# 宝盈先进制造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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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 | 宝盈先进制造混合 |
| 基金主代码 | 000924 |
| 交易代码 | 000924 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年12月17日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,200,622,282.01份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于先进制造业上市公司的相关证券，力求把握先进制造业的发展契机，在严格控制风险的前提下，分享上市公司发展带来的投资收益，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。<br>本基金所定义的先进制造业上市公司是指具有较高技术附加值、能够引领产业发展方向的制造业企业。<br>本基金将以中国证监会公布的《上市公司行业分类指引》中界定的制造业上市公司为基础，依照以上标准进行进一步筛选或增补。 |
| 业绩比较基准 | 申银万国制造业指数×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。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张瑾 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | zhangj@byfunds.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-8888-300 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-83515599 | 010-66275853 |

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 | 885,432,490.30 |
| 本期利润 | 850,727,741.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3417 |
| 本期基金份额净值增长率 | 40.32% |
| 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 | 0.4133 |
| 期末基金资产净值 | 1,696,858,088.08 |
| 期末基金份额净值 | 1.413 |

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。

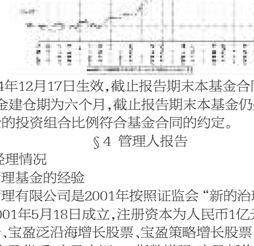
4、本基金合同于2014年12月17日生效，截止本报告期末基金合同生效未满一年。

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 | -25.63% | 4.16% | -10.25% | 2.66% | -15.38% | 1.50% |
| 过去三个月 | 13.49% | 3.28% | 18.77% | 2.05% | -5.28% | 1.23% |
| 过去六个月 | 40.32% | 2.50% | 50.41% | 1.62% | -10.09% | 0.88% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.30% | 2.40% | 43.88% | 1.60% | -2.58% | 0.80% |

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12月17日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定本基金建仓期为六个月，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 | | |
| 张小仁 | 本基金基金经理、宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2014年12月17日 | - | 8年 | 张小仁先生，中山大学经济学硕士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理。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

今年上半年，我国宏观经济仍处于寻底过程中，如中央文件所言，中国经济目前处于经济增长的换挡期、结构调整的阵痛期以及前期刺激政策的消化期。中国经济的结构性问题仍需要时间和智慧来解决，绝非易事。中央政府充分意识到目前中国经济所处的状况，继续推动"互联网+"、"一带一路"、"国企改革"、"万众创新"、"大众创业"等重点方向，为我国经济转型注入了新的能量。

报告期内，上证指数上涨32.23%，创业板指数上涨94.23%，各指数均在6月中旬创下新高后，开始显著急剧的回落。尤其是前期涨幅巨大的中小板、创业板，出现连续无量跌停的现象。此次市场调整，最本质的原因是前期涨幅过大过快、估值过高，外加"去杠杆"的推手，直接酿成了全球罕见的"股灾"。再加持股集中度较高，更造成了"挤压式卖盘"，从而引起流动性恐慌的迹象。

本基金作为行业主题性基金，以代表未来发展方向的先进制造为基础，前期考虑更多的是公司的市值空间，从而导致回撤较大。

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1.413元。本报告期内本基金的份额净值收益率为40.32%，业绩比较基准收益率为50.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全年，由于我国经济在资本、人力等方面都遇到了一定瓶颈，加上经济基数已经十分庞大，国内经济增长率中枢的下行是大概率事件；但从经济周期叠加政治周期的角度看，政府扭转经济下滑态势的决心也会越来越强。

市场层面，短期经历暴跌后，投资者的情绪比较摇摆，容易出现极端跌停的现象。与此同时，我们也看到相关部门在积极推出"救市"政策，各参与主体也都纷纷表态，对恢复市场信心有一定好处，但也需要更多的时间。短期的投资将更遵循买跌不买涨、同时降低收益的幅度预期。就中长期而言，资本市场的活跃度对经济转型、改革创新具有极为重要的作用，理应也将成为居民资产的主要配置方向之一，依然值得看好。

下一阶段，总的思路是紧跟国家政策，中短期很难出现上半年那样的普涨局面，选股的重要性更发显现，将会更加突出估值与市值的同等重要性；充分利用市场的恐慌情绪，率先增持被显著错杀的品种。未来将会灵活调整对本基金的配置。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§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：宝盈先进制造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 | 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 | 215,338,082.72 | 747,523,304.46 |
| 结算备付金 | 11,335,929.97 | - |
| 存出保证金 | 1,848,091.62 | - |
| 交易性金融资产 | 1,637,473,657.48 | 1,678,322,158.84 |
| 其中：股票投资 | 1,579,976,782.78 | 1,678,322,158.84 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 57,496,874.70 | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 119,026,363.76 | 1,943,592,836.54 |
| 应收利息 | 1,533,281.16 | 376,806.18 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 4,578,243.60 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,991,133,650.31 | 4,369,815,106.02 |
| 负债和所有者权益 | 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 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 30,551,981.72 | 78,972,444.52 |
| 应付赎回款 | 254,473,635.68 | - |
| 应付管理人报酬 | 3,225,904.66 | 2,447,961.76 |
| 应付托管费 | 537,650.77 | 407,993.63 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 4,995,662.52 | 1,560,994.45 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 490,726.88 | - |
| 负债合计 | 294,275,562.23 | 83,389,394.36 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,200,622,282.01 | 4,257,052,685.91 |
| 未分配利润 | 496,235,806.07 | 29,373,025.75 |
| 所有者权益合计 | 1,696,858,088.08 | 4,286,425,711.66 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,991,133,650.31 | 4,369,815,106.02 |

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.413元，基金份额总额1,200,622,282.01份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈先进制造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

| 资产 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | 895,494,603.79 |
| 1.利息收入 | 2,602,030.43 |
| 其中：存款利息收入 | 2,044,678.62 |
| 债券利息收入 | 557,351.81 |
| 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） | 905,159,331.40 |
| 其中：股票投资收益 | 897,702,402.82 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 3,985,436.50 |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 3,471,492.08 |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | -34,704,749.25 |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | - |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | 22,437,991.21 |
| 减：二、费用 | 44,766,862.74 |
| 1. 管理人报酬 | 22,735,932.99 |
| 2. 托管费 | 3,789,322.15 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 17,980,978.08 |
| 5. 利息支出 | 47,639.66 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 47,639.66 |
| 6. 其他费用 | 212,989.86 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | 850,727,741.05 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列） | 850,727,741.05 |

注：本基金合同生效日为2014年12月17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：宝盈先进制造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） | 4,257,052,685.91 | 29,373,025.75 | 4,286,425,711.66 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 850,727,741.05 | 850,727,741.05 |
| 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） | -3,056,430,403.90 | -383,864,960.73 | -3,440,295,364.63 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,577,491,384.35 | 954,234,239.01 | 2,531,725,623.36 |
| 2.基金赎回款 | -4,633,921,788.25 | -1,338,099,199.74 | -5,972,020,987.99 |
| 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） | 1,200,622,282.01 | 496,235,806.07 | 1,696,858,088.08 |

注：本基金合同生效日为2014年12月17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：

汪钦　　　　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

宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"宝盈先进制造混合"）。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】1244号《关于核准宝盈先进制造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根据经批准的《宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》向社会公开募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，并出具普华永道中天验字（2014）第800号验资报告。经向中国证监会备案，《宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年12月17日正式生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为2014年12月1日至2014年12月12日止，首次发售募集有效经认购金额为人民币4,255,516,897.64元，折合4,255,516,897.64份基金份额；有效资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币1,535,788.27元，折合1,535,788.27份基金份额；以上收到的资金共计人民币4,257,052,685.91元，折合4,257,052,685.91份基金份额。本基金管理人为宝盈基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《宝盈先进制造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，但须符合中国证监会的相关规定。

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%，其中投资于先进制造业上市公司证券的比例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%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：申银万国制造业指数×70% ＋ 中证综合债券指数收益率×30%。

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》、《宝盈先进制造灵活配置混合型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2015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2015年6月30日的财务状况以及2015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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)?对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)?在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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

| 项目 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 宝盈基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 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 | 22,735,932.99 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 11,823,464.62 |

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 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 | 3,789,322.15 |

注：支付基金托管人中国建设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

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 基金合同生效日（2014年12月17日）持有的基金份额 | - |
| 期初持有的基金份额 | - |
| 期间申购/买入总份额 | 11,428,000.00 |
| 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 | 11,428,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.95% |

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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 215,338,082.72 | 1,859,023.12 |

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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

本基金本报告期间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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002368 | 太极股份 | 2015年5月14日 | 重大事项 | 52.73 | - | - | 2,550,000 | 81,081,411.84 | 134,461,500.00 | - |
| 300190 | 维尔利 | 2015年5月25日 | 重大事项 | 31.13 | - | - | 1,996,381 | 28,491,097.41 | 62,147,340.53 | - |
| 002398 | 建研集团 | 2015年6月8日 | 重大事项 | 20.51 | 2015年7月1日 | 25.64 | 1,499,969 | 42,217,030.26 | 30,764,364.19 | - |
| 600061 | 国投安信 | 2015年6月8日 | 重大事项 | 27.45 | 2015年7月20日 | 34.04 | 1,106,000 | 37,262,913.35 | 30,359,700.00 | - |
| 300096 | 易联众 | 2015年5月28日 | 重大事项 | 28.40 | - | - | 799,986 | 22,949,873.20 | 22,719,602.40 | - |
| 002549 | 凯美特气 | 2015年4月2日 | 重大事项 | 19.97 | - | - | 419,927 | 6,495,238.60 | 8,385,942.19 | - |

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。

6.4.9.3 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市场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

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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 | 1,579,976,782.78 | 79.35 |
| | 其中：股票 | 1,579,976,782.78 | 79.35 |
| 2 | 固定收益投资 | 57,496,874.70 | 2.89 |
| | 其中：债券 | 57,496,874.70 | 2.89 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 226,674,012.69 | 11.38 |
| 7 | 其他各项资产 | 126,985,980.14 | 6.38 |
| 8 | 合计 | 1,991,133,650.31 | 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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 723,473,029.35 | 42.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 40,660,498.62 | 2.40 |
| 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 | 430,505,477.90 | 25.37 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 19,720,000.00 | 1.16 |
| L | 租赁和商务服务业 | 54,165,000.00 | 3.19 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 127,632,240.19 | 7.52 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 174,892,482.72 | 10.31 |
| 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 | 8,928,054.00 | 0.53 |
| | 合计 | 1,579,976,782.78 | 93.11 |

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 | 002368 | 太极股份 | 2,550,000 | 134,461,500.00 | 7.92 |
| 2 | 603456 | 九洲药业 | 2,200,000 | 112,266,000.00 | 6.62 |
| 3 | 300187 | 永清环保 | 2,680,000 | 104,359,200.00 | 6.15 |
| 4 | 002698 | 博实股份 | 1,900,000 | 100,320,000.00 | 5.91 |
| 5 | 600570 | 恒生电子 | 750,000 | 84,037,500.00 | 4.95 |
| 6 | 300170 | 汉得信息 | 2,899,884 | 70,438,182.36 | 4.15 |
| 7 | 300252 | 金信诺 | 1,703,723 | 67,586,691.41 | 3.98 |
| 8 | 600990 | 四创电子 | 700,000 | 67,424,000.00 | 3.97 |
| 9 | 300190 | 维尔利 | 1,996,381 | 62,147,340.53 | 3.66 |
| 10 | 300125 | 易世达 | 1,300,000 | 55,900,000.00 | 3.29 |

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 | 600536 | 中国软件 | 219,528,513.71 | 5.12 |
| 2 | 601989 | 中国重工 | 172,573,983.76 | 4.03 |
| 3 | 300125 | 易世达 | 135,441,370.09 | 3.16 |
| 4 | 300096 | 易联众 | 112,652,753.89 | 2.63 |
| 5 | 600570 | 恒生电子 | 109,948,462.00 | 2.57 |
| 6 | 002594 | 比亚迪 | 108,117,643.49 | 2.52 |
| 7 | 600990 | 四创电子 | 105,854,041.36 | 2.47 |
| 8 | 300187 | 永清环保 | 105,771,935.17 | 2.47 |
| 9 | 300334 | 津膜科技 | 105,107,736.47 | 2.45 |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 102,673,149.80 | 2.40 |
| 11 | 002236 | 大华股份 | 100,223,420.89 | 2.34 |
| 12 | 300380 | 安硕信息 | 97,373,156.16 | 2.27 |
| 13 | 600660 | 福耀玻璃 | 96,701,108.84 | 2.26 |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 94,821,420.05 | 2.21 |
| 15 | 300170 | 汉得信息 | 90,365,627.88 | 2.11 |
| 16 | 000559 | 万向钱潮 | 88,608,245.95 | 2.07 |
| 17 | 601766 | 中国南车 | 86,676,347.91 | 2.02 |
| 18 | 601218 | 吉鑫科技 | 86,376,028.54 | 2.02 |
| 19 | 600038 | 中直股份 | 81,840,965.93 | 1.91 |
| 20 | 300178 | 腾邦国际 | 80,722,994.75 | 1.88 |

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

金额单位：人民币元

| 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（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 318,449,194.66 | 7.43 |
| 2 | 601218 | 吉鑫科技 | 183,914,187.03 | 4.29 |
| 3 | 601989 | 中国重工 | 180,714,230.66 | 4.22 |
| 4 | 000661 | 长春高新 | 172,775,234.22 | 4.03 |
| 5 | 600536 | 中国软件 | 165,048,221.59 | 3.85 |
| 6 | 002698 | 博实股份 | 158,532,749.51 | 3.70 |
| 7 | 002594 | 比亚迪 | 155,554,888.30 | 3.63 |
| 8 | 002023 | 海特高新 | 152,884,580.81 | 3.57 |
| 9 | 600038 | 中直股份 | 149,429,282.58 | 3.49 |
| 10 | 600271 | 航天信息 | 144,866,235.95 | 3.38 |
| 11 | 300334 | 津膜科技 | 142,592,499.23 | 3.33 |
| 12 | 002236 | 大华股份 | 136,173,005.81 | 3.18 |
| 13 | 600660 | 福耀玻璃 | 120,534,507.84 | 2.81 |
| 14 | 601398 | 工商银行 | 116,505,616.14 | 2.72 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 110,186,062.92 | 2.57 |
| 16 | 300096 | 易联众 | 107,991,537.98 | 2.52 |
| 17 | 600761 | 安徽合力 | 105,249,930.77 | 2.46 |
| 18 | 600837 | 海通证券 | 93,864,510.56 | 2.19 |
| 19 | 000559 | 万向钱潮 | 92,597,083.24 | 2.16 |
| 20 | 601766 | 中国南车 | 91,919,231.87 | 2.14 |
| 21 | 601700 | 风范股份 | 91,376,666.50 | 2.13 |
| 22 | 601668 | 中国建筑 | 90,019,518.14 | 2.10 |
| 23 | 601208 | 东材科技 | 88,158,387.93 | 2.06 |

注：1、卖出主要指基金在二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、"卖出股票收入"按卖出成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

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

| | |
|---|---|
| 序号 | 5,336,216,897.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,297,900,780.68 |

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 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 57,496,874.70 | 3.39 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 57,496,874.70 | 3.39 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 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（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019321 | 13国债21 | 571,710 | 57,496,874.70 | 3.39 |

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除九洲药业外未受到公开谴责、处罚。

2015年1月17日，浙江九洲药业股份有限公司（以下简称"公司"）位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故，造成1名工人受伤，经抢救无效死亡。事故发生后，公司立即启动突发事件应急处置预案，并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内，未对公司生产经营造成重大影响，也未对公司的经营业绩产生较大影响。

2015年4月22日，公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书，认定该事故为一般生产安全责任事故，给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司预计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。

我们关注到此事是公司管理细节上的问题，确实需要改进，但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值，因此在事故发生后及处罚决定下达后未做减持。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,848,091.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 119,026,363.76 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,533,281.16 |
| 5 | 应收申购款 | 4,578,243.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 126,985,980.14 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002368 | 太极股份 | 134,461,500.00 | 7.92 | 重大事项 |
| 2 | 300190 | 维尔利 | 62,147,340.53 | 3.66 | 重大事项 |

7.12.6 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 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 38,625 | 31,084.07 | 147,980,404.57 | 12.33% | 1,052,641,877.44 | 87.67% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 499,998.06 | 0.0416% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2014年12月17日）基金份额总额 | 4,257,052,685.91 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,257,052,685.91 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,577,491,384.35 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,633,921,788.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,200,622,282.01 |

§10 重大事件揭示

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

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2015年3月21日，本基金管理人发布关于董事长（法定代表人）变更的公告，李文众先生任宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人），李文众先生基金行业任职资格核准文号为：证监许可（2015）409号。李建生女士退休，不再担任董事长（法定代表人）职务。截止至报告期末，基金管理人已完成办理法定代表人工商变更登记等相关手续。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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，未发生显著改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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稽查或处罚等情况

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及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 平安证券 | 1 | 5,382,782,751.40 | 46.32% | 4,763,227.15 | 45.87% | - |
| 国泰君安 | 1 | 3,818,195,843.24 | 32.86% | 3,476,073.84 | 33.47% | - |
| 华泰证券 | 1 | 1,507,518,418.36 | 12.97% | 1,337,310.25 | 12.88% | - |
| 国信证券 | 1 | 912,567,545.85 | 7.85% | 807,531.78 | 7.78% | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、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，并能为本基金提供全面的信息服务。

（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营机构的选择，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：

（Ⅰ）租用交易单元情况

本报告期内新增安信证券1个上海交易单元、1个深圳交易单元；银河证券1个上海交易单元、1个深圳交易单元；招商证券1个上海交易单元。

（Ⅱ）退租交易单元情况

本报告期内无退租交易单元。

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

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 178,688,509.70 | 100.00% | 540,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |

宝盈基金管理有限公司
2015年8月27日