

宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

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

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人招商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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	39

§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
§ 11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	1,758,263,611.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	<p>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。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>（二）固定收益类资产投资策略</p> <p>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。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>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构建备选股票库。</p> <p>（四）权证投资策略</p> <p>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。</p>

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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	张燕
	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518034	518040
法定代表人		李文众	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

§ 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	384,614,929.24
本期利润	342,176,734.84

加权平均基金份额本期利润	0.1864
本期加权平均净值利润率	14.95%
本期基金份额净值增长率	25.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	541,110,921.43
期末可供分配基金份额利润	0.3078
期末基金资产净值	2,339,570,027.97
期末基金份额净值	1.331
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	43.58%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

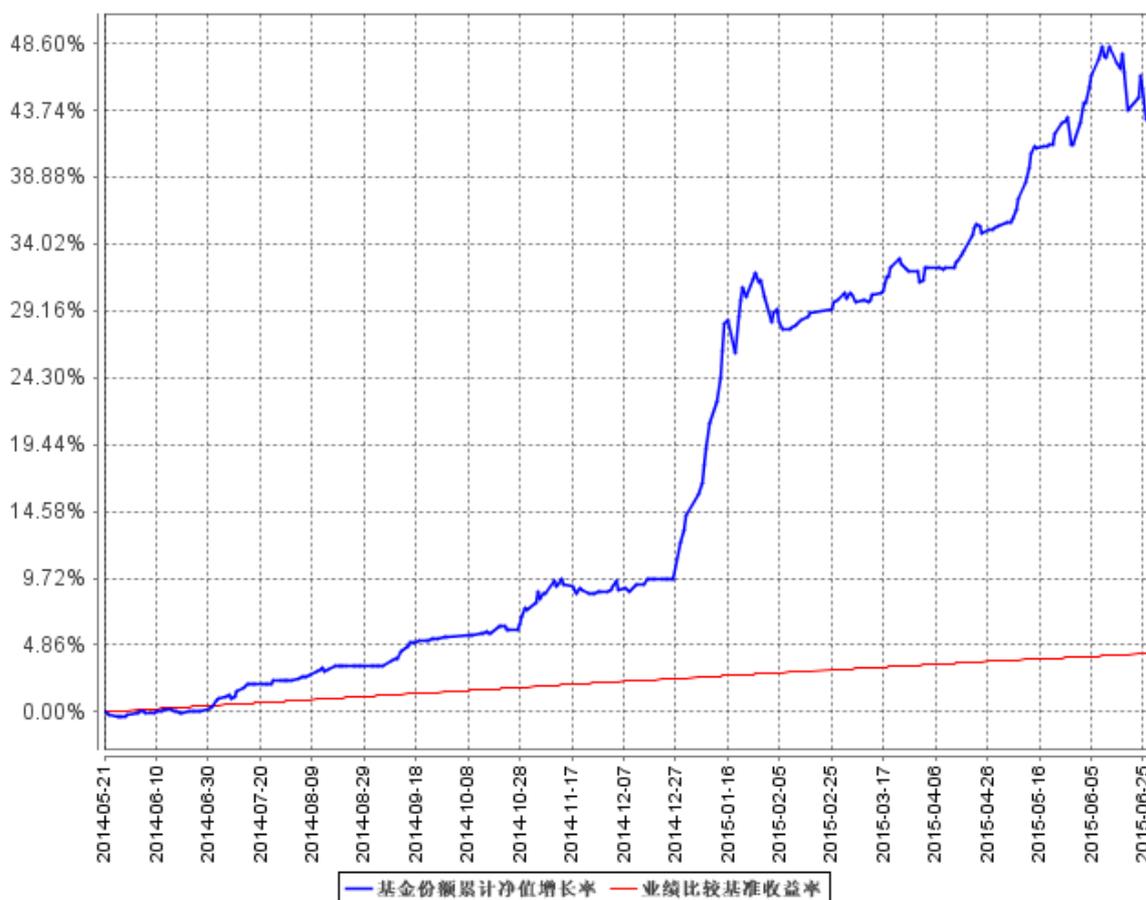
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	1.68%	0.87%	0.28%	0.01%	1.40%	0.86%
过去三个月	9.37%	0.58%	0.84%	0.01%	8.53%	0.57%
过去六个月	25.68%	0.65%	1.75%	0.01%	23.93%	0.64%
过去一年	43.29%	0.51%	3.80%	0.01%	39.49%	0.50%
自基金合同生效起至今	43.58%	0.48%	4.27%	0.01%	39.31%	0.47%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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		
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。
于启明	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理	2014年5月21日	2015年6月13日	8年	于启明先生，经济学学士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司，历任投研秘书（集中交易员）及债券组合研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理均为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

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合规守信情况的说明

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

报告期内，宏观经济下行态势依然明显，为托底经济增长，央行持续加大货币政策宽松力度，多次下调存贷款利率、存款准备金率，并通过逆回购、MLF 等操作持续向市场注入流动性；财政政策方面，包括降低购房首付、减免购房税费、加快基础设施项目审批进度等积极措施也接连推出。

报告期内，随着货币政策宽松力度持续加大，市场资金面异常充裕，隔夜和 7 天回购利率均大幅下行，多年来首次跌破 1% 和 2% 的水平，即使 6 月末传统的机构考核时期，也未对资金面带来过多扰动；债券市场方面，随着货币政策放松力度加大，资金利率大幅回落，各债券品种收益率也出现明显下行，报告期内，我们适当提高了组合久期和组合杠杆，在控制流动性风险和信用风险的前提下，积极参与债券市场的投资机会。

报告期内，6 月份前，我们在股票市场持续走高过程中，积极参与了股票二级市场投资；进入 6 月份，随着指数进入高位，盘中震荡加剧，并逐步显示向下调整迹象，我们逐步降低了权益类资产的配置比例。同时，我们积极参与新股申购，从中选择优质标的进行稳健投资。

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 1.331 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 25.68%，业绩比较基准收益率为 1.75%。

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 2015 年下半年，我们认为宏观经济仍将低位运行，为巩固经济增长，货币政策仍有进一

步放松的空间。货币市场方面，在政策呵护下，市场资金面整体将继续维持宽松，同时 IPO 的暂停和权益市场步入调整，也有助于货币市场的平稳运行；债券市场受益于理财资金、打新资金的回流，配置需求增加，收益率仍将有进一步下行的空间。

债券市场方面，下半年，我们将密切跟踪经济增长、权益市场、通胀预期、地方债供应的变化，在控制流动性风险和信用风险的前提下，选择适当的组合杠杆和久期，积极参与债券市场投资。

权益市场方面，6 月份开始的 A 股大幅回调，在一定程度上释放了前期快速上涨积累的风险，但也极大打击了市场投资者信心，不过随之而来的一系列利好政策的密集出台，也传递出政府部门意在呵护市场的信息。中长期看，本轮 A 股的大幅调整，有利于权益市场未来更好发展，但短期内投资者信心的修复仍需要等待一定时间。对于下半年的权益市场，我们将在控制风险的前提下，耐心等待市场企稳，谨慎选择具有较高安全边际的品种参与投资。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：宝盈祥瑞养老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	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	321,295,044.83	4,108,895.69
结算备付金		5,972,385.59	11,244,193.28
存出保证金		1,512,606.18	738,716.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,090,413,419.38	846,872,337.63

其中：股票投资		229,933,949.98	152,160,851.23
基金投资		-	-
债券投资		1,860,479,469.40	694,711,486.40
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	250,000,575.00	346,281,319.42
应收证券清算款		294,226,495.84	968,933.31
应收利息	6.4.7.5	16,827,197.85	17,191,194.74
应收股利		-	-
应收申购款		3,529,813.43	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,983,777,538.10	1,227,405,590.70
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		599,999,510.00	311,999,859.80
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		38,479,054.24	137,006.30
应付管理人报酬		1,988,522.64	701,579.44
应付托管费		397,704.54	140,315.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,134,622.79	958,164.75
应交税费		-	-
应付利息		22,382.39	135,888.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	185,713.53	60,161.23
负债合计		644,207,510.13	314,132,976.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,758,263,611.59	862,521,388.63
未分配利润	6.4.7.10	581,306,416.38	50,751,225.90
所有者权益合计		2,339,570,027.97	913,272,614.53
负债和所有者权益总计		2,983,777,538.10	1,227,405,590.70

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.331 元，基金份额总额 1,758,263,611.59 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈祥瑞养老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	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 5 月 21 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		370,246,818.33	4,119,497.38
1. 利息收入		43,614,120.74	4,031,277.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	799,969.79	129,700.72
债券利息收入		38,556,073.89	3,527,225.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,258,077.06	374,350.83
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		363,832,331.55	1,335,251.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	403,716,366.21	198,864.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-42,681,028.36	956,855.08
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	2,796,993.70	179,531.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-42,438,194.40	-1,398,167.73
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	5,238,560.44	151,136.50
减：二、费用		28,070,083.49	2,606,091.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,384,294.52	1,034,900.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,276,858.91	206,980.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,183,737.58	142,202.64
5. 利息支出		5,033,977.71	1,185,385.33
其中：卖出回购金融资产支出		5,033,977.71	1,185,385.33
6. 其他费用	6.4.7.20	191,214.77	36,622.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		342,176,734.84	1,513,405.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		342,176,734.84	1,513,405.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥瑞养老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)	862,521,388.63	50,751,225.90	913,272,614.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	342,176,734.84	342,176,734.84
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)	895,742,222.96	188,378,455.64	1,084,120,678.60
其中：1. 基金申购款	2,040,484,006.84	465,085,065.64	2,505,569,072.48
2. 基金赎回款	-1,144,741,783.88	-276,706,610.00	-1,421,448,393.88
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)	1,758,263,611.59	581,306,416.38	2,339,570,027.97
项目	上年度可比期间 2014 年 5 月 21 日(基金合同生效日)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)	950,024,158.14	-	950,024,158.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,513,405.97	1,513,405.97
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)	-40,070,562.39	-5,325.32	-40,075,887.71
其中：1. 基金申购款	227,085.15	47.62	227,132.77
2. 基金赎回款	-40,297,647.54	-5,372.94	-40,303,020.48
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)	909,953,595.75	1,508,080.65	911,461,676.40
-----------------	----------------	--------------	----------------

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：

<u>汪钦</u>	<u>胡坤</u>	<u>何瑜</u>
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

宝盈祥瑞养老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[2014]第 435 号《关于核准宝盈祥瑞养老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《宝盈祥瑞养老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 949,880,773.02 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 262 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 950,024,158.14 份基金份额,其中认购资金利息折合 143,385.12 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥瑞养老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、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、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。基金的投资组合比例为:股票资产占基金总资产的比例为 0%-40%;债券、货币市场工具、现金以及其他资产的比例合计不低于基金资产的 60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%。

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+ 1%。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、

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》及其他相关税务法规和实务操作，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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。

(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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	21,295,044.83
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	300,000,000.00
合计：	321,295,044.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	232,972,898.63	229,933,949.98	-3,038,948.65	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	22,256,477.83	21,698,469.40	-558,008.43
	银行间市场	1,839,478,453.94	1,838,781,000.00	-697,453.94

	合计	1,861,734,931.77	1,860,479,469.40	-1,255,462.37
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	2,094,707,830.40	2,090,413,419.38	-4,294,411.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末衍生金融资产/负债均无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	250,000,575.00	-
合计	250,000,575.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	4,685.34
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	25,000.00
应收结算备付金利息	2,687.50
应收债券利息	16,651,944.59
应收买入返售证券利息	105,931.85
应收申购款利息	36,267.87
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	680.70
合计	16,827,197.85

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,915,123.46
银行间市场应付交易费用	219,499.33
合计	3,134,622.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	46,863.00
预提费用	138,850.53
合计	185,713.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	862,521,388.63	862,521,388.63
本期申购	2,040,484,006.84	2,040,484,006.84
本期赎回(以“-”号填列)	-1,144,741,783.88	-1,144,741,783.88
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,758,263,611.59	1,758,263,611.59

注：本期申购含红利再投资、转换入份额，本期赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,068,929.17	37,682,296.73	50,751,225.90
本期利润	384,614,929.24	-42,438,194.40	342,176,734.84
本期基金份额交易产生的变动数	143,427,063.02	44,951,392.62	188,378,455.64
其中：基金申购款	374,491,782.81	90,593,282.83	465,085,065.64

基金赎回款	-231,064,719.79	-45,641,890.21	-276,706,610.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	541,110,921.43	40,195,494.95	581,306,416.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	664,589.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	25,000.00
结算备付金利息收入	65,192.25
其他	45,187.91
合计	799,969.79

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	3,123,040,036.56
减：卖出股票成本总额	2,719,323,670.35
买卖股票差价收入	403,716,366.21

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,536,081,931.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,436,660,621.26
减：应收利息总额	142,102,338.92
买卖债券差价收入	-42,681,028.36

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生品投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,796,993.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,796,993.70

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-42,438,194.40
——股票投资	-38,463,154.18
——债券投资	-3,975,040.22
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-42,438,194.40

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	4,178,364.28
转换费	1,060,196.16
合计	5,238,560.44

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,013,187.58
银行间市场交易费用	170,550.00
合计	9,183,737.58

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	99,178.95
其他	200.00
银行汇划费用	34,164.24
债券帐户维护费	18,000.00
合计	191,214.77

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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（以下简称“宝盈基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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5月21日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,384,294.52	1,034,900.68
其中：支付销售机构的客户维护费	383,900.00	4,827.40

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 × 1.0% ÷ 当年天数

6.4.10.2.2 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5月21日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,276,858.91	206,980.14

注：支付基金托管人招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 × 0.2% ÷ 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内以及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内以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。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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5月21日(基金合同生效日)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
招商银行股份有限公司	21,295,044.83	664,589.63	751,986.92	119,809.04

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300487	蓝晓科技	2015年6月24日	2015年7月2日	新股流通受限	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
603838	四通股份	2015年6月23日	2015年7月1日	新股流通受限	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87	-
300488	恒锋工具	2015年6月25日	2015年7月1日	新股流通受限	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300489	中飞股份	2015年6月24日	2015年7月1日	新股流通受限	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-
300480	光力科技	2015年6月25日	2015年7月2日	新股流通受限	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户参与认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 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
300467	迅游科技	2015年6月25日	重大事项停牌	297.30	2015年7月2日	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的余额为 579,999,510.00 元。正回购交易中作为抵押的债券如下：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150005	15 付息国债 05	2015 年 7 月 1 日	100.36	1,800,000	180,648,000.00
150209	15 国开 09	2015 年 7 月 1 日	100.62	4,000,000	402,480,000.00
合计				5,800,000	583,128,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 20,000,000.00 元，于 2012 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的主要投资对象是基本面良好、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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	341,991,000.00	250,950,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	222,090,400.00	70,134,000.00
合计	564,081,400.00	321,084,000.00

注：未评级的部分均为国债、超级短期融资券和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	-	352,961,420.00
AAA 以下	20,696,069.40	20,666,066.40
未评级	1,275,702,000.00	-
合计	1,296,398,069.40	373,627,486.40

注：未评级的部分均为国债和政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在

证券交易所上市,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日,除卖出回购金融资产款余额中有 599,999,510.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	321,295,044.83	-	-	-	321,295,044.83
结算备付金	5,972,385.59	-	-	-	5,972,385.59
存出保证金	1,512,606.18	-	-	-	1,512,606.18
交易性金融资产	694,601,400.00	311,388,069.40	854,490,000.00	229,933,949.98	2,090,413,419.38
买入返售金融资产	250,000,000.00	-	-	-	250,000,000.00

应收证券清算款	-	-	-	294,226,495.84	294,226,495.84
应收利息	-	-	-	16,827,197.85	16,827,197.85
应收申购款	72,935.32	-	-	3,456,878.11	3,529,813.43
其他资产	-	-	-	575.00	575.00
资产总计	1,273,454,371.92	311,388,069.40	854,490,000.00	544,445,096.78	2,983,777,538.10
负债					
卖出回购金融资产款	599,999,510.00	-	-	-	599,999,510.00
应付赎回款	-	-	-	38,479,054.24	38,479,054.24
应付管理人报酬	-	-	-	1,988,522.64	1,988,522.64
应付托管费	-	-	-	397,704.54	397,704.54
应付交易费用	-	-	-	3,134,622.79	3,134,622.79
应付利息	-	-	-	22,382.39	22,382.39
其他负债	-	-	-	185,713.53	185,713.53
负债总计	599,999,510.00	-	-	44,208,000.13	644,207,510.13
利率敏感度缺口	673,454,861.92	311,388,069.40	854,490,000.00	500,237,096.65	2,339,570,027.97
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,108,895.69	-	-	-	4,108,895.69
结算备付金	11,244,193.28	-	-	-	11,244,193.28
存出保证金	738,716.63	-	-	-	738,716.63
交易性金融资产	321,084,000.00	373,627,486.40	-	152,160,851.23	846,872,337.63
买入返售金融资产	346,281,319.42	-	-	-	346,281,319.42
应收证券清算款	-	-	-	968,933.31	968,933.31
应收利息	-	-	-	17,191,194.74	17,191,194.74
资产总计	683,457,125.02	373,627,486.40	-	170,320,979.28	1,227,405,590.70
负债					
卖出回购	311,999,859.80	-	-	-	311,999,859.80

金融资产款					
应付赎回款		-	-	137,006.30	137,006.30
应付管理人报酬		-	-	701,579.44	701,579.44
应付托管费		-	-	140,315.90	140,315.90
应付交易费用		-	-	958,164.75	958,164.75
应付利息		-	-	135,888.75	135,888.75
其他负债		-	-	60,161.23	60,161.23
负债总计	311,999,859.80		-	2,133,116.37	314,132,976.17
利率敏感度缺口	371,457,265.22	373,627,486.40		-168,187,862.91	913,272,614.53

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	1. 市场利率上升 25个基点	-16,541,937.37	-3,385,275.76
2. 市场利率下降 25个基点	16,854,629.44	3,428,691.83	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金总资产的比例为 0%-40%；债券、货币市场工具、现金以及其他资产的比例合计不低于基金资产的 60%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	229,933,949.98	9.83	152,160,851.23	16.66
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	229,933,949.98	9.83	152,160,851.23	16.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 9.83%(2014 年 12 月 31 日：16.66%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14 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	229,933,949.98	7.71
	其中：股票	229,933,949.98	7.71
2	固定收益投资	1,860,479,469.40	62.35
	其中：债券	1,860,479,469.40	62.35
	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	250,000,575.00	8.38
	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	327,267,430.42	10.97
7	其他各项资产	316,096,113.30	10.59
8	合计	2,983,777,538.10	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	484,279.65	0.02
B	采矿业	55,800,000.00	2.39
C	制造业	47,202,110.77	2.02
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	225,347.22	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,234,260.04	0.05
J	金融业	124,640,000.00	5.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	347,952.30	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	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	-	-
	合计	229,933,949.98	9.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601818	光大银行	19,000,000	101,840,000.00	4.35
2	000822	山东海化	5,000,000	44,350,000.00	1.90
3	002128	露天煤业	2,000,000	32,960,000.00	1.41
4	601898	中煤能源	2,000,000	22,840,000.00	0.98
5	601009	南京银行	1,000,000	22,800,000.00	0.97
6	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.05
7	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.05
8	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.02
9	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.02
10	002769	普路通	7,710	347,952.30	0.01
11	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.01
12	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.01
13	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.01
14	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.01
15	300481	濮阳惠成	11,296	148,542.40	0.01
16	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.01
17	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.01
18	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.01
19	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.01
20	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.01
21	300480	光力科技	7,263	52,874.64	0.00

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	601766	中国南车	211,425,131.89	23.15
2	601398	工商银行	209,490,033.27	22.94
3	601299	中国北车	196,157,317.79	21.48
4	000822	山东海化	161,962,551.44	17.73
5	601818	光大银行	159,098,673.00	17.42
6	600348	阳泉煤业	103,725,896.81	11.36
7	002521	齐峰新材	100,372,435.33	10.99
8	601699	潞安环能	99,646,001.19	10.91
9	300431	暴风科技	88,910,802.55	9.74
10	002128	露天煤业	88,820,007.52	9.73
11	002078	太阳纸业	86,394,918.32	9.46
12	600585	海螺水泥	79,143,959.30	8.67
13	601169	北京银行	75,864,525.79	8.31
14	600675	中华企业	75,694,411.24	8.29
15	601088	中国神华	72,479,871.82	7.94
16	600694	大商股份	68,364,086.70	7.49
17	600123	兰花科创	67,037,615.21	7.34
18	600031	三一重工	66,567,450.94	7.29
19	601898	中煤能源	66,190,647.38	7.25
20	600970	中材国际	62,646,091.99	6.86
21	002234	民和股份	61,654,254.38	6.75
22	600028	中国石化	60,324,840.00	6.61
23	601857	中国石油	52,831,544.47	5.78
24	600720	祁连山	50,447,505.23	5.52
25	600841	上柴股份	49,573,087.28	5.43
26	600096	云天化	46,605,981.21	5.10
27	002557	洽洽食品	42,515,396.42	4.66
28	002458	益生股份	38,595,144.91	4.23
29	601009	南京银行	37,340,684.85	4.09
30	600073	上海梅林	27,229,751.49	2.98
31	000042	中洲控股	26,376,642.32	2.89

32	002134	天津普林	23,293,414.16	2.55
33	601166	兴业银行	19,202,196.60	2.10
34	601628	中国人寿	18,494,724.43	2.03

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. “买入股票成本”按买入成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601398	工商银行	204,673,737.50	22.41
2	601766	中国南车	186,773,560.65	20.45
3	601299	中国北车	172,686,941.65	18.91
4	002736	国信证券	165,695,255.35	18.14
5	300431	暴风科技	140,637,910.35	15.40
6	000822	山东海化	124,457,065.56	13.63
7	601699	潞安环能	115,064,914.51	12.60
8	002521	齐峰新材	113,394,541.59	12.42
9	600348	阳泉煤业	109,136,603.98	11.95
10	002078	太阳纸业	106,775,022.18	11.69
11	600028	中国石化	96,654,218.85	10.58
12	600970	中材国际	96,597,905.62	10.58
13	002234	民和股份	81,768,496.99	8.95
14	600585	海螺水泥	81,413,657.60	8.91
15	600675	中华企业	72,588,326.53	7.95
16	600123	兰花科创	70,213,151.99	7.69
17	601169	北京银行	67,707,789.01	7.41
18	600694	大商股份	66,730,025.23	7.31
19	600031	三一重工	65,746,051.09	7.20
20	601088	中国神华	65,525,482.61	7.17
21	002128	露天煤业	64,880,593.37	7.10
22	600096	云天化	60,764,621.78	6.65
23	601857	中国石油	53,537,446.75	5.86
24	601818	光大银行	53,151,735.20	5.82
25	002557	洽洽食品	53,145,625.41	5.82
26	600841	上柴股份	52,321,242.05	5.73
27	600720	祁连山	46,856,800.23	5.13
28	601898	中煤能源	44,245,040.98	4.84

29	002458	益生股份	33,761,239.19	3.70
30	600958	东方证券	31,844,934.20	3.49
31	000042	中洲控股	28,868,735.84	3.16
32	600073	上海梅林	27,920,551.10	3.06
33	002134	天津普林	25,754,248.44	2.82
34	601985	中国核电	24,796,066.00	2.72
35	600185	格力地产	20,261,978.64	2.22
36	601009	南京银行	20,140,336.75	2.21
37	002740	爱迪尔	19,212,712.00	2.10
38	601166	兴业银行	18,424,602.13	2.02

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

买入股票成本（成交）总额	2,835,559,923.28
卖出股票收入（成交）总额	3,123,040,036.56

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	302,082,400.00	12.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	974,622,000.00	41.66
	其中：政策性金融债	974,622,000.00	41.66
4	企业债券	20,696,069.40	0.88
5	企业短期融资券	563,079,000.00	24.07
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,860,479,469.40	79.52

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	150209	15 国开 09	5,500,000	553,410,000.00	23.65
2	150005	15 付息国债 05	3,000,000	301,080,000.00	12.87
3	150212	15 国开 12	2,200,000	219,956,000.00	9.40
4	011519004	15 国电 SCP004	1,400,000	140,504,000.00	6.01
5	041554026	15 国电集 CP002	1,300,000	130,767,000.00	5.59

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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	1,512,606.18
2	应收证券清算款	294,226,495.84
3	应收股利	-
4	应收利息	16,827,197.85
5	应收申购款	3,529,813.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,096,113.30

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	300467	迅游科技	1,107,739.80	0.05	重大事项停牌

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
8,289	212,120.11	1,448,046,222.04	82.36%	310,217,389.55	17.64%

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	3,082,827.77	0.1753%

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	>100
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 5 月 21 日) 基金份额总额	950,024,158.14
本报告期期初基金份额总额	862,521,388.63
本报告期基金总申购份额	2,040,484,006.84
减:本报告期基金总赎回份额	1,144,741,783.88
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	1,758,263,611.59

§ 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无重大人事变动。

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	
兴业证券		12,442,918,316.44	41.49%	2,157,875.46	41.48%	-

华创证券	1	1,691,023,871.35	28.72%	1,496,388.21	28.76%	-
光大证券	2	999,312,092.86	16.97%	885,699.19	17.03%	-
中银国际	1	643,753,321.25	10.93%	563,584.92	10.83%	-
中信证券	1	111,481,770.02	1.89%	98,650.44	1.90%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (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、席位变更情况

(1) 租用交易单元情况

本报告期内租用安信证券上海交易单元 1 个、安信证券深圳交易单元 1 个、招商证券上海交易单元 1 个。

(2) 退租交易单元情况

本基金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
兴业证券	1,034,769.32	0.27%	114,000,000.00	8.33%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	375,756,888.92	99.73%	1,217,000,000.00	88.90%	-	-

中银国际	-	-	38,000,000.00	2.78%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年1月8日
2	宝盈基金关于增加招商银行为旗下基金代销机构的公告	中国证券报 证券时报 证券日报	2015年1月16日
3	宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金恢复申购等业务并暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证券报 证券时报	2015年1月27日
4	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年1月28日
5	宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证券报 证券时报	2015年1月28日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年2月12日
7	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年2月12日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年2月12日
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持	中国证券报 证券时报	2015年3月3日

	有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	上海证券报 证券日报	
10	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 6 日
11	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 10 日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 17 日
13	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 19 日
14	宝盈基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
15	宝盈基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
16	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
17	宝盈基金管理有限公司关于增加万银财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
18	宝盈基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为旗下基金代销机构并	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日

	参加相关费率优惠活动的公告		
19	宝盈基金管理有限公司关于董事长(法定代表人)变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月21日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月24日
21	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月25日
22	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月28日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年4月2日
24	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月3日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月4日
26	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年4月8日
27	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月9日
28	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月14日

29	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月16日
30	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月18日
31	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月22日
32	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月23日
33	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月24日
34	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月25日
35	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月8日
36	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月12日
37	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月13日
38	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下基金代销机构及	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月15日

	参与相关费率优惠活动的公告		
39	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月19日
40	宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报 上海证券报	2015年5月20日
41	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月20日
42	宝盈祥泰养老混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报 上海证券报	2015年5月20日
43	宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报 上海证券报	2015年5月20日
44	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月21日
45	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月22日
46	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年5月22日
47	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月26日
48	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年5月27日
49	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月3日

	提示性公告		
50	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月11日
51	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月12日
52	宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报 证券时报	2015年6月13日
53	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年6月17日
54	宝盈基金管理有限公司关于子公司中铁宝盈资产管理有限公司办公地址变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年6月17日
55	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月19日
56	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月20日
57	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月24日
58	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月26日
59	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年6月27日

60	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
61	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
62	宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报 证券时报	2015 年 7 月 4 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

11.3 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 8 月 27 日