鸿阳证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈鸿阳封闭
场内简称	基金鸿阳
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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
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	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	无。
风险收益特征	风险水平和期望收益适中。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,586,474.47
2.本期利润	-1,048,617,451.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5243
4.期末基金资产净值	2,097,736,180.38
5.期末基金份额净值	1.0489

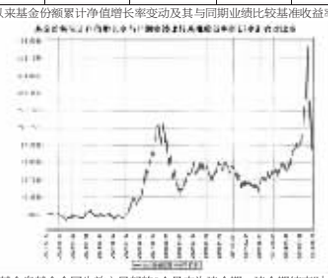
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-33.33%	9.05%	-	-	-	-

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 基金经理(或基金经理小组)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		
杨凯	本基金基金经理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、副总经理	2013年2月5日	-	11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、总经理助理等职务。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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 公平交易专项说明

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 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

2015年三季度,A股市场呈现单边大幅下跌的趋势,场内外资金去杠杆,A市场呈现单边大幅下跌,并一度出现千股跌停的流动性危机。在此期间,国家出台系列救市措施,包括降息降准、暂停新股发行、出资直接在二级市场买入股票等。三季度,上证指数跌幅26.63%,中小板指数跌幅26.57%,创业板指数跌幅27.14%。本基金持股风格相对偏成长股,大盘蓝筹相对较小,在这波市场大幅杀跌过程中,净值出现较大幅度的回撤。

报告期内,本基金对仓位没有做太大的调整。操作上主要卖出了缺乏业绩支持,主题投资或者偏概念炒作的个股。在下跌过程中,买入了中长期看好的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是-33.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前,我国经济增速存在进一步下滑的风险,流动性整体宽松,无风险利率继续维持在低位,国债收益率持续下降。随着国企改革指导意见的出台、十三五规划的公布,社会对改革与创新的预期进一步加强。随着系列稳增长政策的出台,我国宏观经济有望保持稳定。经过前期市场的强烈去杠杆,市场资金面变得更加健康,经过大幅下跌,市场估值得到修正,许多优质成长股的估值变得合理。我们依然看好A股的投资机会。

本基金将继续坚持自下而上个股选择的投资思路,在价值和成长中构建相对均衡的组合,并将根据市场风格、两者估值比较做一定的配置权重调节,以达到净值稳健增长的目的。在目前这个阶段,我们倾向于进一步增配前期被大幅杀跌的优质成长股。成长股中我们看好信息安全、互联网垂直应用、新能源汽车、环保、新材料、电子元器件、高端装备制造等标的;受益于国企改革、军工等主题的个股也有很好的投资机会。低估值蓝筹股中我们相对看好大消费中的券商和保险、汽车、医药、食品饮料等。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,641,449,491.79	78.06
	其中:股票	1,641,449,491.79	78.06
2	固定收益投资	436,860,001.30	20.78
	其中:债券	436,860,001.30	20.78
	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	17,824,614.89	0.85
7	其他资产	6,624,209.67	0.32
8	合计	2,102,758,317.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	13,095,000.00	0.62
C	制造业	1,104,123,584.60	52.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	163,083,502.21	7.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	129,259,545.38	6.16
L	租赁和商务服务业	75,360,222.00	3.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	144,124,629.60	6.87
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	12,403,008.00	0.59
	合计	1,641,449,491.79	78.25

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002368	太极股份	4,360,091	144,362,613.01	6.88
2	002549	凯美特气	15,203,020	144,124,629.60	6.87
3	002019	亿帆鑫富	3,988,134	102,734,331.84	4.90
4	300396	迪瑞医疗	2,550,223	93,848,206.40	4.47
5	300090	盛运环保	4,999,891	90,298,031.46	4.30
6	002305	南国置业	20,275,433	90,022,922.52	4.29
7	002698	博实股份	4,484,046	77,753,357.64	3.71
8	603729	龙韵股份	1,138,200	75,360,222.00	3.59
9	603808	歌力思	2,122,881	74,491,894.29	3.55
10	002366	丹甫股份	1,305,426	66,393,966.36	3.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	396,803,001.30	18.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,057,000.00	1.91
	其中:政策性金融债	40,057,000.00	1.91
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	436,860,001.30	20.83

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	03国债(3)	2,794,320	283,148,445.60	13.50
2	010107	21国债(7)	746,710	79,651,555.70	3.80
3	110212	11国开12	200,000	20,020,000.00	0.95
4	140023	14附息国债23	200,000	20,014,000.00	0.95
5	010213	02国债(3)	139,890	13,989,000.00	0.67

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	834,914.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,789,295.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,624,209.67

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002368	太极股份	144,362,613.01	6.88	重大事项

5.11.6 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。

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.25

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 影响投资者决策的其他重要信息
本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。
《鸿阳证券投资基金基金合同》。
《鸿阳证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

8.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层
基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

8.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2015年10月26日

宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈转型动力混合
基金主代码	001075
交易代码	001075
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月29日
报告期末基金份额总额	5,223,861,770.65份
投资目标	本基金在对我国经济结构转型和产业升级进行深入研究的基础上,积极投资于符合经济发展趋势、质地良好的上市公司证券,在严格控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
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。 本基金将会以经济转型作为股票投资的主线,结合对上市公司基本面和估值水平的分析,重点投资受益于经济转型、具有较高成长性及盈利质量的行业及个股,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-999,464,606.37
2.本期利润	-1,794,143,164.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3383
4.期末基金资产净值	3,310,475,188.40
5.期末基金份额净值	0.634

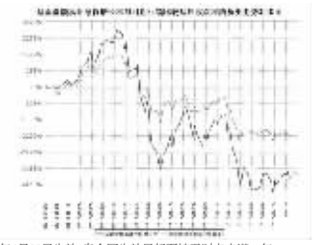
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-32.48%	4.73%	-20.32%	2.39%	-12.16%	2.34%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2015年4月29日生效,自合同生效日起至披露时点未满一年。
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 基金经理(或基金经理小组)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		
杨凯	本基金基金经理、鸿阳证券投资基金基金经理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、副总经理	2015年4月29日	-	11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、总经理助理等职务。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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 公平交易专项说明

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 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

2015年第三季度,在经济缺乏亮点,场内外资金去杠杆,A市场出现单边大幅下跌,并一度出现千股跌停的流动性危机。在此期间,国家出台系列救市措施,包括降息降准、暂停新股发行、出资直接在二级市场买入股票等。三季度,上证指数跌幅28.63%,中小板指数跌幅26.57%,创业板指数跌幅27.14%。本基金持股风格相对偏成长股和主题投资,大盘蓝筹相对较小,在这波市场大幅杀跌过程中,净值出现较大幅度的回撤。

报告期内,本基金没有遭遇较大的赎回压力,对仓位没有做太大的调整。操作上主要卖出了缺乏业绩支持,主题投资或者偏概念炒作的个股。在下跌过程中,买入了中长期看好的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是-32.48%,同期业绩比较基准收益率是-20.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前,我国经济增速存在进一步下滑的风险,流动性整体宽松,无风险利率继续维持在低位,随着国企改革指导意见的出台、十三五规划的公布,社会对改革与创新的预期进一步加强。随着系列稳增长政策的出台,我国宏观经济有望保持稳定。经过前期市场的强烈去杠杆,市场资金面变得更加健康,经过大幅下跌,市场估值得到修正,许多优质成长股的估值变得合理。我们看好未来A股的投资机会。

本基金将坚持投资改革与转型的整体投资思路,将继续坚持自下而上个股选择的投资思路,重点配置受益预转型与改革的相关行业。在目前这个阶段,我们倾向于进一步增配前期被大幅杀跌的优质成长股。从行业来开,这些成长股主要集中在信息安全、互联网垂直应用、新能源汽车、环保、新材料、电子元器件、高端装备制造、农业等行业;受益于国企改革、军工、稳增长的个股也有很好的投资机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,002,161,874.40	90.34
	其中:股票	3,002,161,874.40	90.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	316,809,599.34	9.53
8	其他资产	4,091,866.79	0.12
9	合计	3,323,063,340.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	19,327,410.06	0.58
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,289,817,446.09	69.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	149,745,351.28	4.52
E	建筑业	33,970,461.36	1.03
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	35,608,436.72	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	153,633,533.65	4.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	109,060,383.79	3.29
L	租赁和商务服务业	100,240,748.22	3.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,760,000.00	0.69
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	29,226,812.00	0.88
S	综合	58,771,291.23	1.78
	合计	3,002,161,874.40	90.69

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300090	盛运环保	16,853,940	304,382,156.40	9.19
2	002085	万丰奥威	7,664,193	223,028,016.30	6.74
3	300396	迪瑞医疗	4,545,210	167,263,728.00	5.05
4	002437	誉衡药业	5,610,416	135,884,275.52	4.10
5	002019	亿帆鑫富	5,030,105	129,575,504.80	3.91
6	000488	晨鸣纸业	20,502,241	129,574,163.12	3.91
7	000791	甘肃电投	9,394,028	123,061,766.80	3.72
8	603808	歌力思	3,491,748	122,525,437.32	3.70
9	300420	五洋科技	2,916,694	112,292,719.00	3.39
10	603729	龙韵股份	1,513,982	100,240,748.22	3.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,721,406.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,866.25
5	应收申购款	1,301,594.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,091,866.79

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,803,935,012.50
报告期期间基金总申购份额	1,076,546,325.05
减:报告期期间基金总赎回份额	1,656,619,566.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	5,223,861,770.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	13,810,773.48
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,810,773.48
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.26

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年7月7日	13,810,773.48	9,999,000.00	-
合计			13,810,773.48	9,999,000.00	

注:上述基金管理人运用固有资金投资本基金交易适用费率为固定费用1000元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。
《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层
基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2015年10月26日

宝盈资源优选混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈资源优选混合
基金主代码	213008
交易代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月15日
报告期末基金份额总额	3,785,700,468.56份
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,处于稀缺状态的资源占现其强大的经济价值,相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型,优选各个行业中具有资源优势的上市公司,建立股票池。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	本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合,并注重资产在各相关行业的配置,适当进行时机选择。采用"自上而下"进行资产配置和行业配置、"自下而上"精选个股的积极投资策略。 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 本基金将把握资源的价值变化规律,对各类资源的现状和发展进行分析判断,及时适当调整各类资源行业的配置比例,重点投资于各类资源行业中的优势企业,分享资源长期价值提升所带来的投资收益。 在个股选择层面,本基金以净资产收益率、预期PEG、每股经营活动现金流量、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。 3.债券及短期金融工具投资策略 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。 4.权证投资策略 本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益,以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件,运用有关数量模型进行估值和风险评估,谨慎投资。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
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。
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

注:2015年8月5日,本公司发布《关于宝盈资源优选股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》:公司根据《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》及《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)的规定,经与本基金基金托管人中国建设银行股份有限公司协商,拟在不变更本基金的股票投资比例,而为适应新的法规政策要求变更本基金为混合型基金,将基金名称变更为"宝盈资源优选混合型证券投资基金",本基金风险收益特征随之发生了变更。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-723,088,713.79
2.本期利润	-3,676,595,634.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9155
4.期末基金资产净值	5,946,200,709.02