

宝盈新兴产业灵活配置混合型 证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

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

送出日期：2016 年 3 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 4 月 13 日（合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	4,102,849,407.05 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,655,193,205.96
本期利润	-1,234,817,906.01
加权平均基金份额本期利润	-0.2392
本期基金份额净值增长率	-19.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3453
期末基金资产净值	3,288,110,133.18
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，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、本基金合同于 2015 年 4 月 13 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

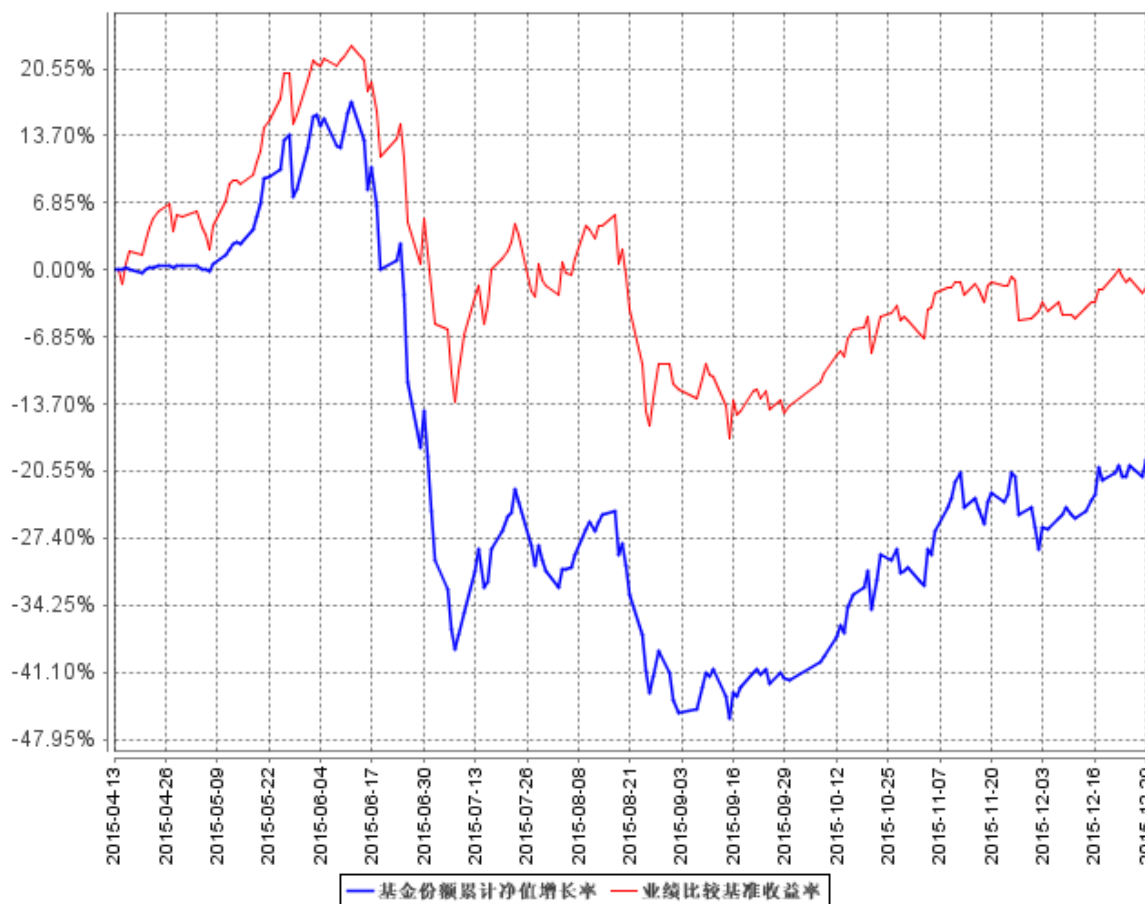
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	37.63%	2.33%	13.62%	1.30%	24.01%	1.03%
过去六个月	-6.32%	2.98%	-6.88%	2.13%	0.56%	0.85%
自基金合同生效起至今	-19.90%	2.87%	-0.13%	2.08%	-19.77%	0.79%

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

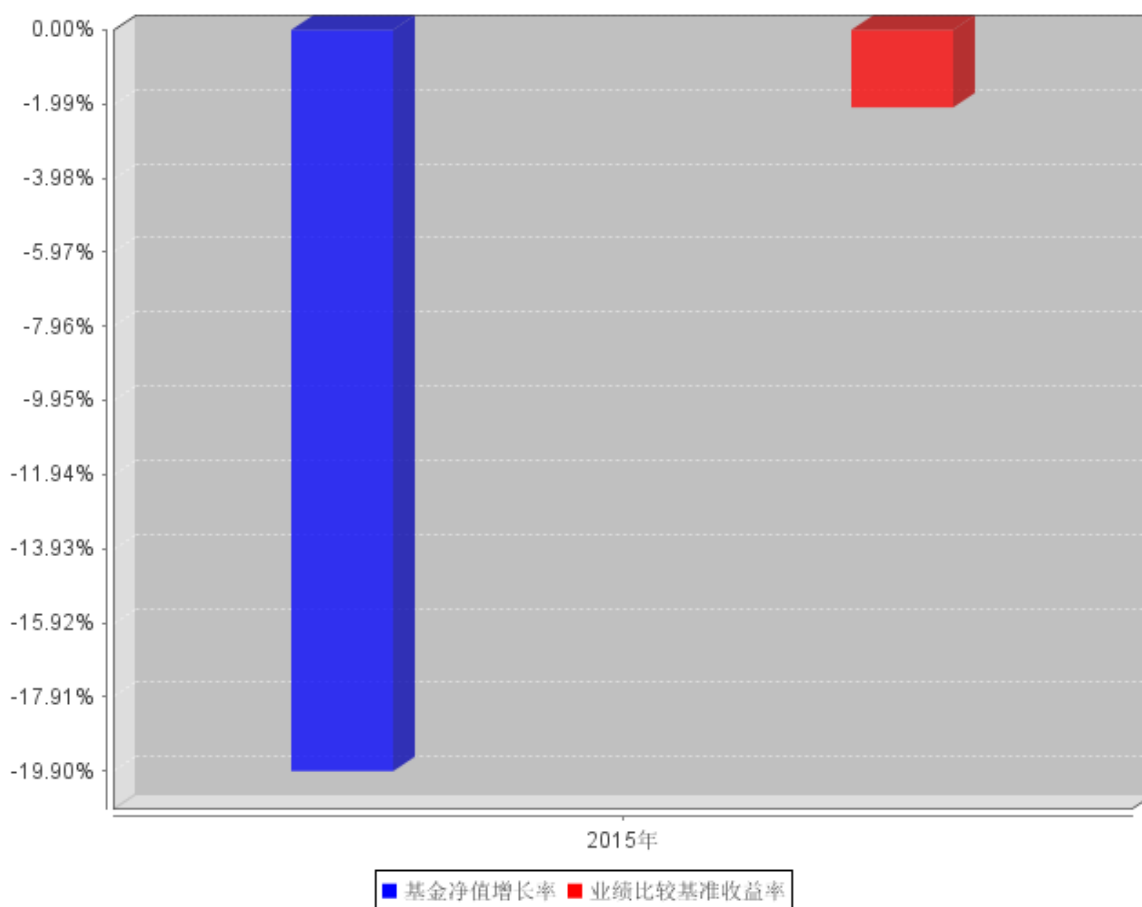


注：1、本基金合同于 2015 年 4 月 13 日生效，截止报告日本基金合同生效未满一年。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 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、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、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、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票二十一只基金，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		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理	2015年4月13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、本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

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12月31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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资合同同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交

易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 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。

4.3.3 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 A 股市场在上半年经历了大幅上涨后，在 6 月中旬后开始大幅下跌，在四季度整体有所反弹。本基金重点投资在新兴产业领域，所以持仓以成长股为主。本基金在本报告期内自基金合同生效以来净值增长率是-19.90%，同期业绩比较基准收益率是-0.13%，本基金跑输业绩比较基准，主要原因是，本基金在 4 月上旬成立，期初一个月仓位较低，在 5 月下旬后，基金净值增加到 1.05 元，有了一定盈利垫后才开始快速增加仓位，但随后市场快速大幅下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内自基金合同生效以来净值增长率是-19.90%，同期业绩比较基准收益率是-0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年 GDP 增长 6.9%，首次跌破 7%。分季度看，一季度同比增长 7.0%，二季度增长 7.0%，三季度增长 6.9%，四季度增长 6.8%，逐季降低。主要问题表现为：商品住房库存过大，钢铁煤炭产能严重过剩，PPI 连续 46 个月为负，经济下行压力越来越大。面对这样的困局，中央提出从供给侧发力，减少无效供给，扩大有效供给，提高供给结构适应性和灵活性。另外，根据国家统计局正式发布的《2015 年国民经济和社会发展统计公报》显示，全年全国房地产开发投资 95979 亿元，同比增长 1%，创下了 2013 年 2 月以来的新低，商品住房库存过高是主因，房贷首付比下降等多重政策或将有利于 2016 年房地产投资开发增速的企稳。

未来五年是全面建成小康社会的关键时期，为实现 GDP 和人均收入均比 2010 年翻番的目标，6.5%是十三五 GDP 增速的底线，2016 年作为十三五的首年，“稳增长”压力非常大，但管理层所关注的“供给侧改革”的五大任务中，过剩产能的化解和融资成本的缓解显然将对“稳增长”和“防风险”的调控目标形成冲击。管理层对“供给侧改革”的一再强调以及市场对此的积极关注，其原因是在中国经济发展中单一的需求侧刺激愈加难以为继。因此，展望 2016 年，我国经济增长面临国内国际诸多挑战，预计 2016 年中国经济增速仍将进一步减缓。经济进入转型期后，新科技与新业态，始终是资本市场关注的焦点，技术进步和创新将成为经济增长潜力的重要力量。

相较于 2015 年 A 股市场的兴衰起伏，2016 年的资本市场，一方面受经济增速中枢下行的影响，令上市公司整体业绩继续承压；另一方面，受流动性边际改善力度的弱化及估值抬升后市场吸引力的下降的影响，使 2016 年 A 股市场的估值提升空间同样面临压制。因此，预计 2016 年 A 股将呈现震荡分化，将以结构性投资机会为主。

本基金重点投资在新兴产业领域，将以成长股投资为主，成长股以新兴产业的龙头股为主，将重点关注能源互联网、军工信息化、通信流量经营等领域，另外，也会密切关注体育、泛娱乐若有深度调整带来的投资机会。另外，因为 2016 年 A 股市场的不确定性很大，基金管理人会适度调整股票仓位，希望达到收益与风险匹配的目标。

本基金主要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应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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金 2015 年年度财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第 P0317 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	245,574,881.27
结算备付金	7,815,122.46
存出保证金	2,433,846.42
交易性金融资产	3,155,758,730.54
其中：股票投资	2,955,528,730.54
基金投资	-
债券投资	200,230,000.00
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	-
应收利息	7,559,118.29
应收股利	-
应收申购款	1,678,376.40
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,420,820,075.38
负债和所有者权益	本期末 2015 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	109,373,920.43
应付赎回款	12,796,714.52
应付管理人报酬	4,094,588.45
应付托管费	682,431.41
应付销售服务费	-
应付交易费用	5,532,685.34
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	229,602.05
负债合计	132,709,942.20
所有者权益：	
实收基金	4,102,849,407.05
未分配利润	-814,739,273.87
所有者权益合计	3,288,110,133.18
负债和所有者权益总计	3,420,820,075.38

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.801 元，基金份额总额 4,102,849,407.05 份。

2. 本会计期间为 2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-1,150,583,347.06
1. 利息收入	19,017,144.97
其中：存款利息收入	5,951,145.52
债券利息收入	5,163,683.82
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	7,902,315.63
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,599,523,696.49
其中：股票投资收益	-1,608,007,893.45

基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	8,484,196.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	420,375,299.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	9,547,904.51
减：二、费用	84,234,558.95
1. 管理人报酬	45,845,460.06
2. 托管费	7,640,910.06
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	30,459,242.66
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	288,946.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,234,817,906.01
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,234,817,906.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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）	6,932,275,586.95	-	6,932,275,586.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,234,817,906.01	-1,234,817,906.01
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）	-2,829,426,179.90	420,078,632.14	-2,409,347,547.76
其中：1. 基金申购款	525,307,376.42	-111,603,944.20	413,703,432.22

2. 基金赎回款	-3,354,733,556.32	531,682,576.34	-2,823,050,979.98
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）	4,102,849,407.05	-814,739,273.87	3,288,110,133.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

宝盈新兴产业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[2015]361号《关于核准宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《宝盈新兴产业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,首次设立募集包括认购资金利息共募集6,932,275,586.95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(2015)第288号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,932,275,586.95份基金份额,其中认购资金利息折合261,651.25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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0-95%,其中投资于新兴产业相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的80%;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%;权证投资比例不得超过基金资产净值的3%;其他金融工具的投资比例按照法律法规或者监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)起至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)起至 2015 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2. 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3. 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

4. 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的证监会公告

[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输

入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 \times 1.5%的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 \times 0.25%的年费率逐日计提。

3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

4. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 每一基金份额享有同等分配权；

5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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，不缴纳营业税。
2. 对证券投资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，暂不缴纳企业所得税。
3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 关联方关系

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、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 本基金本报告期内无存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	45,845,460.06
其中：支付销售机构的客户维护费	30,102,245.42

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 1.50% 的费率计提，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 X 1.50% / 当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
----	--

当期发生的基金应支付的托管费	7,640,910.06
----------------	--------------

注：支付基金托管人中国建设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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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4月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	245,574,881.27	5,580,586.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
300366	创意信息	2015年12月29日	重大事项	77.70	-	-	1,755,330	92,361,617.16	136,389,141.00	-
000810	创维数字	2015年10月22日	重大事项	15.55	2016年1月22日	12.50	4,921,812	65,649,157.82	76,534,176.60	-
300365	恒华科技	2015年11月16日	重大事项	42.87	2016年1月27日	38.58	1,449,842	46,159,526.37	62,154,726.54	-
600682	南京新百	2015年7月1日	重大事项	32.97	2016年1月27日	33.78	1,800,000	62,523,625.56	59,346,000.00	-
002502	骅威股份	2015年8月20日	重大事项	32.02	2016年1月14日	23.35	1,299,920	35,251,107.68	41,623,438.40	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大事项	49.25	2016年3月10日	44.33	699,990	21,950,570.65	34,474,507.50	-
002707	众信旅游	2015年11月16日	重大事项	52.62	2016年3月15日	47.36	400,000	20,554,808.78	21,048,000.00	-
300162	雷曼股份	2015年11月2日	重大事项	27.06	2016年2月29日	21.47	500,000	12,176,856.97	13,530,000.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,510,428,740.50 元，第二层级的余额为 645,329,990.04 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	2,955,528,730.54	86.40
	其中：股票	2,955,528,730.54	86.40
2	固定收益投资	200,230,000.00	5.85
	其中：债券	200,230,000.00	5.85
	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	253,390,003.73	7.41
7	其他各项资产	11,671,341.11	0.34
8	合计	3,420,820,075.38	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,082,791,861.84	63.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	110,639,720.78	3.36
F	批发和零售业	193,926,789.03	5.90
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	276,112,098.69	8.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	132,222,926.20	4.02
M	科学研究和技术服务业	117,880,000.00	3.59
N	水利、环境和公共设施管理业	24,155,334.00	0.73
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	17,800,000.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	2,955,528,730.54	89.89

8.3 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	002123	荣信股份	12,499,693	320,617,125.45	9.75
2	300078	思创医惠	4,131,225	201,603,780.00	6.13
3	002546	新联电子	6,024,537	196,821,623.79	5.99
4	300213	佳讯飞鸿	4,033,620	153,277,560.00	4.66
5	300322	硕贝德	7,699,851	150,147,094.50	4.57
6	002519	银河电子	6,199,693	147,242,708.75	4.48
7	300366	创意信息	1,755,330	136,389,141.00	4.15
8	300384	三联虹普	1,400,000	117,880,000.00	3.59

9	002323	雅百特	2,953,543	110,639,720.78	3.36
10	000801	四川九洲	3,352,120	103,681,071.60	3.15

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司 <http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002123	荣信股份	382,563,099.60	11.63
2	300002	神州泰岳	291,785,867.33	8.87
3	600820	隧道股份	246,050,558.96	7.48
4	601336	新华保险	226,661,949.52	6.89
5	002323	雅百特	209,732,838.91	6.38
6	000783	长江证券	200,237,865.05	6.09
7	300246	宝莱特	197,923,694.44	6.02
8	300403	地尔汉宇	192,599,707.89	5.86
9	300206	理邦仪器	191,429,653.77	5.82
10	600029	南方航空	190,507,656.59	5.79
11	000829	天音控股	189,901,618.28	5.78
12	600122	宏图高科	186,398,719.25	5.67
13	600594	益佰制药	184,073,666.93	5.60
14	600015	华夏银行	166,128,655.62	5.05
15	000566	海南海药	161,719,451.78	4.92
16	300366	创意信息	160,879,771.52	4.89
17	002546	新联电子	158,170,172.04	4.81
18	300213	佳讯飞鸿	152,959,994.78	4.65
19	601688	华泰证券	152,303,247.03	4.63
20	300322	硕贝德	152,142,300.89	4.63
21	002260	德奥通航	151,676,451.61	4.61
22	600420	现代制药	151,585,455.04	4.61
23	000810	创维数字	148,036,105.31	4.50
24	002197	证通电子	147,144,934.98	4.48
25	000838	财信发展	145,522,397.55	4.43
26	000955	欣龙控股	143,257,522.76	4.36

27	002366	台海核电	142,859,116.16	4.34
28	002519	银河电子	142,300,863.78	4.33
29	002084	海鸥卫浴	140,073,122.83	4.26
30	002063	远光软件	137,593,408.42	4.18
31	300243	瑞丰高材	137,488,193.04	4.18
32	600093	禾嘉股份	135,441,128.01	4.12
33	300075	数字政通	135,135,077.27	4.11
34	300212	易华录	132,695,991.26	4.04
35	002279	久其软件	132,158,960.11	4.02
36	300011	鼎汉技术	129,268,165.53	3.93
37	000078	海王生物	124,767,918.55	3.79
38	601928	凤凰传媒	123,419,337.25	3.75
39	300400	劲拓股份	116,515,374.83	3.54
40	300078	思创医惠	113,892,783.30	3.46
41	000671	阳光城	109,686,086.44	3.34
42	000803	金宇车城	109,629,277.29	3.33
43	002327	富安娜	104,711,356.31	3.18
44	002380	科远股份	101,439,032.55	3.09
45	000889	茂业通信	99,872,088.83	3.04
46	300384	三联虹普	98,560,333.00	3.00
47	002215	诺普信	98,069,710.09	2.98
48	002332	仙琚制药	95,126,844.95	2.89
49	002037	久联发展	94,320,857.14	2.87
50	300342	天银机电	94,078,420.84	2.86
51	000801	四川九洲	92,736,605.25	2.82
52	002055	得润电子	92,356,109.48	2.81
53	000661	长春高新	92,304,491.90	2.81
54	300154	瑞凌股份	92,267,693.34	2.81
55	603128	华贸物流	91,838,052.55	2.79
56	300458	全志科技	90,653,239.56	2.76
57	600171	上海贝岭	89,980,502.23	2.74
58	000802	北京文化	89,776,574.36	2.73
59	603898	好莱客	88,761,131.10	2.70
60	002364	中恒电气	88,065,137.50	2.68
61	002487	大金重工	85,844,673.69	2.61
62	300354	东华测试	82,765,986.81	2.52

63	002085	万丰奥威	82,600,068.00	2.51
64	601198	东兴证券	82,521,871.55	2.51
65	002154	报喜鸟	80,422,075.70	2.45
66	300049	福瑞股份	78,830,591.04	2.40
67	600865	百大集团	76,849,413.60	2.34
68	000042	中洲控股	75,171,360.47	2.29
69	002576	通达动力	75,005,485.50	2.28
70	600061	中纺投资	73,735,645.27	2.24
71	600705	中航资本	72,889,107.00	2.22
72	000547	航天发展	72,276,232.14	2.20
73	000712	锦龙股份	71,851,082.20	2.19
74	600478	科力远	71,526,753.04	2.18
75	000089	深圳机场	71,479,890.08	2.17
76	603598	引力传媒	69,386,736.82	2.11

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601336	新华保险	228,765,737.49	6.96
2	300002	神州泰岳	216,513,320.07	6.58
3	000783	长江证券	193,991,212.84	5.90
4	002197	证通电子	189,329,972.10	5.76
5	600029	南方航空	186,839,999.89	5.68
6	300403	地尔汉宇	170,538,159.26	5.19
7	600015	华夏银行	160,224,221.88	4.87
8	600820	隧道股份	159,233,552.59	4.84
9	601928	凤凰传媒	142,021,839.75	4.32
10	601688	华泰证券	140,534,394.05	4.27
11	300206	理邦仪器	136,987,725.67	4.17
12	600594	益佰制药	136,986,228.29	4.17
13	002323	雅百特	134,194,490.44	4.08
14	002123	荣信股份	129,732,268.58	3.95
15	000566	海南海药	123,824,430.84	3.77
16	600122	宏图高科	123,355,128.08	3.75

17	600093	禾嘉股份	120,900,182.22	3.68
18	300212	易华录	118,028,420.15	3.59
19	002154	报喜鸟	117,521,377.22	3.57
20	300458	全志科技	113,906,713.87	3.46
21	002366	台海核电	113,455,056.34	3.45
22	000829	天音控股	108,551,922.93	3.30
23	300400	劲拓股份	106,759,923.79	3.25
24	300075	数字政通	106,741,007.11	3.25
25	000838	财信发展	104,790,221.69	3.19
26	000955	欣龙控股	103,588,294.48	3.15
27	002063	远光软件	103,587,793.58	3.15
28	300366	创意信息	102,994,056.58	3.13
29	002084	海鸥卫浴	99,099,211.83	3.01
30	000671	阳光城	95,557,299.37	2.91
31	300011	鼎汉技术	90,944,728.53	2.77
32	000661	长春高新	89,642,277.90	2.73
33	601198	东兴证券	81,965,302.99	2.49
34	300243	瑞丰高材	81,374,712.43	2.47
35	000802	北京文化	80,648,553.61	2.45
36	002327	富安娜	75,403,392.31	2.29
37	002055	得润电子	74,685,032.95	2.27
38	600478	科力远	69,853,305.80	2.12
39	603128	华贸物流	69,000,312.51	2.10
40	002279	久其软件	68,161,118.89	2.07
41	002085	万丰奥威	67,880,373.30	2.06
42	000042	中洲控股	67,259,807.88	2.05

注：1、卖出主要指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、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	12,916,279,082.01
卖出股票收入（成交）总额	8,777,012,440.77

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。

8.5 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	100,220,000.00	3.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,010,000.00	3.04
	其中：政策性金融债	100,010,000.00	3.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,230,000.00	6.09

8.6 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	019509	15 国债 09	1,000,000	100,220,000.00	3.05
2	018001	国开 1301	1,000,000	100,010,000.00	3.04

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	2,433,846.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,559,118.29
5	应收申购款	1,678,376.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,671,341.11

8.12.4 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。

8.12.5 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	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	----------	----------

			价值	例 (%)	
1	300366	创意信息	136,389,141.00	4.15	重大事项

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
46,769	87,725.83	9,442,211.94	0.23%	4,093,407,195.11	99.77%

9.2 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	24,741.35	0.0006%

9.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015年4月13日) 基金份额总额	6,932,275,586.95
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	525,307,376.42
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,354,733,556.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	4,102,849,407.05
-------------	------------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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重大人事变动情况如下：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理；2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）负责本基金的审计事务。该事项经本基金管理人股东会审议通过，按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人，并已按规定向中国证券监督管理委员会、深圳证监局备案。从 2015 年起，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期本基金应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 80,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国信证券		18,264,029,648.64	38.11%	7,312,843.15	37.57%	-
招商证券		12,707,113,365.03	12.49%	2,429,284.42	12.48%	-
西南证券		12,491,338,316.95	11.49%	2,270,357.83	11.67%	-
兴业证券		21,958,526,938.90	9.03%	1,784,807.90	9.17%	-
申银万国证券		11,826,366,381.07	8.42%	1,641,358.87	8.43%	-
平安证券		11,213,990,743.80	5.60%	1,092,964.22	5.62%	-
国泰君安		11,206,320,468.16	5.56%	1,099,312.33	5.65%	-
银河证券	2	839,195,483.34	3.87%	764,758.18	3.93%	-
华泰证券	1	437,208,589.00	2.02%	394,777.41	2.03%	-
中金公司	2	389,517,917.49	1.80%	354,967.27	1.82%	-
东方证券	2	348,406,064.82	1.61%	317,503.36	1.63%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (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单元租用协议。

2、应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单独指股票交易佣金。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

(1) 本报告期内新租华泰证券上海交易单元一个,国泰君安证券上海交易单元一个,国信证券深圳交易单元一个,招商证券上海交易单元一个,长城证券上海、深圳交易单元各一个,东方证券上海、深圳交易单元各一个,中金公司上海、深圳交易单元各一个,银河证券上海、深圳交易单元各一个,国金证券上海、深圳交易单元各一个,长江证券上海、深圳交易单元各一个,兴业证券上海、深圳交易单元各一个,广发证券上海、深圳交易单元各一个,申万宏源上海交易单元一个,平安证券深圳交易单元一个,安信证券上海、深圳交易单元各一个,西南证券深圳交易单元一个,东吴证券上海交易单元一个。

(2) 本报告期内未退租交易单元。

11.7.2 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	204,217,163.39	100.00%	17,350,000,000.00	58.48%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	12,320,000,000.00	41.52%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司
2016年3月26日