,462,322.00	288,427.55

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002660	茂硕电源	2013-06-06	资产重组	11.77	2013-07-19	10.59	80,000	641,626.00	941,600.00	-
300166	东方国信	2013-05-20	资产重组	16.45	2013-08-02	18.10	1,677,627	22,377,430.12	27,596,964.15	-
300256	星星科技	2013-05-17	资产重组	13.01	2013-08-09	14.31	1,075,200	14,725,354.69	13,988,352.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

本基金本报告期末无交易所债券正回购交易余额。

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	1,104,518,353.60	76.46
	其中:股票	1,104,518,353.60	76.46
2	固定收益投资	311,200,655.80	21.54
	其中:债券	311,200,655.80	21.54
	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	23,595,147.73	1.63
6	其他各项资产	5,282,453.01	0.37
7	合计	1,444,596,610.14	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	614,922,014.72	42.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,906,571.29	1.52
E	建筑业	28,275,247.28	1.96
F	批发和零售业	84,997,663.08	5.90
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	145,142,493.55	10.07
J	金融业	136,830,574.48	9.49
K	房地产业	51,710,342.00	3.59
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	20,733,447.20	1.44
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	1,104,518,353.60	76.64

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002549	凯美特气	5,514,177	72,787,136.40	5.05
2	002589	瑞康医药	1,614,180	68,651,075.40	4.76
3	002230	科大讯飞	1,216,137	56,185,529.40	3.90
4	300229	拓尔思	2,500,000	49,150,000.00	3.41
5	601318	中国平安	1,394,500	48,472,820.00	3.36
6	300136	信维通信	1,877,785	45,630,175.50	3.17
7	002023	海特高新	2,997,210	33,808,528.80	2.35
8	601166	兴业银行	2,288,437	33,800,214.49	2.35
9	600162	香江控股	5,819,850	32,707,557.00	2.27
10	002690	美亚光电	1,350,432	32,450,880.96	2.25

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.byfunds.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票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	000858	五粮液	40,880,151.57	3.03
2	000001	平安银行	40,566,759.66	3.00
3	002429	兆驰股份	39,669,866.85	2.94
4	601166	兴业银行	37,434,917.00	2.77
5	600162	香江控股	36,998,493.00	2.74
6	300136	信维通信	36,226,327.05	2.68
7	300115	长盈精密	35,659,160.95	2.64
8	601901	方正证券	34,241,957.25	2.54
9	601117	中国化学	32,304,298.62	2.39
10	600978	宜华木业	31,688,969.18	2.35
11	002690	美亚光电	31,259,662.22	2.31
12	000725	京东方A	28,895,500.00	2.14
13	002048	宁波华翔	28,880,924.68	2.14
14	000069	华侨城A	27,133,756.85	2.01
15	600418	江淮汽车	25,983,129.92	1.92