宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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
送出日期:2015年8月27日

§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2015年8月26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2015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	宝盈科技30混合
基金主代码	000698
交易代码	000698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月13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	3,664,151,889.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置,重点投资于以科学技术创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司,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	中证800指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%
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。

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	张璀	林葛
	联系电话	0755-83276688	010-66060069
	电子邮箱	zhangc@byfunds.com	lgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95599
传真		0755-83515599	010-68121816

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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	614,847,367.84
本期利润	-643,814,403.26
加权平均基金份额本期利润	-0.4025
本期基金份额净值增长率	81.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4270
期末基金资产净值	7,582,128,896.20
期末基金份额净值	2.069

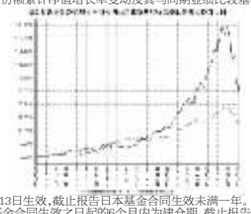
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
4、本基金合同于2014年8月13日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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	-21.60%	4.34%	-4.73%	2.11%	-16.87%	2.23%
过去三个月	21.99%	3.23%	9.62%	1.58%	12.37%	1.65%
过去六个月	81.33%	2.50%	22.99%	1.32%	58.34%	1.18%
自基金合同生效起至今	106.90%	2.05%	54.24%	1.11%	52.66%	0.94%

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



注:1、本基金合同于2014年8月13日生效,截止报告日本基金合同生效未满一年。
2、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,截止报告期末本基金仍处于建仓期。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、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选股票、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证100指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技30混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合十七只基金,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,以自己的专业知识做力于获得良好业绩,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)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭敢	本基金、宝盈资源优选股票型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;投资决策总监	2014年8月13日	-	14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。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈资源优选股票型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2015年1月30日	-	4年	易祚兴先生,浙江大学计算机应用硕士。历任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员,2014年11月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

注:1、彭敢为首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写;
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2015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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年A股市场呈现整体牛市氛围,领涨全球,首先以创业板为主的成长股经历了一季度的强势后,二季度依然得到强劲延续,同样的大盘蓝筹走势也极为强劲,上证指数、沪深300、深成指和创业板指分别上涨 32.23%、30.17%、26.58%和94.23%,半年度创业板指数整体强于大势,指数和成交量也屡创历史新高。本基金在上半年实现收益81.33%,为投资者取得了一定的投资收益。

本基金管理人认为,本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑,虽然从实体经济的增速来看,中国经济仍然在持续的下滑调整过程中,政府需要通过各种货币政策工具操作来降低实体经济利率;但是,政府依然能有决心实现稳步的经济增长,同时也大力支持发展新兴产业,无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展,都能体现国家对经济结构转型升级的决心。在过去半年,本基金管理人一直以代表经济增长转型的战略性新兴产业个股作为重点投资标的,虽然结果来看投资收益不能算顶级,但基本能按照本基金管理人的投资理念来执行,虽然在一季度和二季度初能获取较高收益,但是由于6月份市场出现了系统性调整,并没有较好的控制住回撤风险,需要将系统性风险和短期博弈因素考虑进去,整体来说,仍对过去半年所取得的成绩是比较满意的。

2015年上半年依然延续了成长风格强劲走势,且小市值股票遭到跟风热炒,同时,大盘蓝筹然坚挺,上证指数接连创出7年新高,虽然整个季度市场表象上与基金管理人的理念基本吻合,但在实际操作中,基金管理人坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来来操作,在板块选择上坚持选择与过往市场不同的投资方向和成长主题,虽然由此也丧失了一些投资机会,也未能将提前布局的优质成长股受益最大化等,但从整体结果来看,较为理想。半年末主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、新能源等方向。

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2.069元。本报告期内本基金的份额净值收益率为81.33%,业绩比较基准收益率为22.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年中国的宏观经济仍然处于持续触底的过程,尽管政府出台了多项改革和稳增长的财政和货币政策,但经济增长的固有规律在发挥作用,过剩产能以及前期大量的房地产和固定资产投资仍然成为经济的主要风险。而油价的大幅下跌虽然短期有利于中国经济成本降低,但是完全带来输入性通缩,并与产能过剩带来的内在的经济通缩叠加,对企业经营已经构成了下行压力,目前来看国家在稳定经济下行过快的局面下,依然能有出强有力的转型决心。

从市场来看,上半年股票市场的火爆吸引了大量社会资金跑步奔向股市,并带来明显的泡沫。六月中旬开始的快速调整让投资者对未来的市场走势产生恐惧,市场情绪低迷,空头控制了短期市场。但基金管理人认为,2014年以来的牛市的基因仍在,首先宽松的货币政策也许在边际上未必能产生上半年那种持续宽松,但仍有继续宽松的空间,而且中期内不可能紧缩。其次从制度红利来看,中国政府对资本市场和国企治理的决心已为肃清登陆,沪港通、深港通、证券法修改及注册制等都是资本市场已发生或即将发生的重大影响意义的事件;同时国企治理对改革转型起到关键性作用,国有资产证券化是较好的实现途径。从长期看,中国通过改革转型提升经济增长的空间仍然很大,新的国家战略如"一带一路"的提出等让市场预期政府会通过向全球输出中国的高铁等优势产业来缓解产能过剩问题。同样的,"互联网+"为主要手段的各行业互联网化趋势逐渐确立,尽管短期内,由于股价巨大的调整会伤害投资者的信心,但互联网金融、互联网医疗、互联网能源以及互联网农业等在转型升级的中国带来了很多投资机遇和新的产业形态。最后,在预期稳定的情况下,居民大类资产配置从储蓄、房产、其他理财产品向股权转移的趋势不大可能发生转变。中国自加入世贸以来积累了巨大的财富,财富的重新转移配置是股票市场最大的牛市因素。

当然我们也需要看到目前市场的一些主要风险因素,正如我们前面已经提到的:1.投资者的对经济企稳和政治体系稳定的基金管理人认为,从行为金融学来看,2015下半年市场的走势可能仍然会显著偏离市场的一致判断,我们在给予投资者市场的一些共识的时候更需要考察这些共识的基础和条件,而从这些条件来看,市场的一些共识并不是那么靠得住的。二季度,头两个月的市场走势强劲,创新高速度超市场预期,同时,6月份的加速调整回落也让市场参与者顿时惊慌失措,总之,本轮牛市中叠加了杠杆因素,是大多数市场参与者没有经历过的,我们一方面对全年市场保持积极乐观态度,尤其是优质新兴成长股需要重视其新商业模式、新技术及逐步体现业绩叠加对市场产生正反馈带来的投资机会,另一方面,也需要关注杠杆融资获利盘带来的短期冲击,国内资本市场已经逐步完善,金融衍生品会越来越丰富,会让市场投资手段多样化的同时,也必然会带来较大的波动,需要重视博弈的因素。

基金管理人秉承几个最基本的投资理念:1.投资不可能赚到所有的钱,投资要赚自己所理解和能把握的钱。投资收益有两类钱,一类是市场博弈赚图形的钱,我的收益即是他人的亏损。在这个充分竞争的市场机会本基金管理人不可能持久赚到博弈的钱;2.第二类投资收益是赚公司成长的钱。优质的成长股不管在哪种市场风口,最后必然超越市场涨幅,在无法判断市场风向的市场,挑选最强健的骑者。尤其是成长空间巨大的公司,要有充分的耐心,这是本基金管理人的目标收益;3.中国的经济已经进入必须转型的阶段,中国经济的核心不可能是靠地产和传统国企来支撑。变革和转型创新是中国经济更重要的部分。而目前传统产业在中国股票市场中的市值比率并不低,而估值在经历过去一个季度的大幅上涨之后与国际水平相比并不具有显著的优势。

因此,管理人判断2015年下半年市场将面临几年来最为复杂多变的局面。理念比对市场的判断会更有价值,我们坚持看好新蓝筹(有别于传统钢铁水泥类产业的新产业蓝筹)、新成长(面向未来的快速增长行业和新兴产业)、新主题(收购兼并行业整合)。基金管理人在2015年三季度将按照上述思路来操作,在优选成长股的同时,利用市场调整期间布局优质新蓝筹股,实现长期均衡配置。

本基金将继续重点以个股投资价值判断为主,继续采取自下而上的投资策略。基金管理人将坚持价值投资的理念,结合科技30基金重点投资技术资源、渠道资源、品牌资源的特点,为投资者追求较高的收益。

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人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、专户投资部、量化投资部、基金运营部、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、专户投资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;量化投资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;基金运营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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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

在托管宝盈科技30灵活配置混合型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》相关法律法规的规定以及《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的约定,对宝盈策科技30灵活配置混合型证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司2015年1月1日至2015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宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,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宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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:宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	161,970,646.72	17,902,201.28
结算备付金		71,276,589.49	987,713.66
存出保证金		1,942,859.09	366,620.40
交易性金融资产	6.4.7.2	8,241,796,672.73	672,209,167.62
其中:股票投资		7,891,380,889.43	632,489,317.62
基金投资		-	-
债券投资		350,415,783.30	39,719,850.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		680,318,097.40	4,501,259.55
应收利息	6.4.7.5	9,677,389.29	797,568.29
应收股利		-	-
应收申购款		23,505,703.18	637,016.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,190,487,957.90	697,401,547.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		352,100,000.00	-
应付证券清算款		-	4,297,225.02
应付赎回款		1,223,781,533.71	5,762,824.22
应付管理人报酬		14,224,522.74	1,044,752.57
应付托管费		2,370,753.81	174,125.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,563,653.48	954,332.93
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,318,597.96	97,066.56
负债合计		1,608,359,061.70	12,330,326.72
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,664,151,889.79	600,626,226.79
未分配利润	6.4.7.10	3,917,977,006.41	84,444,993.77
所有者权益合计		7,582,128,896.20	685,071,220.56
负债和所有者权益总计		9,190,487,957.90	697,401,547.28

注:1,报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.069元,基金份额总额3,664,151,889.79份。

6.2 利润表
会计主体:宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入		-590,618,690.66
1.利息收入		3,519,023.21
其中:存款利息收入	6.4.7.11	880,688.24
债券利息收入		2,638,334.97
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		609,425,272.10
其中:股票投资收益	6.4.7.12	601,200,770.72
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-79,400.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	8,303,901.38
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-1,258,661,771.10
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	55,098,785.13
减:二、费用		53,195,712.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,435,922.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,405,987.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	21,689,117.10
5. 利息支出		450,473.22
其中:卖出回购金融资产支出		450,473.22
6. 其他费用	6.4.7.20	214,212.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-643,814,403.26
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-643,814,403.26

注:本基金合同生效日为2014年8月13日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	600,626,226.79	84,444,993.77	685,071,220.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-643,814,403.26	-643,814,403.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"填列)	3,063,525,663.00	4,477,346,415.90	7,540,872,078.90
其中:1.基金申购款	6,724,521,269.55	9,143,989,580.04	15,868,510,849.59
2.基金赎回款	-3,660,995,606.55	-4,666,643,164.14	-8,327,638,770.69
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)	3,664,151,889.79	3,917,977,006.41	7,582,128,896.20

注:本基金合同生效日为2014年8月13日,无上年度可比期间数据。

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:

王铁 胡坤 何瑜

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金(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")证监许可[2014]580号《关于核准宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息募集1,291,165,490.52元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第445号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,291,529,429.81份基金份额,其中认购资金利息折合363,939.29份基金份额。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《宝盈科技30灵活配置混合型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较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0% - 95%,其中投资于基金持仓比例最高的前30只科技主题股票的资产不低于非现金基金资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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2015年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2015年6月30日的财务状况以及2015年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

除财务报表附注6.4.5.2.2外,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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用第三方估值机构提供的估值。对于证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所预立提供的估值结果确定公允价值。

自2015年3月27日起,本公司对旗下所有基金净值变动情况等有关信息。

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》及其他相关财税法规和实务操作,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。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,依照现行税法规定国20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(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(以下简称"宝盈基金公司")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称"农业银行")	基金托管人、基金代销机构

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

本基金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 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,435,922.92
其中:支付销售机构的客户维护费	8,038,121.70

注:支付基金管理人宝盈基金公司的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:

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值X1.5%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,405,987.13

注:支付基金托管人中国农业银行的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:

日托管费 = 前一日基金资产净值X0.25%/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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	161,970,646.72	697,440.62

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管,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

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000050	深圳A	2014年9月26日	2015年9月29日	非公开发行流通受限	14.60	21.17	956,700	13,967,820.00	20,253,339.00	-
002108	沧州明珠	2014年11月11日	2015年12月15日	非公开发行流通受限	14.38	12.39	887,697	7,508,876.50	10,998,565.83	2015年6月9日权益分派
601058	赛轮金宇	2014年11月28日	2015年11月26日	非公开发行流通受限	15.80	9.76	1,000,000	7,900,000.00	9,760,000.00	2015年5月8日权益分派
300488	恒锋工具	2015年6月25日	2015年7月1日	新股流通受限	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300480	光力科技	2015年6月25日	2015年7月2日	新股流通受限	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-

注:本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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
300094	国联水产	2015年6月29日	重大事项停牌	30.18	-	-	11,497,381	269,546,681.77	346,990,958.58	-
300373	扬杰科技	2015年6月9日	重大事项停牌	64.92	2015年7月14日	74.25	4,534,621	298,778,383.11	294,387,595.32	-
002622	浙江众成	2015年6月23日	重大事项停牌	26.64	2015年7月13日	27.54	10,672,996	234,110,178.86	284,328,613.44	-
300189	神农大丰	2015年6月1日	重大事项停牌	25.75	-	-	9,872,121	234,777,267.37	254,207,115.75	-
300047	天源迪科	2015年6月3日	重大事项停牌	23.99	2015年7月30日	32.29	7,228,840	208,524,210.02	173,419,871.60	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项停牌	52.73	-	-	2,968,947	149,366,981.35	156,552,575.31	-
600889	智慧能源	2015年5月11日	重大事项停牌	32.06	2015年7月31日