宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月20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	宝盈泛沿海增长股票
基金主代码	213002
交易代码	213002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年3月8日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,201,688,246.40份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司,有效分享中国经济快速增长的成果,在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”进行资产配置和行业及类属资产配置,“自下而上”精选个股的积极投资策略。 在整体资产配置层面,本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 在区域资产配置及行业权重层面,本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。 在个股选择层面,本基金以PEG、每股经营现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据,通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。
业绩比较基准	上证A股指数×80%+上证国债指数×20% 当市场出现合适的全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。
风险收益特征	本基金属于区域类增长型股票基金,风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间,适于能承担一定风险,追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张璀	赵会军
	联系电话	0755-83276688	010-66105799
	电子邮箱	zhangt@byfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	95588
传真		0755-83515599	010-66106904

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	1,232,162,080.84
本期利润	1,070,677,717.46
加权平均基金份额本期利润	0.3128
本期基金份额净值增长率	62.31%
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	0.1730
期末基金资产净值	2,839,032,810.36
期末基金份额净值	0.8867

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

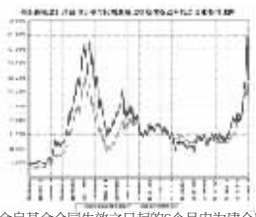
2、上述基金业绩指标不包括份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-20.07%	4.09%	-5.56%	2.68%	-14.51%	1.41%
过去三个月	21.22%	3.23%	11.71%	2.07%	9.51%	1.16%
过去六个月	62.31%	2.55%	26.30%	1.81%	36.01%	0.74%
过去一年	95.01%	2.04%	83.36%	1.44%	11.65%	0.60%
过去三年	133.65%	1.54%	74.42%	1.09%	59.23%	0.45%
自基金合同生效起至今	255.73%	1.58%	195.17%	1.36%	60.56%	0.22%

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: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,以自己的专业知识敬力于获得良好业绩,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		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年5月16日	-	10年	盖俊龙先生,经济学硕士。2005年8月至2011年5月,在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011年6月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。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年上半年上证综指、沪深300、深证综指、中小板综指、创业板综指涨跌幅分别为32.23%、26.58%、74.13%、83.08%、106.65%,上半年股票市场整体上涨明显,特别是与“互联网+”有关的公司,但6月中下旬开始大幅调整。

在基金管理人对未来中国经济需要转型的基本判断基础上,投资重点在传统行业转型升级(传统行业转型需要兼并重组、提升技术水平、提高环保标准)和新兴产业两个主题领域,自下而上选择配置个股,持仓以成长股为主。

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0.8867元。本基金在本报告期内净值增长率是62.31%,同期业绩比较基准收益率是26.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度GDP增速7%,主要是服务业特别是金融业增长贡献率大幅提升。6月工业增加值和发电量小幅回升,但工业产销率下降,反应工业需求仍然低迷。

2015年1-6月份固定资产投资名义同比增速为11.4%,与前五个月持平。虽然房地产和去产能的采矿业仍未完成出清,但基础设施投资增长偏稳,制造业投资止跌趋稳,其他类型(以服务业等新兴产业为主)投资缓慢上升。2015年6月份全国消费品增速同比回升,但消费金额与上月持平,消费处于平稳。消费偏好主要受益于房地产市场成交活跃和资本市场财富效应。出口方面,6月份出口增速转正,但是出口额1920亿美元,仍然没有超过2000亿美元,出口仍显疲弱。受制于全球经济弱复苏,出口增长低迷态势难改。

整体上看,目前工业生产呈现企稳态势,从PM1生产和需求数据的分化、从中微观数据的不同表现来看,企稳的基础尚不牢固。

从资本市场的角度看,15年6月15日开始,随着监管层加大对场外配资的清理力度,国内主要股指快速调整,目前可能相当一部分场外融资已经爆仓。场外配资带来股指的重挫之后,国家层面出台了一系列救市举措,不过来自两融市场的资金逃离在近期显得快速而坚决,几乎全部融资标的呈现资金抽离。

股指经过恐慌性大幅下调,我们认为下半年投资机会大于风险,但随着前期去杠杆的过程,资金大幅流出市场,市场整体的投资机会不大,更多的是结构性机会,即一些前期被恐慌性杀跌出现的价值被低估的股票。

基于上述判断,基金管理人认为未来的投资机会,将以价值成长股为主。基金管理人未来将重点在价值成长股和新兴行业两个主题领域选择配置个股。价值成长股以行业龙头股为主,且预期未来2-3年的业绩复合增长率在15%以上的;新兴行业重点关注环保、新材料、自动化、TMT、医疗等。

本基金主要采取自下而上的选股策略,以个股投资价值判断为主。基金管理人将遵循基金合同约定的投资策略,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、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

2015年上半年,本基金托管人在对宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

2015年上半年,宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金2015年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

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	260,971,649.19	61,007,701.68
结算备付金		8,722,746.10	5,989,408.49
存出保证金		1,215,964.98	882,517.45
交易性金融资产	6.4.7.2	2,655,946,420.73	1,899,013,301.86
其中:股票投资		2,553,476,420.73	1,836,662,022.86
基金投资		-	-
债券投资		102,470,000.00	62,351,279.00
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		134,841,818.14	13,354,451.99
应收利息	6.4.7.5	2,903,737.59	1,582,673.85
应收股利		-	-
应收申购款		7,244,640.09	745,646.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,071,846,976.82	1,982,575,701.99

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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		220,745,247.30	5,933,225.24
应付管理人报酬		4,889,776.66	2,849,705.76
应付托管费		814,962.80	474,950.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,442,851.24	3,029,704.00
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	921,328.46	355,732.95
负债合计		232,814,166.46	12,643,318.92
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,846,746,371.75	2,079,975,331.47
未分配利润	6.4.7.10	992,286,438.61	-110,042,948.40
所有者权益合计		2,839,032,810.36	1,969,932,383.07
负债和所有者权益总计		3,071,846,976.82	1,982,575,701.99

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值0.8867元,基金份额总额3,201,688,246.40份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

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	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		1,108,912,277.91	26,323,252.71
1.利息收入		1,746,852.92	1,908,293.12
其中:存款利息收入	6.4.7.11	576,755.24	457,474.39
债券利息收入		1,170,097.68	1,333,282.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	117,536.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,266,830,928.67	-324,238,928.76
其中:股票投资收益	6.4.7.12	1,257,148,761.59	-330,200,620.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	570,994.01	429,700.00
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	9,111,173.07	5,531,991.41
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-161,484,363.38	348,200,019.71
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	1,818,859.70	453,868.64
减:二、费用		38,234,560.45	25,673,476.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,935,095.94	14,588,094.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,322,516.01	2,431,349.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,720,768.33	8,449,314.26
5. 利息支出		37,596.34	-
其中:卖出回购金融资产支出		37,596.34	-
6. 其他费用	6.4.7.20	218,583.83	204,718.42
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,070,677,717.46	649,776.37
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,070,677,717.46	649,776.37

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

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)	2,079,975,331.47	-110,042,948.40	1,969,932,383.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,070,677,717.46	1,070,677,717.46
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)	-233,228,959.72	31,651,669.55	-201,577,290.17
其中:1.基金申购款	1,554,082,317.72	1,120,775,534.91	2,674,857,852.63
2.基金赎回款	-1,787,311,277.44	-1,089,123,865.36	-2,876,435,142.80
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)	1,846,746,371.75	992,286,438.61	2,839,032,810.36
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	3,144,946,866.81	-694,571,095.17	2,450,375,771.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	649,776.37	649,776.37
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)	-1,106,049,163.14	262,402,160.26	-843,647,002.88
其中:1.基金申购款	9,955,302.41	-2,480,701.15	7,474,601.26
2.基金赎回款	-1,116,004,465.55	264,882,861.41	-851,121,604.14
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)	2,038,897,703.67	-431,519,158.54	1,607,378,545.13

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

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金(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[2004]第218号《关于同意宝盈泛沿海区域增长股票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《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金募集申请报告》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共募集401,940,889.81元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第18号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》于2005年3月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为402,050,224.74份基金份额,其中认购资金利息折合109,334.93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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更新招募说明书》和《关于宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2007年6月11日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:1.733642060(保留到小数点后9位),并于2007年6月12日进行了更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券、货币市场工具及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金财产中股票资产比例为60%-95%,债券资产比例为0%-35%,现金或持有期限为1年以内政府债券的投资比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为:中上证A股指数X80%+上证国债指数X20%。当市场出现合适的全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。

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》、《宝盈泛沿海区域增长股票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 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之外,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

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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

自2015年3月27日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。2015年3月27日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.5%。

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

本基金本报告期不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。

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	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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

本基金本报告期间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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,935,095.94	14,588,094.50
其中:支付销售机构的客户维护费	2,914,917.81	1,877,261.53

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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,322,516.01	2,431,349.16

注:支付基金托管人中国工商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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行	260,971,649.19	497,123.91	102,571,972.48	403,321.02

注:不含通过托管行备付金转存于中国证券登记结算公司结算账户的结算备付金。

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间无需披露其他关联交易事项。

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/增发而流通受限的证券。

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
002662	京威股份	2015年5月15日	重大事项停牌	17.82	2015年8月13日	16.06	8,772,000	113,257,421.55	156,317,040.00	-
000566	海南海药	2015年6月18日	重大事项停牌	40.76	-	-	1,599,919	79,714,165.29	65,212,698.44	-
600094	大名城	2015年6月26日	重大事项停牌	20.25	2015年8月5日	18.23	2,699,967	67,199,788.78	54,674,331.75	-
603111	康尼机电	2015年5月19日	重大资产重组	36.39	-	-	1,499,940	49,216,705.23	54,582,816.60	-
002329	皇氏集团	2015年6月12日	重大事项停牌	57.75	2015年8月13日	62.53	899,926	56,909,609.60	51,970,726.50	-
603898	好莱客	2015年6月15日	重大资产重组	109.46	-	-	449,950	47,569,486.76	49,251,527.00	-
300212	易华录	2015年6月30日	重大事项停牌	59.94	2015年7月13日	54.00	546,300	37,923,543.00	32,745,222.00	-

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

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	2,553,476,420.73	83.13
	其中:股票	2,553,476,420.73	83.13
2	固定收益投资	102,470,000.00	3.34
	其中:债券	102,470,000.00	3.34
	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	269,694,395.29	8.78
7	其他各项资产	146,206,160.80	4.76
8	合计	3,071,846,976.82	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	2,040,822,883.96	71.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	44,730,000.00	1.58
F	批发和零售业	120,794,920.86	4.25
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	120,506,611.99	4.24
J	金融业	206,040.00	0.01
K	房地产业	94,327,274.31	3.32
L	租赁和商务服务业	73,081,561.05	2.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,129,182.00	0.18
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	53,877,946.56	1.90
S	综合	-	-
	合计	2,553,476,420.73	89.94

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	300206	理邦仪器	6,512,366	208,525,959.32	7.34
2	002662	京威股份	8,772,000	156,317,040.00	5.51
3