宝盈核心优势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	宝盈核心优势混合	
基金主代码	213006	
交易代码	213006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年3月17日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,177,280,434.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
下属分级基金的交易代码:	213006	000241
报告期末下属分级基金的份额总额	2,118,956,420.20份	58,324,014.43份

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业,建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上,对于景气度提高的行业给予适当倾斜,以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制投资组合的市场适应性,在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2、股票投资策略 根据公司的基本面情况,根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业,建立股票池。本基金在构建投资组合时,强调两端投资,价值与成长性能平衡,兼顾价值与成长型股票,以均衡资产混合策略建立动力资产组合,努力克服单一风格投资所带来的局限性,这样可以较好控制组合市场适应性,一定程度上能够排除对景气误判概率,以求多空环境中都能创造主动管理回报。 3、债券投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×65%＋上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金是一只灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险预算范围内追求收益最大化。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张璀	王永民
	联系电话	0755-83276688	010-66594896
	电子邮箱	zhangc@byfunds.com	fcsd@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95566
传真		0755-83515599	010-66594942

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、基金托管人住所

§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

基金级别	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
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)	报告期(2015年1月1日－2015年6月30日)
本期已实现收益	2,547,173,888.66	86,012,977.25
本期利润	1,991,015,171.16	73,129,107.81
加权平均基金份额本期利润	0.5263	0.5731
本期基金份额净值增长率	26.71%	25.86%
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	0.5121	0.4921
期末基金资产净值	3,204,116,701.99	87,024,328.82
期末基金份额净值	1.5121	1.4921

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、本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合C”。

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

宝盈核心优势混合A

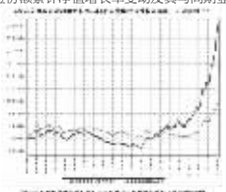
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-20.60%	3.86%	-4.57%	2.28%	-16.03%	1.58%
过去三个月	2.44%	2.91%	7.58%	1.70%	-5.14%	1.21%
过去六个月	26.71%	2.29%	18.48%	1.47%	8.23%	0.82%
过去一年	98.48%	1.83%	64.80%	1.20%	33.68%	0.63%
过去三年	272.72%	1.53%	56.24%	0.97%	216.48%	0.56%
自基金合同生效起至今	200.25%	1.33%	75.92%	1.00%	124.33%	0.33%

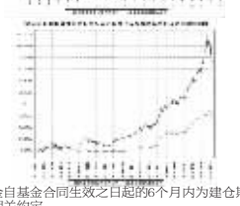
宝盈核心优势混合C

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	-20.69%	3.87%	-4.57%	2.28%	-16.12%	1.59%
过去三个月	2.09%	2.91%	7.58%	1.70%	-5.49%	1.21%
过去六个月	25.86%	2.29%	18.48%	1.47%	7.38%	0.82%
过去一年	96.15%	1.83%	64.80%	1.20%	31.35%	0.63%
自基金合同生效起至今	143.19%	1.65%	62.91%	1.00%	80.28%	0.65%

注:本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合C”。

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、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。

2、本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合C”。

§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、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年9月26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

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,开始显著急刷的回落。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。

本基金在一季度仍基本维持了比较均衡的配置,亦即传统蓝筹外加积极成长。进入5月份,开始大幅加配成长股;同时为了规避流动性风险,选择大市值的主题股进行配置,但此次交易流动性的枯竭程度还是远超预期,热门主题的大市值公司回落同样巨大,基金净值回落明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

宝盈核心优势混合A:截至本报告期末,本基金的份额净值为1.5121元。本基金在本报告期内净值增长率是26.71%,同期业绩比较基准收益率是18.48%。

宝盈核心优势混合C:截至本报告期末,本基金的份额净值为1.4921元。本基金在本报告期内净值增长率是25.86%,同期业绩比较基准收益率是18.48%。

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。

我们将严格按照基金合同的规定,继续努力尽责做好本基金的管理工作,尽力为投资者谋取较好的回报。

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

本基金收益分配原则:当基金实现可分配收益达到0.04元或者当基金净值达到1.10元或以上时,且满足法定分红条件时,即实施收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至少分配1次,基金收益分配每年至多12次;年度分红12次后,如果再次达到分红条件,收益分配滚存到下一年度实施;全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的60%,基金合同生效不满三个月,收益可不分配;基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,报告期内本基金共进行了12次收益分配:

1、本基金管理人于2015年1月13日发布公告,以2015年1月5日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.60元。

2、本基金管理人已于2015年1月24日发布公告,以2015年1月16日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元。

3、本基金管理人已于2015年2月9日发布公告,以2015年1月29日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元。

4、本基金管理人已于2015年2月28日发布公告,以2015年2月11日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元。

5、本基金管理人已于2015年3月12日发布公告,以2015年3月3日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

6、本基金管理人已于2015年3月25日发布公告,以2015年3月16日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

7、本基金管理人已于2015年4月8日发布公告,以2015年3月27日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

8、本基金管理人已于2015年4月21日发布公告,以2015年4月10日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

9、本基金管理人已于2015年5月5日发布公告,以2015年4月23日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

10、本基金管理人已于2015年5月18日发布公告,以2015年5月7日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

11、本基金管理人已于2015年5月30日发布公告,以2015年5月20日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元。

12、本基金管理人已于2015年6月10日发布公告,以2015年6月2日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利2.50元。

本报告期末宝盈核心优势混合A可供分配基金份额利润0.5121元,基金份额净值1.5121元,宝盈核心优势混合C可供分配基金份额利润0.4921元,基金份额净值1.4921元,符合利润分配条件,但2015年上半年度本基金分红次数已达到12次,根据合同约定本基金年度分红12次后,如果再次达到分红条件,收益分配滚存到下一年度实施。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在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、投资组合报告等数据核对无误。(注:财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。)

§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:宝盈核心优势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	506,240,977.23	281,110,040.29
结算备付金	8,690,427.49	12,825,904.10
存出保证金	2,956,762.59	1,282,928.77
交易性金融资产	3,184,319,992.75	7,222,486,263.77
其中:股票投资	2,693,893,957.25	6,080,771,091.89
基金投资	–	–
债券投资	490,426,035.50	1,141,715,171.88
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	62,735,242.72	36,272,090.19
应收利息	9,015,651.27	12,224,153.27
应收股利	–	–
应收申购款	15,101,912.36	69,747,139.95
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	3,788,060,966.41	7,635,948,531.25
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		38,070,972.75
应付赎回款	479,954,179.69	140,852,336.56
应付管理人报酬	6,296,244.35	8,033,989.72
应付托管费	1,049,207.41	1,338,998.28
应付销售服务费	179,264.98	237,180.60
应付交易费用	8,508,397.76	6,754,516.65
应交税费	70,261.60	70,261.60
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	1,863,380.81	698,723.28
负债合计	496,919,935.60	195,957,600.44
所有者权益:		
实收基金	2,177,280,434.63	4,949,278,284.37
未分配利润	1,113,860,596.18	2,490,712,646.44
所有者权益合计	3,291,141,030.81	7,439,990,930.81
负债和所有者权益总计	3,788,060,966.41	7,635,948,531.25

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额总额2,177,280,434.63份,其中宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值为1.5121元,基金份额为2,118,956,420.20份;宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额净值为1.4921元,基金份额为58,324,014.43份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈核心优势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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	2,152,200,321.97	396,951,856.51
1.利息收入	14,701,254.77	7,579,257.64
其中:存款利息收入	1,449,507.74	921,006.45
债券利息收入	13,180,923.89	6,211,040.86
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	70,823.14	447,210.33
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,691,045,332.21	294,915,853.42
其中:股票投资收益	2,627,845,402.86	285,566,899.13
基金投资收益	–	–
债券投资收益	48,883,963.53	1,996,403.12
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	14,315,965.82	7,352,551.17
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-569,042,586.94	93,361,339.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)	15,496,321.93	1,095,406.27
减:二、费用	88,056,043.00	37,282,855.32
1. 管理人报酬	49,348,846.34	19,871,752.13
2. 托管费	8,224,807.76	3,311,958.69
3. 销售服务费	1,596,080.83	516,616.98
4. 交易费用	27,548,650.87	13,372,822.97
5. 利息支出	1,091,117.11	–
其中:卖出回购金融资产支出	1,091,117.11	–
6. 其他费用	246,540.09	209,704.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	2,064,144,278.97	359,669,001.19
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	2,064,144,278.97	359,669,001.19

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈核心优势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)	4,949,278,284.37	2,490,712,646.44	7,439,990,930.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	2,064,144,278.97	2,064,144,278.97
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)	-2,771,997,849.74	-1,970,926,361.61	-4,742,924,211.35
其中:1.基金申购款	4,884,400,178.04	3,340,098,336.00	8,224,498,514.04
2.基金赎回款	-7,656,398,027.78	-5,311,024,697.61	-12,967,422,725.39
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)	–	-1,470,069,967.62	-1,470,069,967.62
五、期末所有者权益(基金净值)	2,177,280,434.63	1,113,860,596.18	3,291,141,030.81
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)	1,619,728,916.65	75,684,183.84	1,695,413,100.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	359,669,001.19	359,669,001.19
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)	1,512,031,532.29	97,611,158.31	1,609,642,690.60
其中:1.基金申购款	2,353,333,737.60	141,253,370.44	2,494,587,108.04
2.基金赎回款	-841,302,205.31	-43,642,212.13	-884,944,417.44
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)	–	-255,396,646.24	-255,396,646.24
五、期末所有者权益(基金净值)	3,131,760,448.94	277,567,697.10	3,409,328,146.04

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

宝盈核心优势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[2009]第5号《关于核准宝盈核心优势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《宝盈核心优势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共募集776,417,611.14元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报验字(09)第0003号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2009年3月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为776,687,900.16份基金份额,其中认购资金利息折合270,289.02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《宝盈核心优势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基本面良好、投资价值较高的上市公司股票,以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产占基金总资产的比例为30%－80%;债券为15%－65%,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%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数X65%＋上证国债指数X35%。

根据《关于宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金增加收费模式并修改基金合同的公告》,本基金自2013年8月1日起实施分级,在投资者申购时收取前端申购费用的,称为宝盈核心优势混合A,不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为宝盈核心优势混合C。

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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈核心优势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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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须说明的会计差错更正。

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

本基金本报告期存在控制关系或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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行交易。

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	49,348,846.34	19,871,752.13
其中:支付销售机构的客户维护费	8,540,744.99	940,169.54

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	8,224,807.76	3,311,958.69

注:支付基金托管人中国银行股份有限公司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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	合计
宝盈基金管理有限公司	–	1,205,517.01	1,205,517.01
中国银行	–	–	–
合计	–	1,205,517.01	1,205,517.01
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	合计
宝盈基金管理有限公司	–	338,479.95	338,479.95
中国银行	–	–	–
合计	–	338,479.95	338,479.95

注:1、本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合C”

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给宝盈基金公司,再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×1.5% / 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

单位:人民币元

本期 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利