宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈祥瑞养老混合
基金主代码	000639
交易代码	000639
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月21日
报告期末基金份额总额	2,360,672,546.63份
投资目标	在严格控制下行风险的前提下,追求稳定的投资回报,为投资人提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,在控制下行风险的前提下,确定大类资产配置比例,通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益,适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和权证投资策略四个部分组成。 (一)大类资产配置策略 本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心,一方面规避相关资产的下行风险,另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。 (二)固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。 (三)股票投资策略 本基金的股票投资采取行业配置与"自下而上"的个股精选相结合的方法,以深入的基本面研究为基础,精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式来构建备选股票库。 (四)权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+1%
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,属于中等收益/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	招商银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	53,766,494.50
2.本期利润	91,843,535.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0461
4.期末基金资产净值	3,252,645,417.42
5.期末基金份额净值	1.378

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。

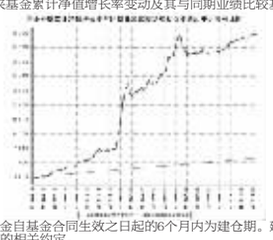
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.69%	0.16%	0.95%	0.01%	2.74%	0.15%

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: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		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2014年5月21日	-	12年	陈若劲女士,香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,尽管前期刺激措施频出,宏观经济数据依然未见改观。为缓解经济增长压力,央行宽松货币政策力度也持续加大,报告期内再度降准降息,降低企业融资成本,为经济增长提供宽松流动性环境。

报告期内,受益于宽松的货币政策,市场资金面整体相对充裕,即使IPO重启并延续老办法,也未对市场资金面带来明显扰动,资金利率仅在年末小幅上行。债券市场方面,收益率走势大致可分为三阶段,IPO重启消息发布前,收益率持续下行;IPO重启消息发布后,收益率快速大幅反弹,并一度超过报告期初水平;但收益率的反弹并未持续太久,随后在大量配置需求推动下,收益率再度恢复下行走势,并在年末创出全年最低水平。报告期内,我们延续配置利率品和高等级信用债的投资风格,在11月份债券收益率反弹时,增持了部分长久期的利率品和高等级信用债,适当提高了组合久期,在收益率的下行过程中,赚取部分资本利得。年末随着收益率不断创出低点但资金利率未明显松动,我们又适当减持部分期限较长的债券品种,将久期控制在适当安全的水平。

报告期内,随着A股市场经过3季度的大幅下跌并逐步底部企稳,我们认为部分前期下跌幅度较大、估值安全边际较高、成长性良好的个股已经显现投资价值,我们适当提高权益仓位,在确定性较强的成长股和估值具有一定安全边际的价值股上均做了适量配置。同时,IPO重启后,我们认为新股仍然具备较大的投资价值,因此我们坚持积极参与新股一级市场投资,为组合的投资回报增加了部分贡献。

4.5 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3.69%,同期业绩比较基准收益率是0.95%。

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	408,758,934.16	9.85
	其中:股票	408,758,934.16	9.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,839,134,061.33	68.42
	其中:债券	2,839,134,061.33	68.42
	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	743,801,755.70	17.92
	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	19,094,024.65	0.46
8	其他资产	138,981,766.60	3.35
9	合计	4,149,770,542.44	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	-	-
B	采矿业	6,420,000.00	0.20
C	制造业	96,768,722.72	2.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,571,551.95	0.05
F	批发和零售业	79,165,865.28	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	28,459,672.71	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,588,208.18	0.08
J	金融业	138,644,490.42	4.26
K	房地产业	54,048,306.29	1.66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	982,724.40	0.03
S	综合	-	-
	合计	408,758,934.16	12.57

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	601998	中信银行	10,000,000	72,200,000.00	2.22
2	000042	中洲控股	1,999,919	41,818,306.29	1.29
3	000418	小天鹅A	1,258,146	30,195,504.00	0.93
4	002727	一心堂	500,000	28,915,000.00	0.89
5	600755	厦门国贸	3,054,697	28,469,776.04	0.88
6	600004	白云机场	1,999,977	28,459,672.71	0.87
7	601628	中国人寿	999,982	28,309,490.42	0.87
8	002126	银轮股份	1,500,000	27,675,000.00	0.85
9	601336	新华保险	500,000	26,105,000.00	0.80
10	600998	九州通	1,099,938	21,558,784.80	0.66

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	750,996,148.00	23.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	230,990,956.20	7.10
5	企业短期融资券	661,908,000.00	20.35
6	中期票据	1,144,982,000.00	35.20
7	可转债	651,957.13	0.02
8	同业存单	49,605,000.00	1.53
9	其他	-	-
10	合计	2,839,134,061.33	87.29

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	019527	15国债27	3,200,000	320,256,000.00	9.85
2	019522	15国债22	1,900,000	191,957,000.00	5.90
3	1382180	13中金集MTN1	1,500,000	151,500,000.00	4.66
4	020080	15贴债06	1,200,000	118,092,000.00	3.63
5	1282290	12船重MTN2	1,000,000	102,690,000.00	3.16

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	829,266.78
2	应收证券清算款	105,515,233.15
3	应收股利	-
4	应收利息	32,058,704.87
5	应收申购款	578,561.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,981,766.60

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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	1,644,016,563.96
报告期期间基金总申购份额	1,100,437,305.90
减:报告期期间基金总赎回份额	383,781,323.23
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	2,360,672,546.63

§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	8,216,105.18
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	8,216,105.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.35

7.2 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。

§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祥瑞养老混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥瑞养老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:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

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
2016年1月20日

宝盈祥泰养老混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月20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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈祥泰养老混合
基金主代码	001358
交易代码	001358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	2,896,023,603.96份
投资目标	在严格控制下行风险的前提下,追求稳定的投资回报,为投资人提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,在控制下行风险的前提下,确定大类资产配置比例,通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益,适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+1%
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,属于中等收益/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

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	35,724,245.17
2.本期利润	56,801,822.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0210
4.期末基金资产净值	3,000,261,377.36
5.期末基金份额净值	1.036

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。

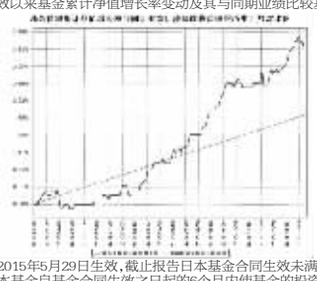
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.07%	0.09%	0.81%	0.01%	1.26%	0.08%

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5月29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		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。	2015年5月29日	-	12年	陈若劲女士,香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,受益于宽松的货币政策,市场资金面整体相对充裕,即使IPO重启并延续老办法,也未对市场资金面带来明显扰动,资金利率仅在年末小幅上行。债券市场方面,收益率走势大致可分为三阶段,IPO重启消息发布前,收益率持续下行;IPO重启消息发布后,收益率快速大幅反弹,并一度超过报告期初水平;但收益率的反弹并未持续太久,随后在大量配置需求推动下,收益率再度恢复下行走势,并在年末创出全年最低水平。报告期内,我们继续坚持偏好于利率品和高等级信用债的投资风格,在11月份债券收益率反弹时,增持了部分长久期的利率品和高等级信用债,适当提高组合久期,在收益率的下行过程中,赚取部分资本利得。年末随着收益率不断创出低点但资金利率未明显松动,我们又适当减持了部分期限较长的债券品种,将久期控制在适当安全的水平。

报告期内,随着A股市场经过3季度的大幅下跌并逐步底部企稳,我们认为部分前期下跌幅度较大、估值安全边际较高、成长性良好的个股已经显现投资价值,我们增配了权益仓位,在确定性较强的成长股和估值具有一定安全边际的价值股上均做了适量配置,但总体权益仓位仍然控制在较低的水平。同时,IPO重启后,我们认为新股仍然具备较大的投资价值,因此我们坚持积极参与新股一级市场投资,为组合的投资回报增加了部分贡献。

4.5 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2.07%,同期业绩比较基准收益率是0.81%。

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	159,937,321.47	5.26
	其中:股票	159,937,321.47	5.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,671,979,000.00	87.85
	其中:债券	2,671,979,000.00	87.85
	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	165,000,687.50	5.43
	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	6,005,364.06	0.20
8	其他资产	38,437,074.71	1.26
9	合计	3,041,359,447.74	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	-	-
C	制造业	25,979,867.39	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,571,551.95	0.05
F	批发和零售业	28,661,304.84	0.96
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	2,588,208.18	0.09
J	金融业	67,955,000.00	2.26
K	房地产业	32,089,272.50	1.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	982,724.40	0.03
S	综合	-	-
	合计	159,937,321.47	5.33

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	601998	中信银行	5,000,000	36,100,000.00	1.20
2	000042	中洲控股	949,750	19,859,272.50	0.66
3	600755	厦门国贸	2,000,000	18,640,000.00	0.62
4	601009	南京银行	1,000,000	17,700,000.00	0.59
5	600096	云天化	1,166,513	15,129,673.61	0.50
6	601628	中国人寿	500,000	14,155,000.00	0.47
7	600823	世茂股份	1,000,000	12,230,000.00	0.41
8	600998	九州通	499,949	9,799,000.40	0.33
9	600809	山西汾酒	299,911	5,779,284.97	0.19
10	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04

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	168,986,000.00	5.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,590,000.00	1.72
	其中:政策性金融债	51,590,000.00	1.72
4	企业债券	20,930,000.00	0.70
5	企业短期融资券	1,303,746,000.00	43.45
6	中期票据	1,076,470,000.00	35.88
7	可转债	652,000.00	0.02
8	同业存单	49,606,000.00	1.65
9	其他	-	-
10	合计	2,671,979,000.00	89.06

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	041570003	15莫华CP001	1,600,000	160,048,000.00	5.33
2	1282290	12船重MTN2	1,000,000	102,690,000.00	3.42
3	011519003	15国电SCP003	1,000,000	100,680,000.00	3.36
4	011519005	15国电SCP005	1,000,000	100,410,000.00	3.35
5	011599543	15陕延油SCP002	1,000,000	100,290,000.00	3.34

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	341,579.22
2	应收证券清算款	4,978,598.77
3	应收股利	-
4	应收利息	32,989,181.77
5	应收申购款	127,714.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,437,074.71

5.11.2 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。

5.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.4 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	2,193,715,319.61
报告期期间基金总申购份额	1,131,762,865.12
减:报告期期间基金总赎回份额	429,454,580.77
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	2,896,023,603.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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祥泰养老混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥泰养老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:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

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
2016年1月20日

宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月20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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈新兴产业混合
基金主代码	001128
交易代码	001128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月13日
报告期末基金份额总额	4,102,849,407.05份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,精选新兴产业及其相关行业中的优质企业进行投资,分享新兴产业发展所带来的投资机会,力争为投资者带来长期的超额收益。
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。 本基金所指的新兴产业是指随着科研、技术、工艺、产品、服务、商业模式以及管理等方面的创新和变革而产生和发展起来的新兴产业部门。当前所指的新兴产业主要包括:新能源、节能环保、新能源汽车、信息产业、生物医药、国防军工、新材料、高端装备制造、现代服务业及海洋产业等。本基金管理人将重点投资新兴产业及其上下游延伸产业的相关个股,深入挖掘主题投资机会,分享这一投资机遇。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%
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

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	78,625,747.89
2.本期利润	945,575,801.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.2215
4.期末基金资产净值	3,288,110,133.18
5.期末基金份额净值	0.801

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