

宝盈转型动力灵活配置混合型  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 29 日（基金合同生效日）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    |
| 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       |
| 报告期末基金份额总额 | 4,780,837,689.37 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。<br>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。  |

### 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         | 中国农业银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张瑾                 | 林葛                 |
|         | 联系电话 | 0755-83276688      | 010-66060069       |
|         | 电子邮箱 | zhangj@byfunds.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-300       | 95599              |
| 传真      |      | 0755-83515599      | 010-68121816       |

## 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 29 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益       | -1,100,225,815.94                         |
| 本期利润          | -856,435,446.15                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1607                                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -11.40%                                   |
| 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  | -0.2086                                   |
| 期末基金资产净值      | 4,233,850,002.78                          |
| 期末基金份额净值      | 0.886                                     |

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、本基金合同生效日为 2015 年 4 月 29 日，截止本报告期末基金合同生效未满一年。

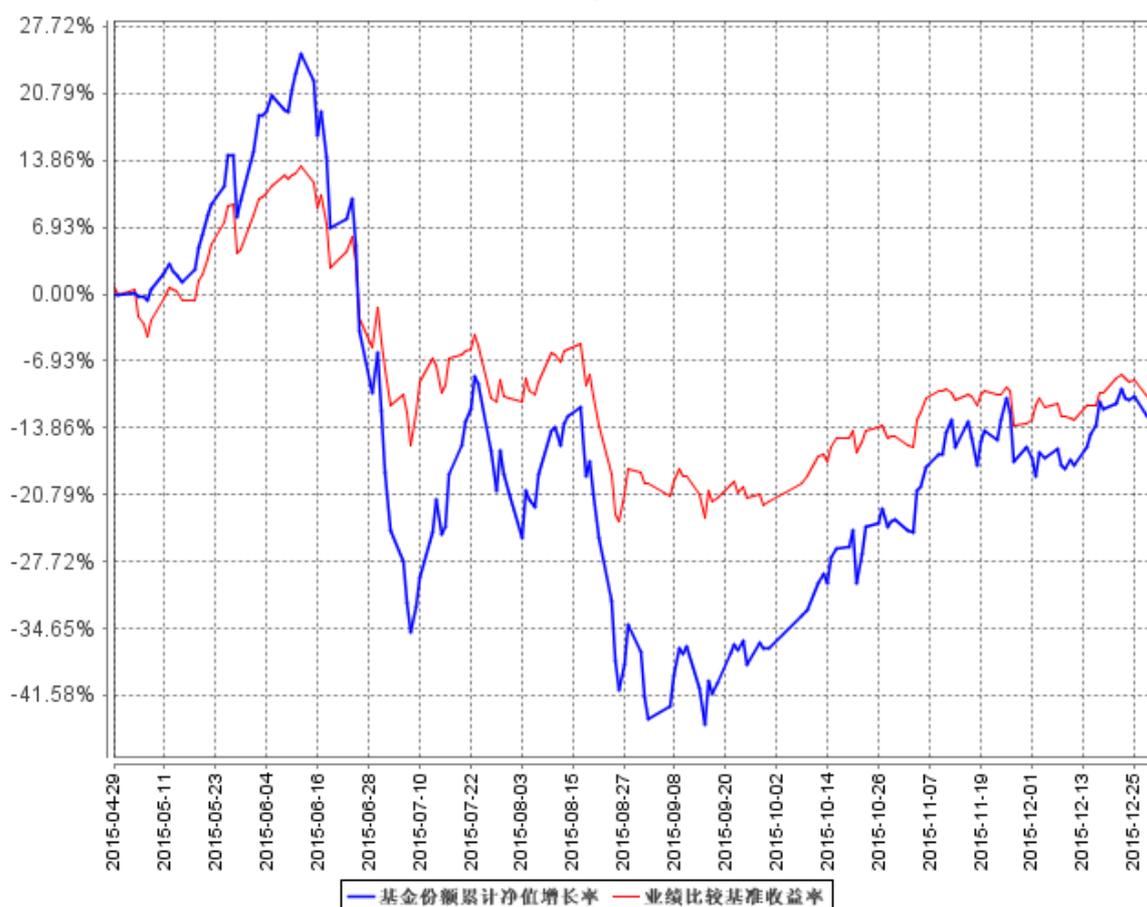
### 3.2 基金净值表现

#### 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      | 39.75%   | 2.43%       | 13.82%     | 1.20%         | 25.93% | 1.23% |
| 过去六个月      | -5.64%   | 3.81%       | -9.31%     | 1.92%         | 3.67%  | 1.89% |
| 自基金合同生效起至今 | -11.40%  | 3.59%       | -9.92%     | 1.95%         | -1.48% | 1.64% |

### 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

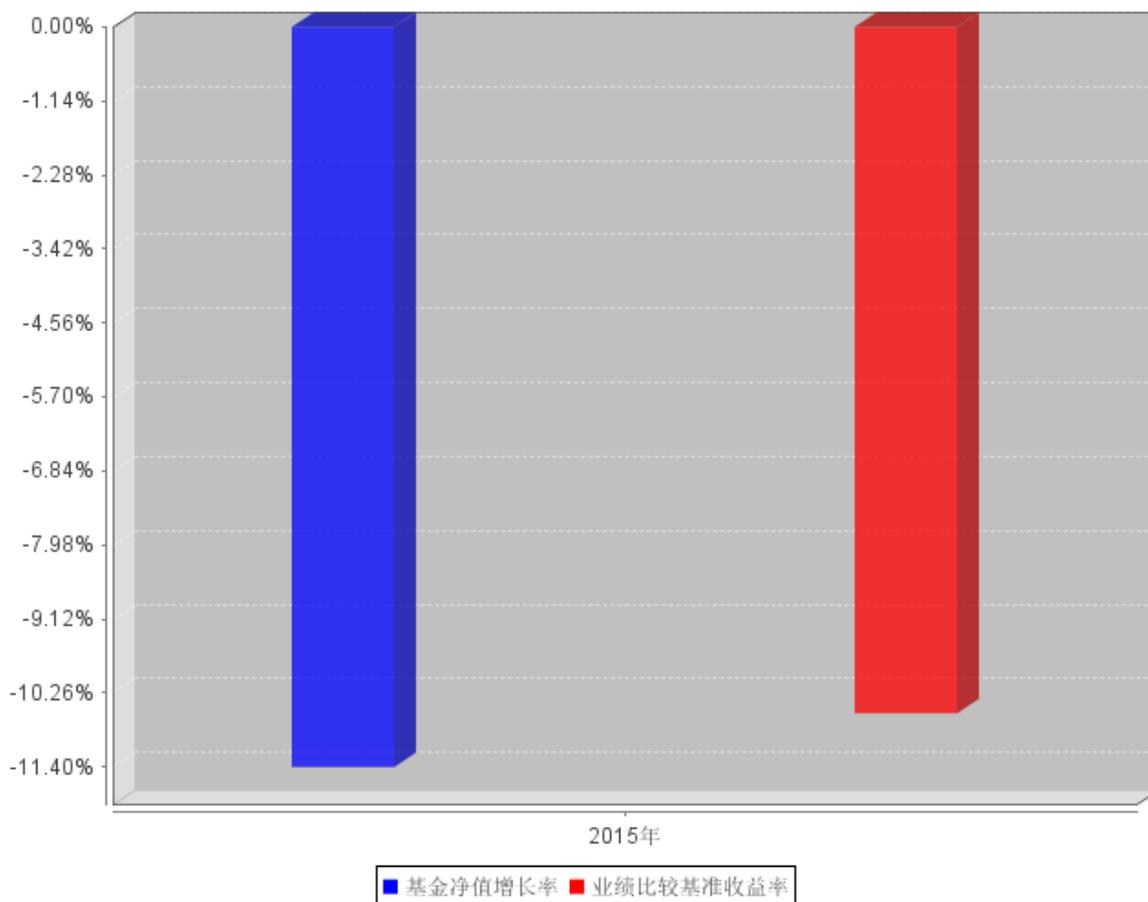


注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

2、本基金合同生效日为2015年4月29日，截止本报告期末基金合同生效未满一年。

### 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



注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 29 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为 2015 年 4 月 29 日，至报告期末未进行利润分配。

## § 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        |        |  |
| 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。 |
| 郝淼 | 本基金基金经理助理、鸿阳证券投资基金基金经理助理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理 | 2015年4月29日      | 2015年10月30日 | 4年     | 郝淼先生，中国科学院生物化学与分子生物学博士。历任中科院上海生命科学院助理研究员、平安证券研究所医药行业研究员，2013年6月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。                     |
| 李进 | 本基金基金经理助理、鸿阳证券投资基金基金经理助理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理 | 2015年6月8日       | -           | 4年     | 李进先生，武汉大学金融学硕士。历任中国农业银行深圳市分行信贷审批员、华泰联合证券研究所研究员，2014年8月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、   |

|  |   |  |  |  |                           |
|--|---|--|--|--|---------------------------|
|  | 理 |  |  |  | 基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
|--|---|--|--|--|---------------------------|

注：1、本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”指基金合同生效日；

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组合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

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。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 2 次，2 次均为不同投资组合因投资策略不同而发生的反向交易，相关投资组合经理按规定履行了审批程序。

## 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 股市场大幅波动。上半年，在改革预期和流动性宽松的双重刺激下，股票市场大幅上涨，尤其是代表新经济和未来发展方向的中小创股票涨幅巨大。沪深 300、中小板和创业板指数在上半年涨幅最高分别为 52.26%、121.28% 和 174.36%。

随着 6 月份监管层采取措施去杠杆，市场风险偏好大幅降低，出现流动性危机，中小板个股出现踩踏事件，市场大幅下跌。

经历了 2015 年三季度的大幅下跌之后，在政府系列救市措施的支持下，A 股在四季度出现了较大幅度的反弹，风格指数差异较大，整体反弹以小市值、前期跌幅较大的个股为主。

报告期内，我们仍然坚持自下而上的选股方法，重点投资了环保、TMT、新能源汽车、医疗服务、医药、传媒、高端设备制造等行业，在主题上布局了国企改革、军工、互联网应用等。

### 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-11.40%，同期业绩比较基准收益率是-9.92%。

## 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 2016 年的投资机会，我们相对谨慎。一是宏观经济层面不会有较大幅度的反弹，即在盈利层面找不到很好的投资机会。代表改革和创新的成长及主题投资个股经过前期的大幅反弹，估值偏高。二是流动性整体宽松，无风险利率继续维持在低位，但进一步宽松和下行的幅度有限，加之美元处于加息周期，对新兴市场的流动性冲击较大。

本基金将坚持重点投资改革与转型个股的整体投资思路，将继续坚持自下而上个股选择的投资思路，重点配置受益于经济转型的相关行业，相对集中在新兴产业或传统产业中向新兴产业转

型的行业之中，如信息安全、互联网垂直应用、VR 相关产业、智能驾驶、人工智能、体育产业、环保、新材料、电子元器件、高端装备制造、农业等；受益于国企改革、军工、稳增长的个股也有很好的投资机会。

在目前这个阶段，我们将在组合中适当增加盈利增长稳定、估值相对偏低的防御性品种，主要集中在消费、医药、汽车和家电等领域。

#### **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、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

在托管宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《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托管协议》的约定，对宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司 2015 年 4 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司在宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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 P0318 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：宝盈转型动力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<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|
| <b>资产:</b>    |                         |
| 银行存款          | 321,812,379.86          |
| 结算备付金         | 1,604,754.96            |
| 存出保证金         | 3,862,603.30            |
| 交易性金融资产       | 3,952,877,383.46        |
| 其中: 股票投资      | 3,952,877,383.46        |
| 基金投资          | -                       |
| 债券投资          | -                       |
| 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       | 29,999,987.82           |
| 应收利息          | 84,608.47               |
| 应收股利          | -                       |
| 应收申购款         | 2,583,550.24            |
| 其他资产          | -                       |
| 资产总计          | 4,312,825,268.11        |
| 负债和所有者权益      | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
| <b>负债:</b>    |                         |
| 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       | 60,915,241.44           |
| 应付赎回款         | 9,469,211.59            |
| 应付管理人报酬       | 5,335,203.00            |
| 应付托管费         | 889,200.53              |
| 应付销售服务费       | -                       |
| 应付交易费用        | 2,205,445.68            |
| 应交税费          | -                       |
| 应付利息          | -                       |
| 应付利润          | -                       |
| 其他负债          | 160,963.09              |
| 负债合计          | 78,975,265.33           |
| <b>所有者权益:</b> |                         |
| 实收基金          | 4,780,837,689.37        |
| 未分配利润         | -546,987,686.59         |
| 所有者权益合计       | 4,233,850,002.78        |
| 负债和所有者权益总计    | 4,312,825,268.11        |

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.886 元，基金份额总额 4,780,837,689.37 份。

2. 本会计期间为 2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日，无上年可比期间数据。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 29 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<br>2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|--|
| <b>一、收入</b>                | -783,249,590.42                                      |
| 1. 利息收入                    | 4,320,845.83   |
| 其中：存款利息收入                  | 4,320,845.83   |
| 债券利息收入                     | -  |
| 资产支持证券利息收入                 | -  |
| 买入返售金融资产收入                 | -  |
| 其他利息收入                     | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | -1,038,616,494.97                                    |
| 其中：股票投资收益                  | -1,061,767,315.55                                    |
| 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                       | 23,150,820.58  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 243,790,369.79                                       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7,255,688.93   |
| <b>减：二、费用</b>              | 73,185,855.73  |
| 1. 管理人报酬                   | 45,771,999.52  |
| 2. 托管费                     | 7,628,666.61   |
| 3. 销售服务费                   | -  |
| 4. 交易费用                    | 19,503,036.01  |
| 5. 利息支出                    | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -  |
| 6. 其他费用                    | 282,153.59   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | -856,435,446.15                                      |
| 减：所得税费用                    | -  |

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -856,435,446.15 |
|-------------------|-----------------|

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 29 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<br>2015 年 4 月 29 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）                        | 5,803,935,012.50                                 | -               | 5,803,935,012.50  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -856,435,446.15 | -856,435,446.15   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -1,023,097,323.13                                | 309,447,759.56  | -713,649,563.57   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,324,674,260.76                                 | -284,488,669.91 | 1,040,185,590.85  |
| 2. 基金赎回款                               | -2,347,771,583.89                                | 593,936,429.47  | -1,753,835,154.42 |
| 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）                        | 4,780,837,689.37                                 | -546,987,686.59 | 4,233,850,002.78  |

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：

汪钦

胡坤

何瑜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“宝盈转型动力混合”）。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】1173 号《关于核准宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由宝盈基金管理有限公司根据经批准的《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基

金招募说明书》向社会公开募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，并出具普华永道中天验字（2015）第 395 号验资报告。经向中国证监会备案，《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 29 日正式生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 4 月 24 日止，首次发售募集有效认购金额为人民币 5,803,226,483.86 元，折合 5,803,226,483.86 份基金份额；有效资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 708,528.64 元，折合 708,528.64 份基金份额；以上收到的资金共计人民币 5,803,935,012.50 元，折合 5,803,935,012.50 份基金份额。本基金管理人为宝盈基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、债券回购、银行存款、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，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于转型动力主题相关的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%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%。

#### 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 29 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 29 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

本基金以人民币为记账本位币。

### 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

本基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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方

法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 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     | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国农业银行股份有限公司   | 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

本基金本报告期内无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 29 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 45,771,999.52                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 22,979,363.46                                  |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期   |
|----|--|
|    | 2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日 |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,628,666.61 |
|----------------|--------------|

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期内无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(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

份额单位：份

| 项目                              | 本期   |
|---------------------------------|--|
|                                 | 2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 基金合同生效日(2015 年 4 月 29 日)持有的基金份额 | -  |
| 期初持有的基金份额                       | -  |
| 期间申购/买入总份额                      | 13,810,773.48                              |
| 期间因拆分变动份额                       | -  |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -  |
| 期末持有的基金份额                       | 13,810,773.48                              |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例               | 0.29%                                      |

注：基金管理人宝盈基金管理有限公司在本报告期内申购本基金的交易通过基金管理人直销柜台办理，申购费用为 1,000 元。

##### 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 29 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       |
| 中国农业银行股份有限公司 | 321,812,379.86                             | 4,169,092.48 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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

本基金本报告期内无在承销期内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

无。

#### 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 |
|--------|------|------------------|------|--------|-----------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 600645 | 中源协和 | 2015 年 12 月 30 日 | 重大事项 | 65.01  | 2016 年 1 月 4 日  | 63.90  | 1,499,999 | 84,242,878.16 | 97,514,934.99 | -  |
| 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  | 1,999,955 | 26,875,688.50 | 31,099,300.25 | -  |
| 300028 | 金亚科技 | 2015 年 6 月 9 日   | 重大事项 | 24.48  | -               | -      | 1,033,890 | 50,659,368.00 | 25,309,627.20 | -  |
| 600986 | 科达股份 | 2015 年 12 月 14 日 | 重大事项 | 21.00  | -               | -      | 1,000,000 | 21,542,315.30 | 21,000,000.00 | -  |

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 3,777,953,521.02 元，第二层级的余额为 174,923,862.44 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     | 3,952,877,383.46 | 91.65         |
|    | 其中：股票    | 3,952,877,383.46 | 91.65         |
| 2  | 固定收益投资   | —                | —             |
|    | 其中：债券    | —                | —             |
|    | 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      | 323,417,134.82   | 7.50   |
| 7 | 其他各项资产            | 36,530,749.83    | 0.85   |
| 8 | 合计                | 4,312,825,268.11 | 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         | 8,455,000.00     | 0.20         |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 2,812,836,678.31 | 66.44        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 116,902,985.71   | 2.76         |
| E  | 建筑业              | 227,020,620.00   | 5.36         |
| F  | 批发和零售业           | 20,859,084.00    | 0.49         |
| 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  | 288,803,514.34   | 6.82         |
| J  | 金融业              | -                | -            |
| K  | 房地产业             | 80,987,850.45    | 1.91         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 136,950,877.44   | 3.23         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 162,954,164.59   | 3.85         |
| 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        | -                | -            |
| S  | 综合               | 97,106,608.62    | 2.29         |
|    | 合计               | 3,952,877,383.46 | 93.36        |

## 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  | 300090 | 盛运环保 | 25,471,100 | 298,266,581.00 | 7.04         |
| 2  | 002085 | 万丰奥威 | 7,664,193  | 246,633,730.74 | 5.83         |
| 3  | 002402 | 和而泰  | 7,490,886  | 212,666,253.54 | 5.02         |
| 4  | 002482 | 广田股份 | 7,043,440  | 206,020,620.00 | 4.87         |
| 5  | 300396 | 迪瑞医疗 | 3,858,660  | 185,254,266.60 | 4.38         |
| 6  | 000488 | 晨鸣纸业 | 20,502,241 | 182,879,989.72 | 4.32         |
| 7  | 002437 | 誉衡药业 | 5,610,416  | 169,715,084.00 | 4.01         |
| 8  | 002487 | 大金重工 | 10,904,055 | 154,837,581.00 | 3.66         |
| 9  | 002368 | 太极股份 | 2,235,087  | 149,974,337.70 | 3.54         |
| 10 | 603729 | 龙韵股份 | 1,219,292  | 136,950,877.44 | 3.23         |

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  | 300090 | 盛运环保 | 375,720,046.51 | 8.87           |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 314,444,080.33 | 7.43           |
| 3  | 601668 | 中国建筑 | 247,049,177.64 | 5.84           |
| 4  | 000829 | 天音控股 | 240,000,649.51 | 5.67           |
| 5  | 000488 | 晨鸣纸业 | 234,825,041.27 | 5.55           |
| 6  | 002402 | 和而泰  | 223,776,345.73 | 5.29           |
| 7  | 600685 | 中船防务 | 222,610,621.47 | 5.26           |
| 8  | 000802 | 北京文化 | 217,184,669.91 | 5.13           |
| 9  | 002482 | 广田股份 | 216,991,046.53 | 5.13           |
| 10 | 002019 | 亿帆鑫富 | 202,583,928.60 | 4.78           |
| 11 | 000532 | 力合股份 | 202,197,216.39 | 4.78           |
| 12 | 002487 | 大金重工 | 196,802,382.76 | 4.65           |
| 13 | 002085 | 万丰奥威 | 195,360,481.09 | 4.61           |
| 14 | 000858 | 五粮液  | 192,321,561.26 | 4.54           |
| 15 | 000009 | 中国宝安 | 184,977,399.89 | 4.37           |
| 16 | 002437 | 誉衡药业 | 181,384,847.23 | 4.28           |
| 17 | 300396 | 迪瑞医疗 | 167,862,006.48 | 3.96           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 18 | 603808 | 歌力思  | 166,649,571.97 | 3.94 |
| 19 | 002305 | 南国置业 | 165,749,450.42 | 3.91 |
| 20 | 002366 | 台海核电 | 164,981,829.09 | 3.90 |
| 21 | 300243 | 瑞丰高材 | 162,891,391.58 | 3.85 |
| 22 | 000791 | 甘肃电投 | 162,762,865.11 | 3.84 |
| 23 | 300348 | 长亮科技 | 158,610,779.66 | 3.75 |
| 24 | 601169 | 北京银行 | 156,133,893.58 | 3.69 |
| 25 | 000801 | 四川九洲 | 146,591,892.56 | 3.46 |
| 26 | 603306 | 华懋科技 | 141,471,599.85 | 3.34 |
| 27 | 002715 | 登云股份 | 139,340,273.82 | 3.29 |
| 28 | 600061 | 国投安信 | 134,965,483.40 | 3.19 |
| 29 | 002368 | 太极股份 | 133,864,866.11 | 3.16 |
| 30 | 000620 | 新华联  | 131,931,728.19 | 3.12 |
| 31 | 600172 | 黄河旋风 | 129,875,672.45 | 3.07 |
| 32 | 300053 | 欧比特  | 128,008,592.60 | 3.02 |
| 33 | 603729 | 龙韵股份 | 117,550,899.99 | 2.78 |
| 34 | 002029 | 七匹狼  | 115,023,806.43 | 2.72 |
| 35 | 002642 | 荣之联  | 104,704,062.42 | 2.47 |
| 36 | 002606 | 大连电瓷 | 104,073,795.91 | 2.46 |
| 37 | 300420 | 五洋科技 | 103,793,771.19 | 2.45 |
| 38 | 600260 | 凯乐科技 | 98,494,567.40  | 2.33 |
| 39 | 300384 | 三联虹普 | 91,712,708.00  | 2.17 |

注：“买入金额”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。

#### 8.4.2 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  | 601166 | 兴业银行 | 269,450,975.52 | 6.36           |
| 2  | 000802 | 北京文化 | 219,866,464.57 | 5.19           |
| 3  | 601668 | 中国建筑 | 186,992,048.77 | 4.42           |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 164,814,802.56 | 3.89           |
| 5  | 601169 | 北京银行 | 153,649,576.41 | 3.63           |
| 6  | 600685 | 中船防务 | 146,247,852.20 | 3.45           |
| 7  | 000620 | 新华联  | 140,486,330.90 | 3.32           |
| 8  | 000009 | 中国宝安 | 137,119,781.10 | 3.24           |
| 9  | 000829 | 天音控股 | 111,903,751.80 | 2.64           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 10 | 000532 | 力合股份 | 107,911,412.59 | 2.55 |
| 11 | 000791 | 甘肃电投 | 107,453,644.49 | 2.54 |
| 12 | 300090 | 盛运环保 | 101,059,397.74 | 2.39 |
| 13 | 600172 | 黄河旋风 | 100,501,302.71 | 2.37 |
| 14 | 603306 | 华懋科技 | 93,478,162.75  | 2.21 |
| 15 | 002019 | 亿帆鑫富 | 79,549,699.32  | 1.88 |
| 16 | 600055 | 华润万东 | 76,096,160.35  | 1.80 |
| 17 | 601058 | 赛轮金宇 | 75,786,008.90  | 1.79 |
| 18 | 002029 | 七匹狼  | 75,173,489.46  | 1.78 |
| 19 | 000036 | 华联控股 | 74,831,374.73  | 1.77 |
| 20 | 601808 | 中海油服 | 74,218,553.74  | 1.75 |

注：“卖出金额”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。

#### 8.4.3 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 | 9,674,896,997.97 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,904,042,668.75 |

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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   | 3,862,603.30  |
| 2  | 应收证券清算款 | 29,999,987.82 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 84,608.47     |
| 5  | 应收申购款   | 2,583,550.24  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 36,530,749.83 |

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限。

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 68,789       | 69,500.03     | 49,525,508.37 | 1.04%      | 4,731,312,181.00 | 98.96%     |

### 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 | 4,417.88  | 0.0001%  |

### 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29日）基金份额总额 | 5,803,935,012.50 |
| 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     | 1,324,674,260.76 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额   | 2,347,771,583.89 |

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 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                        | 4,780,837,689.37 |

## § 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无重大人事变动。

### 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，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。

### 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 |    |
| 中银国际 |        | 13,951,439,338.31 | 27.10%       | 3,496,631.05 | 26.72%     | -  |
| 银河证券 |        | 13,228,305,984.99 | 22.14%       | 2,893,930.48 | 22.12%     | -  |
| 中金公司 |        | 12,711,852,031.21 | 18.60%       | 2,464,569.56 | 18.84%     | -  |
| 广发证券 |        | 12,359,332,837.80 | 16.18%       | 2,087,775.76 | 15.96%     | -  |
| 申万宏源 |        | 21,253,203,508.33 | 8.60%        | 1,142,045.82 | 8.73%      | -  |
| 海通证券 |        | 11,074,532,959.76 | 7.37%        | 998,945.05   | 7.63%      | -  |
| 招商证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 华创证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 兴业证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 长江证券 | 2      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 中信建投 | 2      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |

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，并能为本基金提供全面的信息服。
- (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、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(I) 租用交易单元情况

本报告期内新增兴业证券 1 个深圳交易单元；海通证券 1 个上海交易单元；中信证券 1 个上海交易单元；中银国际 1 个深圳交易单元；中金公司 1 个深圳交易单元；国信证券 1 个上海交易单元；银河证券 1 个上海交易单元；广发证券 1 个深圳交易单元；华创证券 1 个深圳交易单元；中信建投 1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元；招商证券 1 个深圳交易单元；申万宏源 1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元；国金证券 1 个上海交易单元；长江证券 1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元。

（II）退租交易单元情况

本报告期内未退租已有的交易单元。

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

无。

宝盈基金管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日