

宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 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 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。

普华永道中天会计师事务所(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 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3 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	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
8.7 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	56

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	56
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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	59
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	74
§13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	宝盈新价值混合
基金主代码	000574
交易代码	000574
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 10 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	2,079,633,886.89 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以超越业绩比较基准为目标，在严格控制下行风险的基础上进行有效的资产配置与投资标的精选，力争实现资产的稳定增值。
投资策略	本基金将实施积极主动的投资策略，运用多种方法进行资产配置。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个部分组成。 （一）大类资产配置策略 本基金大类资产配置的策略目标是一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。 （二）股票投资策略 本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式构建备选股票库。 （三）固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。 （四）权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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	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	证券时报、证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
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、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	2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	530,409,028.83	37,616,617.64
本期利润	767,452,288.03	84,579,417.33
加权平均基金份额本期利润	0.6404	0.1630
本期加权平均净值利润率	41.19%	15.59%
本期基金份额净值增长率	123.09%	15.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	853,217,870.93	42,679,125.24
期末可供分配基金份额利润	0.4103	0.0708
期末基金资产净值	3,555,795,531.41	695,402,344.25
期末基金份额净值	1.710	1.153
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	157.22%	15.30%

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。

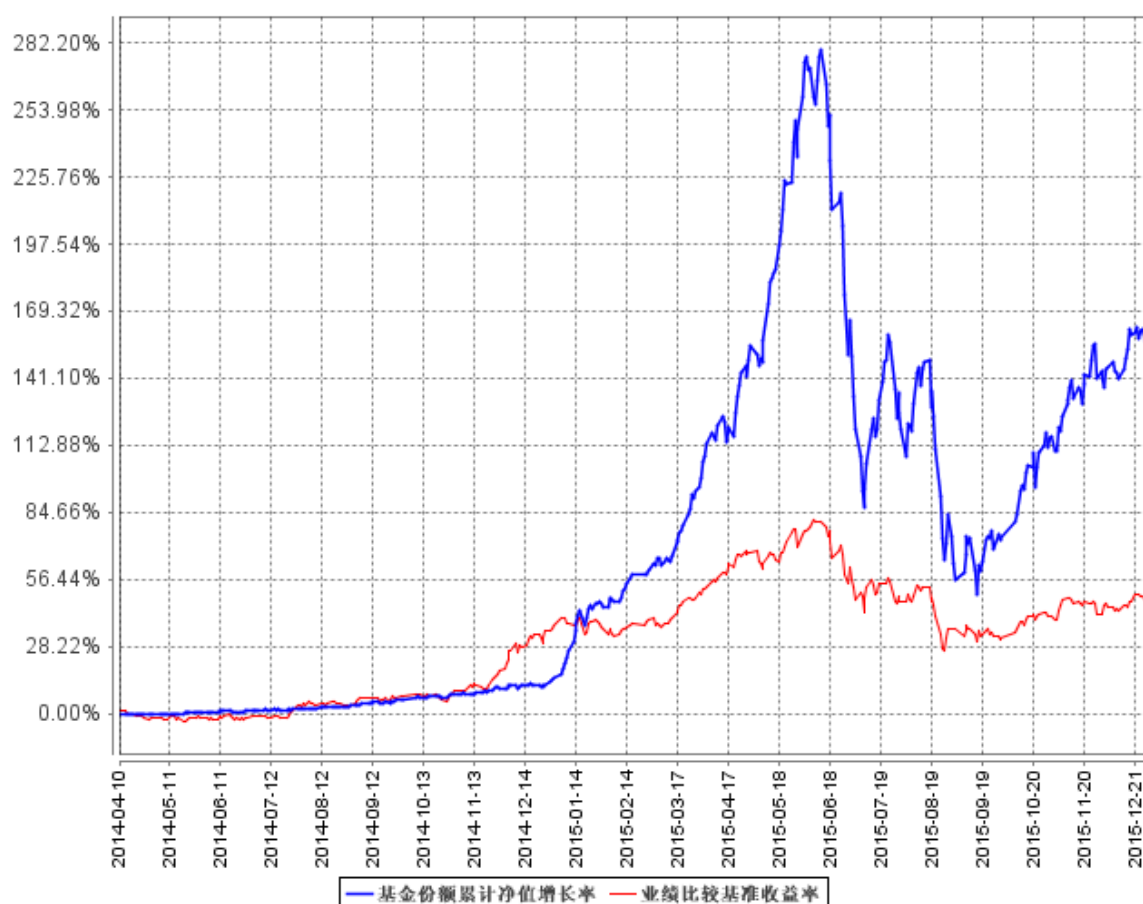
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	48.18%	2.34%	11.34%	1.08%	36.84%	1.26%
过去六个月	-3.23%	3.81%	-9.27%	1.74%	6.04%	2.07%
过去一年	123.09%	3.29%	6.94%	1.61%	116.15%	1.68%
自基金合同生效起至今	157.22%	2.50%	46.79%	1.33%	110.43%	1.17%

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

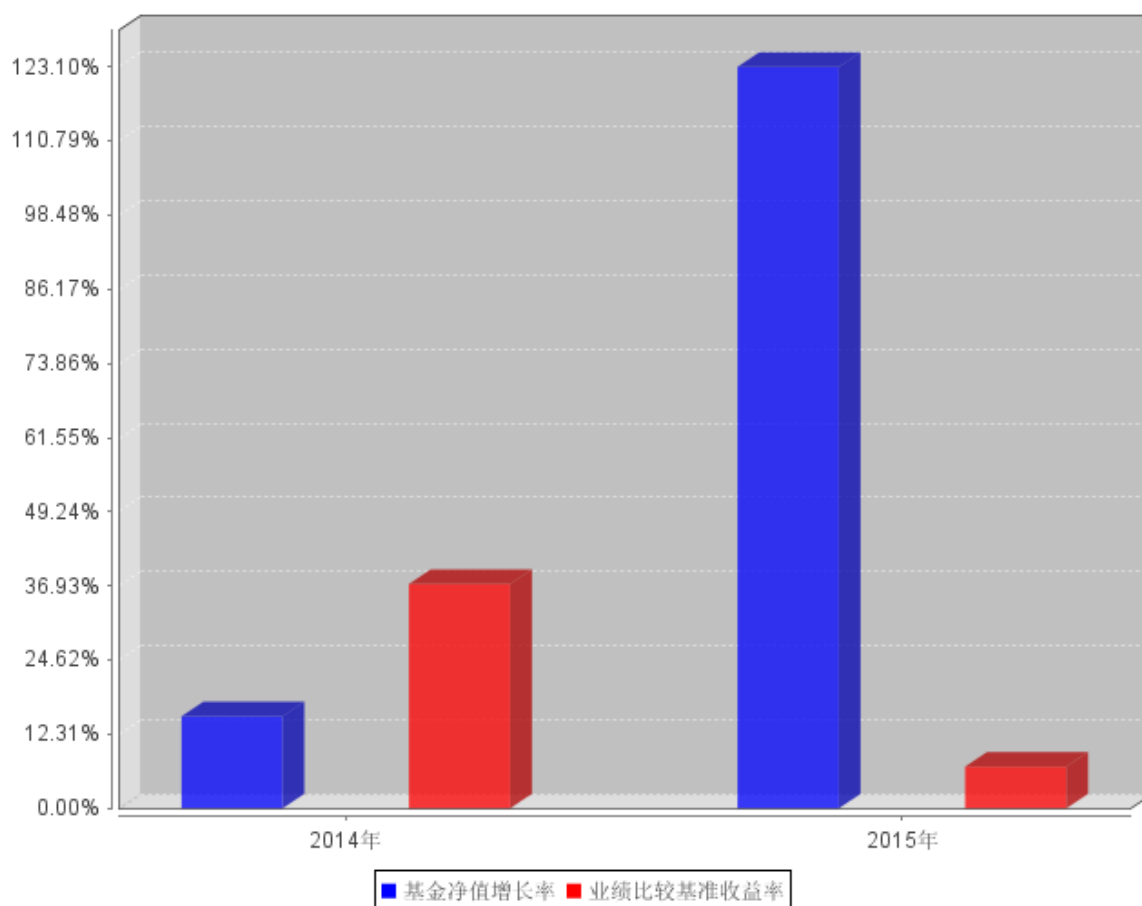
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

单位：人民币元

年 度	每 10 份 基 金 份 额 分 红 数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2015	6.8800	165,193,811.95	250,902,679.51	416,096,491.46	
2014	-	-	-	-	
合计	6.8800	165,193,811.95	250,902,679.51	416,096,491.46	

§ 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		
彭敢	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；总经理助理；投资部总监	2014 年 4 月 10 日	—	14 年	彭敢先生，金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010 年 9 月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2015 年 1 月 30 日	—	4 年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。历任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员，2014 年 11 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。

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 年股票市场走势波澜壮阔，上半年呈现创业板带动中小板、主板快速上涨行情，6 到 8 月份又快速回落，9 月后到年底又企稳反弹；全年，上证指数涨幅 9.41%、沪深 300 涨幅 5.58%、深成指涨幅 14.98%，同期，创业板指数涨幅 84.41%，中小板指数涨幅为 53.7%；整体来看中小板、创业板在 2015 年呈现牛市特征。本基金在 2015 年实现全年收益 123.09%，显著高于比较基准，为基金持有人获取了较为丰厚的收益。

本基金管理人认为，本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑，虽然政府反腐力度逐渐加大等，某种程度上短期对经济及职能效率有一定程度影响，但长期来看，出清腐败、加强监管、巩固执政理念，有利于更强有力的改革措施出台，减少改革阻力。目前来看，实体经济增速放缓趋势依然严峻，GDP 增速在持续下滑调整过程中，政府需要通过各种货币政策工具来降低实体经济利率，给企业减压输血，同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级；从整体来看，政府依然能有决心实现稳步的经济增长，同时也全面支持发展新兴产业，无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展，都能体现国家对经济结构转型升级的决心。

从改革开放三十多年的经济发展历程来看，不要去质疑政府对发展经济作为第一要务的决心，也不要轻易判断经济会断崖式下跌或者硬着陆等，我们需要积极的去适应当前经济转型的新常态，需要有耐心的寻找产业转型新的方向和政府职能转变后新的机遇，总之，我们处在激烈变革的新时代，必然伴随着社会行为及市场主体发生着相应的波动行为，我们相信当前的一切痛苦可以是一个深度的自然净化过程，我们需要的是一种坚持的信念。

回顾市场，2015 年 A 股各类主题依然纷繁复杂，上半年成长风格依然延续过去两年走势，且小市值股票遭到跟风热炒，同时大盘也走强跟涨，主板和创业板发生共振，上证都创出 5178.19 的 8 年新高位置，然而下半年开始，市场发生巨幅调整，高杠杆的去除过程也加速了市场的下跌，整体市场情绪在下半年的调整过程中由牛转熊，但全年来看依然是创业板和中小板的牛市年份。虽然全年市场表象上与基金管理人的理念基本吻合，中小创依然是领涨市场，但在实际操作中，基金管理人坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来来操作，在板块选择上坚持选择与过

往市场不同的新的投资方向和成长主题，虽然由此也丧失了一些投资机会，但从整体结果来看，获取的收益率较为理想。年末主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、体育、泛娱乐等方向。

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 123.09%，同期业绩比较基准收益率是 6.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年中国的宏观经济仍然处于持续触底的过程，尽管政府出台了多项改革和稳增长的财政和货币政策，但经济增长的固有规律在发挥作用，过剩产能以及前期大量的房地产和固定资产投资仍然成为经济的主要风险。而油价的大幅下跌虽然短期有利于中国经济成本降低，但是否会带来输入性通缩，并与产能过剩带来的内在的经济通缩叠加，对企业经营已经构成了下行压力，目前来看国家在稳定经济增长方面信心十足，及时的提出供给侧改革让我们更坚定的看好本届政府对经济转型的决心。

从我们分析来看，A 股经历了三年的牛市上升通道，主要核心逻辑主要在如下几点：（1）中国的经济结构正在发生近 30 年来前所未有的变化，新技术、新商业模式的企业三年来加速呈现在市场中；（2）2013 年后中国的货币政策基本处于宽松的氛围中，流动性宽裕、政策面宽松；（3）政府对党政机关及国企反腐态势蔓延，民众对改革转型预期较强，市场也给与了较高的改革估值溢价；（4）传统的民营上市企业在经济转型中走在时代前列，在注册制没有放开的过去三年，通过兼并整合及借壳上市等资本运作方式给市场带来了不少新板块、新龙头和大量投资热点，市场参与热情高涨，新增资金入市积极。在我们看来，这三年 A 股市场演绎着这个时代的转型特征，中国需要新经济、政府需要新增长，虽然市场制度在进行循序渐进的改革尝试，但是新一代的企业家和主动迎合时代发展趋势的企业家正在成为市场新的主力龙头，互联网金融、数字营销、新媒体、机器人等都从市场追逐概念变成了较为成熟的板块，带来了巨大的财富效应和社会效应；我们坚信一个大时代的变迁不会是短短三年能完成变迁的，从国外发达经济体的转型之路来看也是一个较为长期充满波折的长期过程，在过去的 2015 年经历了波澜壮阔的涨跌行情，从另一种角度也可以体现为大变革时代的一种显著特征。

从市场来看，目前股票市场经历了三季度巨幅震荡下跌后，国家层面救市政策已经落实，股指期货等股票衍生工具对市场的影响已经降低到 2014 年以前的水平，降准降息同步落地，市场在四季度逐渐企稳。在利率下行趋势下，在降息降准已经兑现，资产价格决定于未来现金流，现金流充裕的情况和 A 股不发生系统性风险前提下，以成长股为代表的创业板、盈利模式逐渐清晰的新型蓝筹以及智能制造转型升级等都存在着新时代资本市场盛宴的机会。从制度红利来看，中国

政府对资本市场和国企治理的决心已毋庸置疑，沪港通、深港通、证券法修改及注册制等都是资本市场已发生或即将发生的重大影响意义的事件；同时国企治理对改革转型起到关键性作用，国有资产证券化是较好的实现途径。从长期看，中国通过改革转型提升经济增长的空间仍然很大，新的国家战略如一带一路的提出等让市场预期政府会通过向全球输出中国的高铁等优势产业来缓解产能过剩问题。同样的，“互联网+”为主要手段的各行业互联网化趋势逐渐确立，互联网金融、互联网医疗、互联网能源以及互联网农业等在转型升级的中国带来了很多投资机遇和新的产业形态。

我们认为中国资本市场不管是过去、现在还是未来的走势均是对中国经济前景和改革信心的反应。从目前宏观经济数据和改革管理措施来看，看不到改善的迹象，各种改革措施总体来说也是雷声大雨点小，资本市场的大环境难言乐观。但从另一方面来看，中国经济的韧性和中国企业家的创新精神和奋斗意识在全球横向比较中仍然有一定的优势，中国经济的前景也无需过于担心。

因此，现阶段的市场调整可以更多的理解为市场下跌趋势的惯性延续。投资者信心的恢复需要时间，而市场重新走出趋势性的上涨行情需要更多的宏观经济数据的变化和政府改革措施的落实实施，并给投资者带来信心。

目前来看，市场的悲观因素反应较为充分，而市场积极的因素在累积，如 G20 会议带来的全球宏观政策的协调、美联储加息政策的变化、两会前后十三五规划的讨论、国家以供给侧改革为核心的国有企业改革措施的落实等等。所以在目前阶段，虽然市场信心较弱，但在经历多次下跌后，市场目前所处的位置具有较好的风险收益比。即使从市场波动来看，考虑到目前市场与历史估值比较相对偏低的位置，个人判断今年仍然存在一轮趋势性上涨的机会。投资的热点可能集中在周期性股票的博弈机会、国企改革带来的国企控股优质公司的变革，成长股方面，体育传媒等新兴消费服务业、以云计算大数据为核心的科技产业、以 VR 等技术变革为中心的新技术产业会有持续的盈利机会。

从价值投资的角度来看，目前自下而上选股可投资的股票越来越多，有相当一部分股票进入合理乃至极有价值的投资区间。虽然我们认为市场未来仍有调整空间，但市场分化也将产生，我们相信，部分优质公司的选择仍能提供较好的获利机会。

从 2016 年全年来看，2016 年是中国资本市场新变革的起点，注册制、战略新兴板、深港通等都要一一落地，新的 2016 年是变革之年，也是经历了 2015 年 A 股市场大震荡后市场重建的一年。我们认为新的一年需要去耐心观察新机制推出后产生新的变化、也需要主动适应新的变化、更需要积极寻找新的机遇，可以判断的是经历了三年上期上涨趋势后，2016 年不大会出现 2015 年上半年高收益的基础，也不能排除 2015 年三季度暴跌动荡的可能性，但个人认为市场企稳后结

构性行情依然存在，我们需要在新的 2016 年降低投资收益的预期，但也需要充分寻找新的投资机会，为持有人获取较好的投资回报。

当然我们也需要看到目前市场的一些主要风险因素，正如我们前面已经提到的：1、投资者的对经济企稳和政治体系稳定的信心；2、货币政策与汇率稳定的关系；3、资本市场改革进度和措施低于预期及市场适应新制度的能力；4、“互联网+”创新显著低于预期；5、楼市及部分固定资产快速泡沫化后的消化能力。

基金管理人秉承几个最基本的投资理念：1、投资不可能赚到所有的钱，投资要赚自己所理解和能把握的钱。投资收益有两类钱，一类是市场博弈赚趋势交易的钱，我的收益即是他人的亏损。在这个充分竞争的市场机会本基金管理人不可能持久赚到博弈的钱；2、第二类投资收益是赚公司成长的钱。优质的成长股不管在何种市场风口，最后必然超越市场涨幅，在无法判别市场风向的市场，挑选最强健的猪。尤其是成长空间巨大的公司，要有充分的耐心，这是本基金管理人的目标收益；3、中国的经济已经进入必须转型的阶段，中国经济的核心不可能是靠地产和传统国企来支撑。变革和转型创新是中国经济更重要的部分。而目前传统产业在中国股票市场中的市值比率并不低，这类企业无论是从静态还是动态估值跟国际对比偏贵、从管理水平和制度结构来说跟跨国公司对比也差距巨大。

本基金将继续重点以个股投资价值判断为主，继续采取自下而上的投资策略。基金管理人将坚持价值投资的理念，结合新价值基金重点投资技术资源、渠道资源、品牌资源的特点，为投资者追求较高的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：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 6 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。

本基金管理人已于 2015 年 3 月 11 日发布公告，以 2015 年 3 月 6 日可供分配利润为基准，每 10 份基金份额派发红利 3.00 元。

本基金管理人已于 2015 年 4 月 30 日发布公告，以 2015 年 4 月 23 日可供分配利润为基准，每 10 份基金份额派发红利 3.88 元。

4.9 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 22202 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“宝盈新价值混合基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是宝盈新价值混合基金 的基金管理人宝盈基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

	(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述宝盈新价值混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了宝盈新价值混合基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈新价值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	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	284,167,357.38	83,838,790.53
结算备付金		14,612,298.10	10,113,639.62
存出保证金		2,535,985.31	54,881.31
交易性金融资产	7.4.7.2	3,317,176,999.83	212,700,579.22

其中：股票投资		3,289,174,199.83	183,831,249.22
基金投资		-	-
债券投资		28,002,800.00	28,869,330.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	397,596,279.67
应收利息	7.4.7.5	1,676,212.94	511,940.05
应收股利		-	-
应收申购款		33,087,758.15	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,653,256,611.71	704,816,110.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		58,333,654.38	8,209,551.01
应付赎回款		26,931,805.32	50,704.28
应付管理人报酬		4,188,677.22	780,941.06
应付托管费		698,112.87	130,156.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,088,270.01	182,399.83
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,560.50	60,013.12
负债合计		97,461,080.30	9,413,766.15
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,079,633,886.89	602,925,189.87
未分配利润	7.4.7.10	1,476,161,644.52	92,477,154.38
所有者权益合计		3,555,795,531.41	695,402,344.25
负债和所有者权益总计		3,653,256,611.71	704,816,110.40

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.710 元，基金份额总额 2,079,633,886.89 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		831,257,615.35	92,203,190.56
1. 利息收入		3,097,202.40	9,912,010.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,338,771.00	615,694.51
债券利息收入		1,758,431.40	529,979.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,766,337.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		555,648,893.20	34,904,740.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	553,390,717.68	34,632,174.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	160,309.40	-140,009.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,097,866.12	412,575.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	237,043,259.20	46,962,799.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	35,468,260.55	423,639.21
减：二、费用		63,805,327.32	7,623,773.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,354,815.97	5,899,307.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,559,136.01	983,217.93
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	31,434,612.47	438,939.75
5. 利息支出		150,872.42	106,368.97
其中：卖出回购金融资产支出		150,872.42	106,368.97
6. 其他费用	7.4.7.20	305,890.45	195,939.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		767,452,288.03	84,579,417.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		767,452,288.03	84,579,417.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	602,925,189.87	92,477,154.38	695,402,344.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	767,452,288.03	767,452,288.03
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）	1,476,708,697.02	1,032,328,693.57	2,509,037,390.59
其中：1. 基金申购款	5,783,042,576.89	2,980,602,735.82	8,763,645,312.71
2. 基金赎回款	-4,306,333,879.87	-1,948,274,042.25	-6,254,607,922.12
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）	-	-416,096,491.46	-416,096,491.46
五、期末所有者权益（基金净值）	2,079,633,886.89	1,476,161,644.52	3,555,795,531.41
项目	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 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）	433,920,136.81	-	433,920,136.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	84,579,417.33	84,579,417.33
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）	169,005,053.06	7,897,737.05	176,902,790.11
其中：1. 基金申购款	276,797,562.90	10,251,826.35	287,049,389.25
2. 基金赎回款	-107,792,509.84	-2,354,089.30	-110,146,599.14
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）	602,925,189.87	92,477,154.38	695,402,344.25

金净值)			
------	--	--	--

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

宝盈新价值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”)证监基金字[2014]213 号《关于同意宝盈新价值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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新价值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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 433,819,339.69 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道验字(2014)第 071 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 4 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 433,920,136.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 100,797.12 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《宝盈新价值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良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。基金的投资组合为:股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%,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%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×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(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈新价值灵活配置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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

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

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指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。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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，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；对于支付的价款中包含的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。

对于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；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，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，且本基金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；或者(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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在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确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利

润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》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、参数及结果由中证指数有限公司独立提供。

（3）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），按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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中证指数有限公司根据《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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对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,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	284,167,357.38	83,838,790.53
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	284,167,357.38	83,838,790.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,004,401,450.04	3,289,174,199.83	284,772,749.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	28,769,490.90	28,002,800.00	-766,690.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	28,769,490.90	28,002,800.00	-766,690.90
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,033,170,940.94	3,317,176,999.83	284,006,058.89
项目		上年度末 2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		136,808,179.53	183,831,249.22	47,023,069.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	28,929,600.00	28,869,330.00	-60,270.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	28,929,600.00	28,869,330.00	-60,270.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		165,737,779.53	212,700,579.22	46,962,799.69

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	52,623.20	19,792.97
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	7,233.05	5,006.21
应收债券利息	1,615,101.37	487,113.70
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,255.32	27.17
合计	1,676,212.94	511,940.05

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,088,270.01	182,399.83
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,088,270.01	182,399.83

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	26,684.22	13.12
预提信息披露费	100,000.00	-
预提审计费	90,000.00	60,000.00
应付转出费	3,876.28	-
合计	220,560.50	60,013.12

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	602,925,189.87	602,925,189.87
本期申购	5,783,042,576.89	5,783,042,576.89
本期赎回（以“-”号填列）	-4,306,333,879.87	-4,306,333,879.87
本期末	2,079,633,886.89	2,079,633,886.89

注：申购含红利转再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	42,679,125.24	49,798,029.14	92,477,154.38
本期利润	530,409,028.83	237,043,259.20	767,452,288.03
本期基金份额交易产生的变动数	696,226,208.32	336,102,485.25	1,032,328,693.57
其中：基金申购款	2,323,064,026.89	657,538,708.93	2,980,602,735.82
基金赎回款	-1,626,837,818.57	-321,436,223.68	-1,948,274,042.25
本期已分配利润	-416,096,491.46	-	-416,096,491.46
本期末	853,217,870.93	622,943,773.59	1,476,161,644.52

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,108,399.98	481,865.83
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	165,811.72	129,972.06
其他	64,559.30	3,856.62
合计	1,338,771.00	615,694.51

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金 合同生效日)至2014年12月 31日
卖出股票成交总额	9,706,883,488.37	124,061,849.37
减：卖出股票成本总额	9,153,492,770.69	89,429,674.90
买卖股票差价收入	553,390,717.68	34,632,174.47

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合 同生效日)至2014年12月31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	93,275,765.30	28,810,770.00
减：卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成本总额	91,716,615.35	27,840,009.40
减：应收利息总额	1,398,840.55	1,110,770.00
买卖债券差价收入	160,309.40	-140,009.40

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,097,866.12	412,575.68
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,097,866.12	412,575.68

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	237,043,259.20	46,962,799.69
——股票投资	237,749,680.10	47,023,069.69
——债券投资	-706,420.90	-60,270.00
——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	237,043,259.20	46,962,799.69

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	26,921,759.42	242,283.63
基金转换费收入	8,546,501.13	181,355.58
合计	35,468,260.55	423,639.21

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
----	--	---

交易所市场交易费用	31,434,612.47	438,939.75
银行间市场交易费用	-	-
合计	31,434,612.47	438,939.75

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生 效日)至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	60,000.00
信息披露费	180,000.00	125,000.00
其他	200.00	900.00
银行汇划费用	17,690.45	4,039.12
债券帐户维护费	18,000.00	6,000.00
合计	305,890.45	195,939.12

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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、注册登记机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,354,815.97	5,899,307.46
其中：支付销售机构的客户维护费	8,094,833.44	12,146.22

注：支付基金管理人宝盈基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,559,136.01	983,217.93

注：支付基金托管人招商银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2014 年 4 月 10 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	5,658,743.63	-

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	5,658,743.63	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2700%	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2. 基金管理人宝盈基金公司在本年度申购本基金的交易委托公司直销柜台办理，适用费率为 1,000 元。

7.4.10.4.2 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

注：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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 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	284,167,357.38	1,108,399.98	83,838,790.53

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2015 年 5 月 4 日	3.8800	69,916,991.95	207,418,286.44	277,335,278.39	
2	2015 年 3 月 13 日	3.0000	95,276,820.00	43,484,393.07	138,761,213.07	
合计	-	6.8800	165,193,811.95	250,902,679.51	416,096,491.46	

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.12.2 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
300326	凯利泰	2015 年 9 月 24 日	重大事项	27.92	2016 年 1 月 22 日	23.98	2,362,800	68,639,662.16	65,969,376.00	—
002053	云南盐化	2015 年 11 月 19 日	重大事项	25.84	2016 年 3 月 14 日	23.26	1,792,984	45,803,335.59	46,330,706.56	—
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	899,876	20,567,227.02	24,350,644.56	—

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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，因而与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。

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。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,因此除附注 7.4.12 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 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合约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,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015 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	284,167,357.38	-	-	-	284,167,357.38
结算备付金	14,612,298.10	-	-	-	14,612,298.10
存出保证金	2,535,985.31	-	-	-	2,535,985.31
交易性金融资产	28,002,800.00	-	-	3,289,174,199.83	3,317,176,999.83
应收利息	-	-	-	1,676,212.94	1,676,212.94
应收申购款	326,000.00	-	-	32,761,758.15	33,087,758.15
资产总计	329,644,440.79	-	-	3,323,612,170.92	3,653,256,611.71
负债					

应付证券清算款	-	-	-	58,333,654.38	58,333,654.38
应付赎回款	-	-	-	26,931,805.32	26,931,805.32
应付管理人报酬	-	-	-	4,188,677.22	4,188,677.22
应付托管费	-	-	-	698,112.87	698,112.87
应付交易费用	-	-	-	7,088,270.01	7,088,270.01
其他负债	-	-	-	220,560.50	220,560.50
负债总计	-	-	-	97,461,080.30	97,461,080.30
利率敏感度缺口	329,644,440.79	-	-	-3,226,151,090.62	3,555,795,531.41
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	83,838,790.53	-	-	-	83,838,790.53
结算备付金	10,113,639.62	-	-	-	10,113,639.62
存出保证金	54,881.31	-	-	-	54,881.31
交易性金融资产	28,869,330.00	-	-	183,831,249.22	212,700,579.22
应收证券清算款	-	-	-	397,596,279.67	397,596,279.67
应收利息	-	-	-	511,940.05	511,940.05
资产总计	122,876,641.46	-	-	581,939,468.94	704,816,110.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,209,551.01	8,209,551.01
应付赎回款	-	-	-	50,704.28	50,704.28
应付管理人报酬	-	-	-	780,941.06	780,941.06
应付托管费	-	-	-	130,156.85	130,156.85
应付交易费用	-	-	-	182,399.83	182,399.83
其他负债	-	-	-	60,013.12	60,013.12
负债总计	-	-	-	9,413,766.15	9,413,766.15
利率敏感度缺口	122,876,641.46	-	-	572,525,702.79	695,402,344.25

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.79% (2014 年 12 月 31 日：4.15%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，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%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	3,289,174,199.83	92.50	183,831,249.22	26.44
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	3,289,174,199.83	92.50	183,831,249.22	26.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	168, 203, 403. 00	-
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-168, 203, 403. 00	-

7.4.14 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3, 114, 059, 934. 74 元，属于第二层次的余额为 203, 117, 065. 09 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 212, 700, 579. 22 元，无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 27 日起改为采用中证指数有限公司根据《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（附注 7.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(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	3,289,174,199.83	90.03
	其中：股票	3,289,174,199.83	90.03
2	固定收益投资	28,002,800.00	0.77
	其中：债券	28,002,800.00	0.77
	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	298,779,655.48	8.18
7	其他各项资产	37,299,956.40	1.02
8	合计	3,653,256,611.71	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	191,288,259.68	5.38
B	采矿业	31,776,810.00	0.89
C	制造业	2,008,327,700.91	56.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	72,004,374.39	2.02
F	批发和零售业	—	—

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	555,331,648.37	15.62
J	金融业	42,542,912.00	1.20
K	房地产业	19,283,612.86	0.54
L	租赁和商务服务业	178,850,356.64	5.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,454,086.00	2.29
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	108,314,438.98	3.05
S	综合	-	-
	合计	3,289,174,199.83	92.50

8.3 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	300252	金信诺	4,839,429	195,512,931.60	5.50
2	002773	康弘药业	1,878,222	154,389,848.40	4.34
3	603456	九洲药业	1,832,656	130,320,168.16	3.67
4	002522	浙江众成	6,009,758	111,360,815.74	3.13
5	002373	千方科技	2,383,758	109,056,928.50	3.07
6	002368	太极股份	1,624,759	109,021,328.90	3.07
7	002215	诺普信	5,369,014	102,977,688.52	2.90
8	300170	汉得信息	5,131,672	101,863,689.20	2.86
9	300071	华谊嘉信	6,737,309	95,669,787.80	2.69
10	300367	东方网力	1,312,066	91,451,000.20	2.57
11	300047	天源迪科	2,841,121	82,676,621.10	2.33
12	002549	凯美特气	6,464,610	81,454,086.00	2.29
13	300467	迅游科技	890,000	80,794,200.00	2.27
14	300463	迈克生物	682,944	80,170,796.16	2.25
15	002445	中南重工	2,816,163	78,993,372.15	2.22
16	600975	新五丰	4,461,906	75,004,639.86	2.11

17	300094	国联水产	2,728,925	68,768,910.00	1.93
18	000681	视觉中国	1,780,234	67,666,694.34	1.90
19	300078	思创医惠	1,369,517	66,832,429.60	1.88
20	300326	凯利泰	2,362,800	65,969,376.00	1.86
21	300486	东杰智能	1,140,795	56,880,038.70	1.60
22	300030	阳普医疗	2,672,629	52,276,623.24	1.47
23	300299	富春通信	1,040,901	48,995,210.07	1.38
24	002053	云南盐化	1,792,984	46,330,706.56	1.30
25	002047	宝鹰股份	4,075,186	45,805,090.64	1.29
26	002518	科士达	1,266,600	44,710,980.00	1.26
27	300390	天华超净	985,630	43,742,259.40	1.23
28	600358	国旅联合	2,556,785	43,465,345.00	1.22
29	300005	探路者	1,857,076	42,527,040.40	1.20
30	600136	道博股份	651,824	40,647,744.64	1.14
31	002513	蓝丰生化	2,048,300	39,921,367.00	1.12
32	600057	象屿股份	3,045,646	39,715,223.84	1.12
33	002096	南岭民爆	1,509,879	39,271,952.79	1.10
34	002341	新纶科技	2,318,792	38,607,886.80	1.09
35	000971	高升控股	1,099,901	38,463,537.97	1.08
36	600855	航天长峰	954,800	37,886,464.00	1.07
37	603703	盛洋科技	470,951	36,300,903.08	1.02
38	002222	福晶科技	1,390,110	32,959,508.10	0.93
39	600711	盛屯矿业	4,143,000	31,776,810.00	0.89
40	002023	海特高新	1,688,400	30,965,256.00	0.87
41	002746	仙坛股份	791,019	29,742,314.40	0.84
42	600336	澳柯玛	3,551,600	29,194,152.00	0.82
43	300327	中颖电子	699,921	27,786,863.70	0.78
44	600332	白云山	902,918	27,331,327.86	0.77
45	002659	中泰桥梁	1,122,025	26,199,283.75	0.74
46	600999	招商证券	1,143,360	24,810,912.00	0.70
47	300162	雷曼股份	899,876	24,350,644.56	0.68
48	000070	特发信息	722,123	23,172,927.07	0.65
49	002519	银河电子	920,334	21,857,932.50	0.61
50	603308	应流股份	691,140	21,646,504.80	0.61
51	600884	杉杉股份	514,171	20,176,070.04	0.57
52	600201	生物股份	500,000	18,485,000.00	0.52
53	600095	哈高科	1,658,600	18,460,218.00	0.52
54	600109	国金证券	1,100,000	17,732,000.00	0.50
55	002157	正邦科技	880,000	17,688,000.00	0.50

56	000892	星美联合	800,000	16,536,000.00	0.47
57	002188	巴士在线	356,080	15,827,756.00	0.45
58	000547	航天发展	699,950	13,334,047.50	0.37
59	300322	硕贝德	600,000	11,700,000.00	0.33
60	000910	大亚科技	698,800	11,558,152.00	0.33
61	300346	南大光电	305,503	11,328,051.24	0.32
62	002271	东方雨虹	550,000	10,741,500.00	0.30
63	002234	民和股份	576,329	10,362,395.42	0.29
64	603678	火炬电子	99,940	8,573,852.60	0.24
65	600745	中茵股份	200,000	8,196,000.00	0.23
66	300189	神农基因	1,000,000	7,410,000.00	0.21
67	000403	ST 生化	237,400	6,965,316.00	0.20
68	300229	拓尔思	203,429	6,387,670.60	0.18
69	600376	首开股份	500,000	6,250,000.00	0.18
70	600708	光明地产	378,234	4,837,612.86	0.14
71	002413	雷科防务	56,700	3,444,525.00	0.10
72	002098	浔兴股份	205,342	3,174,587.32	0.09
73	300373	扬杰科技	118,584	2,543,626.80	0.07
74	600562	国睿科技	1,900	118,161.00	0.00
75	002508	老板电器	1,013	45,534.35	0.00

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	300059	东方财富	234,356,525.99	33.70
2	300170	汉得信息	199,316,568.41	28.66
3	603703	盛洋科技	187,505,056.29	26.96
4	002188	巴士股份	184,641,366.46	26.55
5	300005	探路者	177,997,347.95	25.60
6	300252	金信诺	176,340,635.90	25.36
7	300463	迈克生物	175,878,960.76	25.29
8	601318	中国平安	174,021,610.23	25.02
9	300348	长亮科技	173,889,526.89	25.01
10	600201	生物股份	168,221,504.82	24.19

11	002773	康弘药业	166,766,530.08	23.98
12	300006	莱美药业	154,283,029.18	22.19
13	002215	诺普信	150,880,616.69	21.70
14	600975	新五丰	143,541,013.30	20.64
15	002023	海特高新	140,051,431.24	20.14
16	002373	千方科技	138,483,929.30	19.91
17	000558	莱茵体育	138,429,670.98	19.91
18	300030	阳普医疗	135,346,170.07	19.46
19	603456	九洲药业	134,522,632.20	19.34
20	002445	中南重工	134,300,612.14	19.31
21	002096	南岭民爆	129,800,048.21	18.67
22	002522	浙江众成	120,993,380.80	17.40
23	300094	国联水产	118,297,316.46	17.01
24	603883	老百姓	116,229,699.11	16.71
25	300047	天源迪科	116,080,645.82	16.69
26	300071	华谊嘉信	112,501,544.90	16.18
27	300033	同花顺	111,091,729.15	15.98
28	603308	应流股份	109,832,638.05	15.79
29	000060	中金岭南	103,392,442.06	14.87
30	600055	华润万东	102,592,625.12	14.75
31	300367	东方网力	102,324,888.31	14.71
32	300451	创业软件	99,040,070.11	14.24
33	000758	中色股份	98,769,016.76	14.20
34	002549	凯美特气	97,452,629.29	14.01
35	300397	天和防务	96,833,506.43	13.92
36	000681	视觉中国	96,356,282.72	13.86
37	300078	思创医惠	95,247,122.68	13.70
38	002100	天康生物	94,951,083.31	13.65
39	300373	扬杰科技	93,743,036.91	13.48
40	600572	康恩贝	92,564,839.90	13.31
41	600109	国金证券	92,348,888.90	13.28
42	300229	拓尔思	91,489,550.94	13.16
43	002123	荣信股份	90,125,861.65	12.96
44	300467	迅游科技	87,801,527.54	12.63
45	600587	新华医疗	87,381,386.73	12.57
46	002098	浔兴股份	82,431,391.86	11.85

47	600061	国投安信	81,687,243.25	11.75
48	300390	天华超净	79,921,847.27	11.49
49	002157	正邦科技	79,431,623.09	11.42
50	002368	太极股份	78,761,290.02	11.33
51	300326	凯利泰	77,353,715.36	11.12
52	300299	富春通信	75,502,839.55	10.86
53	600038	中直股份	73,875,431.87	10.62
54	002192	融捷股份	73,742,850.88	10.60
55	601336	新华保险	73,025,268.28	10.50
56	300486	东杰智能	72,940,450.98	10.49
57	300318	博晖创新	72,901,589.78	10.48
58	002715	登云股份	70,828,096.98	10.19
59	300089	文化长城	70,704,161.54	10.17
60	300329	海伦钢琴	70,557,302.69	10.15
61	000815	*ST 美利	69,936,903.20	10.06
62	600057	象屿股份	68,853,867.13	9.90
63	002746	仙坛股份	68,033,942.29	9.78
64	600745	中茵股份	67,737,593.34	9.74
65	300364	中文在线	67,511,920.55	9.71
66	601058	赛轮金宇	64,035,695.83	9.21
67	002657	中科金财	63,277,375.74	9.10
68	600234	山水文化	62,197,798.12	8.94
69	001696	宗申动力	61,671,792.31	8.87
70	000590	*ST 古汉	60,463,617.15	8.69
71	000503	海虹控股	59,456,549.22	8.55
72	600358	国旅联合	59,253,245.64	8.52
73	300018	中元华电	57,066,336.46	8.21
74	002518	科士达	56,839,612.48	8.17
75	600869	智慧能源	56,700,732.47	8.15
76	002251	步步高	56,575,011.73	8.14
77	300159	新研股份	53,465,169.98	7.69
78	300355	蒙草抗旱	53,364,049.93	7.67
79	300016	北陆药业	53,200,838.19	7.65
80	002402	和而泰	52,676,087.02	7.57
81	601021	春秋航空	52,561,136.42	7.56
82	600884	杉杉股份	51,764,756.91	7.44

83	601166	兴业银行	51,393,216.84	7.39
84	600136	道博股份	51,168,826.42	7.36
85	300136	信维通信	51,016,083.00	7.34
86	601628	中国人寿	49,299,059.59	7.09
87	600711	盛屯矿业	49,115,167.70	7.06
88	002329	皇氏集团	48,122,454.50	6.92
89	002053	云南盐化	45,803,335.59	6.59
90	600118	中国卫星	45,125,364.19	6.49
91	000892	星美联合	44,962,254.00	6.47
92	002047	宝鹰股份	44,863,857.77	6.45
93	600336	澳柯玛	43,792,990.61	6.30
94	000547	航天发展	43,774,042.22	6.29
95	600999	招商证券	43,602,926.23	6.27
96	300187	永清环保	43,405,029.86	6.24
97	300168	万达信息	42,784,545.99	6.15
98	600195	中牧股份	42,468,498.99	6.11
99	002222	福晶科技	41,385,269.57	5.95
100	600271	航天信息	41,067,181.19	5.91
101	600728	佳都科技	40,606,013.64	5.84
102	600078	澄星股份	40,450,888.47	5.82
103	002175	东方网络	40,405,232.00	5.81
104	002341	新纶科技	39,632,084.68	5.70
105	000732	泰禾集团	39,594,406.82	5.69
106	600855	航天长峰	39,353,214.00	5.66
107	600138	中青旅	39,232,151.72	5.64
108	000791	甘肃电投	38,517,265.78	5.54
109	002513	蓝丰生化	37,906,395.73	5.45
110	002304	洋河股份	37,841,560.08	5.44
111	000333	美的集团	37,578,559.26	5.40
112	300445	康斯特	36,937,237.13	5.31
113	000977	浪潮信息	35,779,652.01	5.15
114	000070	特发信息	35,552,805.38	5.11
115	300358	楚天科技	35,334,817.29	5.08
116	002115	三维通信	35,262,304.81	5.07
117	002638	勤上光电	35,036,317.89	5.04
118	300162	雷曼股份	34,297,520.22	4.93

119	002577	雷柏科技	34,209,036.82	4.92
120	002113	天润控股	34,061,215.00	4.90
121	603128	华贸物流	33,886,119.83	4.87
122	000400	许继电气	33,536,055.57	4.82
123	600198	大唐电信	33,373,171.04	4.80
124	000971	高升控股	32,827,320.90	4.72
125	002736	国信证券	32,681,672.61	4.70
126	002508	老板电器	32,553,959.58	4.68
127	300327	中颖电子	32,367,521.20	4.65
128	002496	辉丰股份	31,734,041.91	4.56
129	300189	神农基因	31,306,989.80	4.50
130	600497	驰宏锌锗	31,302,871.02	4.50
131	600332	白云山	31,131,724.60	4.48
132	002727	一心堂	30,803,857.27	4.43
133	000796	凯撒旅游	30,476,648.43	4.38
134	600883	博闻科技	30,217,025.98	4.35
135	000048	康达尔	30,155,339.67	4.34
136	300104	乐视网	30,138,614.32	4.33
137	002726	龙大肉食	29,985,138.75	4.31
138	603609	禾丰牧业	29,667,242.80	4.27
139	603898	好莱客	29,087,357.97	4.18
140	600016	民生银行	29,016,155.00	4.17
141	002382	蓝帆医疗	27,907,548.64	4.01
142	603636	南威软件	27,455,179.20	3.95
143	600594	益佰制药	27,383,132.62	3.94
144	600787	中储股份	27,326,031.00	3.93
145	002659	中泰桥梁	27,024,056.00	3.89
146	600702	沱牌舍得	26,858,826.80	3.86
147	300256	星星科技	25,514,203.71	3.67
148	300180	华峰超纤	25,187,507.51	3.62
149	600498	烽火通信	24,980,988.25	3.59
150	000661	长春高新	23,957,861.00	3.45
151	002171	楚江新材	23,902,958.96	3.44
152	000702	正虹科技	23,544,812.72	3.39
153	000068	*ST 华赛	23,229,949.75	3.34
154	002751	易尚展示	23,120,369.94	3.32

155	300077	国民技术	22,845,414.30	3.29
156	002268	卫 士 通	22,786,107.44	3.28
157	002064	华峰氨纶	22,511,807.62	3.24
158	002519	银河电子	21,910,833.00	3.15
159	000919	金陵药业	21,538,736.47	3.10
160	000987	广州友谊	21,408,741.52	3.08
161	600066	宇通客车	21,240,952.40	3.05
162	002488	金固股份	21,205,246.50	3.05
163	000722	湖南发展	20,878,434.12	3.00
164	002576	通达动力	20,754,500.50	2.98
165	601566	九牧王	20,737,723.89	2.98
166	002675	东诚药业	20,631,962.57	2.97
167	601333	广深铁路	19,583,637.93	2.82
168	002234	民和股份	19,458,365.03	2.80
169	300291	华录百纳	19,199,013.36	2.76
170	600095	哈高科	19,158,981.73	2.76
171	600562	国睿科技	19,020,437.36	2.74
172	002055	得润电子	18,819,687.00	2.71
173	002104	恒宝股份	18,789,096.40	2.70
174	002606	大连电瓷	18,550,977.00	2.67
175	002554	惠博普	17,962,919.00	2.58
176	000921	海信科龙	17,766,749.48	2.55
177	002439	启明星辰	16,587,038.05	2.39
178	300400	劲拓股份	16,555,126.42	2.38
179	601233	桐昆股份	16,552,142.53	2.38
180	000638	万方发展	16,166,220.80	2.32
181	600287	江苏舜天	15,755,783.67	2.27
182	600028	中国石化	15,512,607.85	2.23
183	002271	东方雨虹	15,490,108.07	2.23
184	002265	西仪股份	15,401,657.58	2.21
185	600276	恒瑞医药	14,955,942.03	2.15
186	600096	云天化	14,940,041.00	2.15
187	600767	运盛医疗	14,796,812.12	2.13
188	000042	中洲控股	14,740,519.12	2.12
189	000538	云南白药	14,734,204.00	2.12
190	600331	宏达股份	14,650,208.00	2.11

191	002428	云南锗业	14,184,053.03	2.04
-----	--------	------	---------------	------

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	300059	东方财富	264,295,691.31	38.01
2	002188	巴士在线	197,597,050.99	28.41
3	601318	中国平安	186,889,241.04	26.87
4	600201	生物股份	157,649,534.42	22.67
5	300005	探路者	157,364,905.08	22.63
6	300348	长亮科技	149,349,979.63	21.48
7	300006	莱美药业	146,707,848.97	21.10
8	000558	莱茵体育	140,371,364.56	20.19
9	603703	盛洋科技	137,157,697.45	19.72
10	002023	海特高新	135,933,160.48	19.55
11	603883	老百姓	131,643,311.34	18.93
12	300033	同花顺	130,769,701.66	18.80
13	002736	国信证券	129,965,784.66	18.69
14	600572	康恩贝	126,646,120.22	18.21
15	002096	南岭民爆	113,700,531.07	16.35
16	000060	中金岭南	109,423,499.70	15.74
17	300318	博晖创新	105,170,242.25	15.12
18	300229	拓尔思	104,058,892.58	14.96
19	000815	*ST 美利	101,948,268.70	14.66
20	300094	国联水产	100,661,937.68	14.48
21	300373	扬杰科技	100,155,104.20	14.40
22	000758	中色股份	99,992,822.86	14.38
23	300463	迈克生物	99,892,303.80	14.36
24	002100	天康生物	90,017,424.15	12.94
25	300451	创业软件	89,211,678.00	12.83
26	600587	新华医疗	87,527,812.15	12.59
27	300364	中文在线	87,355,449.81	12.56
28	300252	金信诺	84,747,724.10	12.19
29	600038	中直股份	84,577,479.41	12.16
30	600869	智慧能源	82,982,454.75	11.93

31	603308	应流股份	82,132,626.25	11.81
32	600061	国投安信	81,928,564.94	11.78
33	600975	新五丰	81,710,655.90	11.75
34	300397	天和防务	80,974,652.17	11.64
35	600055	华润万东	80,324,920.03	11.55
36	300030	阳普医疗	80,083,390.33	11.52
37	002123	荣信股份	77,583,204.36	11.16
38	600745	中茵股份	77,332,754.93	11.12
39	000590	*ST 古汉	76,289,669.06	10.97
40	300159	新研股份	75,444,000.80	10.85
41	002157	正邦科技	74,930,897.11	10.78
42	300089	文化长城	74,552,804.06	10.72
43	002192	融捷股份	73,772,286.42	10.61
44	300170	汉得信息	72,002,589.26	10.35
45	601336	新华保险	71,822,506.78	10.33
46	002098	浔兴股份	70,986,576.53	10.21
47	001696	宗申动力	70,291,078.12	10.11
48	601058	赛轮金宇	69,257,801.82	9.96
49	300018	中元华电	68,244,073.74	9.81
50	002445	中南重工	63,888,262.10	9.19
51	002215	诺普信	63,353,714.10	9.11
52	603456	九洲药业	63,082,809.81	9.07
53	000503	海虹控股	59,869,854.88	8.61
54	300329	海伦钢琴	57,843,234.15	8.32
55	601166	兴业银行	56,780,271.87	8.17
56	002522	浙江众成	56,677,982.71	8.15
57	002715	登云股份	54,519,901.22	7.84
58	300136	信维通信	52,791,448.38	7.59
59	600234	山水文化	52,772,579.05	7.59
60	002329	皇氏集团	51,682,371.63	7.43
61	601021	春秋航空	51,389,633.03	7.39
62	002402	和而泰	51,150,290.22	7.36
63	002251	步步高	50,889,698.30	7.32
64	600109	国金证券	50,655,948.99	7.28
65	600016	民生银行	49,798,915.15	7.16
66	601628	中国人寿	49,441,598.12	7.11
67	002746	仙坛股份	49,385,315.39	7.10
68	600271	航天信息	48,473,219.59	6.97

69	300078	思创医惠	45,609,074.76	6.56
70	000791	甘肃电投	45,536,234.36	6.55
71	600728	佳都科技	43,240,140.00	6.22
72	002657	中科金财	43,026,314.38	6.19
73	300047	天源迪科	42,953,473.81	6.18
74	002577	雷柏科技	42,886,984.96	6.17
75	603128	华贸物流	42,503,046.23	6.11
76	002373	千方科技	40,605,697.06	5.84
77	002638	勤上光电	40,554,285.22	5.83
78	300390	天华超净	40,510,567.50	5.83
79	002131	利欧股份	40,447,062.20	5.82
80	600118	中国卫星	40,345,117.48	5.80
81	600195	中牧股份	40,218,948.57	5.78
82	300168	万达信息	40,194,635.26	5.78
83	300187	永清环保	39,933,310.88	5.74
84	600138	中青旅	39,261,009.10	5.65
85	002304	洋河股份	38,734,894.55	5.57
86	000892	星美联合	38,441,455.98	5.53
87	300355	蒙草抗旱	36,960,312.05	5.31
88	300016	北陆药业	36,929,875.31	5.31
89	002508	老板电器	36,061,361.82	5.19
90	603609	禾丰牧业	35,970,795.47	5.17
91	002726	龙大肉食	35,861,651.68	5.16
92	002115	三维通信	35,642,357.31	5.13
93	000333	美的集团	35,216,380.00	5.06
94	600497	驰宏锌锗	35,187,545.00	5.06
95	002113	天润控股	34,926,742.92	5.02
96	000681	视觉中国	34,526,236.74	4.96
97	002496	辉丰股份	34,234,707.84	4.92
98	002773	康弘药业	34,176,312.11	4.91
99	600884	杉杉股份	34,080,789.80	4.90
100	000547	航天发展	32,348,380.60	4.65
101	000048	康达尔	32,331,265.08	4.65
102	603898	好莱客	31,926,204.51	4.59
103	000400	许继电气	31,879,411.78	4.58
104	600057	象屿股份	31,614,721.70	4.55
105	000732	泰禾集团	31,507,775.34	4.53
106	600883	博闻科技	31,391,301.29	4.51

107	300358	楚天科技	31,371,718.60	4.51
108	300104	乐视网	30,892,668.09	4.44
109	300445	康斯特	30,291,970.32	4.36
110	002727	一心堂	29,756,944.42	4.28
111	000977	浪潮信息	29,728,229.40	4.27
112	300256	星星科技	29,246,180.50	4.21
113	000796	凯撒旅游	29,035,858.99	4.18
114	600198	大唐电信	28,597,232.83	4.11
115	002175	东方网络	28,241,036.14	4.06
116	300180	华峰超纤	28,070,611.75	4.04
117	002549	凯美特气	27,840,328.42	4.00
118	300467	迅游科技	27,791,315.16	4.00
119	002751	易尚展示	27,262,177.60	3.92
120	600702	沱牌舍得	27,261,381.03	3.92
121	002382	蓝帆医疗	27,214,094.89	3.91
122	002576	通达动力	26,866,453.99	3.86
123	300077	国民技术	26,599,158.53	3.83
124	000068	*ST 华赛	26,448,875.73	3.80
125	600594	益佰制药	25,899,496.60	3.72
126	600498	烽火通信	25,638,629.46	3.69
127	600078	澄星股份	25,490,018.80	3.67
128	600787	中储股份	25,408,558.98	3.65
129	002488	金固股份	25,394,247.36	3.65
130	300071	华谊嘉信	25,038,949.35	3.60
131	002064	华峰氨纶	24,602,109.40	3.54
132	300299	富春通信	24,083,678.00	3.46
133	300291	华录百纳	23,846,326.76	3.43
134	000702	正虹科技	23,827,572.12	3.43
135	300189	神农基因	23,791,582.40	3.42
136	300400	劲拓股份	23,048,189.21	3.31
137	600767	运盛医疗	22,801,956.78	3.28
138	600136	道博股份	22,686,925.00	3.26
139	000661	长春高新	22,576,274.83	3.25
140	601333	广深铁路	21,900,008.00	3.15
141	600066	宇通客车	21,867,891.31	3.14
142	600562	国睿科技	20,954,494.73	3.01
143	000919	金陵药业	20,542,317.12	2.95
144	002554	惠博普	19,876,626.90	2.86

145	000070	特发信息	19,852,368.84	2.85
146	002518	科士达	19,660,268.02	2.83
147	300367	东方网力	19,309,755.90	2.78
148	601566	九牧王	19,095,819.01	2.75
149	600287	江苏舜天	19,036,569.76	2.74
150	000987	广州友谊	19,009,598.19	2.73
151	603636	南威软件	18,291,710.00	2.63
152	601218	吉鑫科技	18,186,541.40	2.62
153	601233	桐昆股份	18,157,341.33	2.61
154	300162	雷曼股份	18,153,629.61	2.61
155	600999	招商证券	18,113,202.15	2.60
156	600331	宏达股份	17,893,138.00	2.57
157	000921	海信科龙	17,831,723.48	2.56
158	002606	大连电瓷	17,797,164.10	2.56
159	002055	得润电子	17,243,048.69	2.48
160	000638	万方发展	17,074,093.01	2.46
161	300075	数字政通	16,913,794.56	2.43
162	600711	盛屯矿业	16,843,858.00	2.42
163	002428	云南锗业	16,654,711.83	2.39
164	002171	楚江新材	15,669,460.49	2.25
165	600421	仰帆控股	15,657,158.41	2.25
166	000538	云南白药	15,589,748.42	2.24
167	002368	太极股份	15,517,308.00	2.23
168	002265	西仪股份	15,517,175.95	2.23
169	600358	国旅联合	15,397,522.32	2.21
170	000042	中洲控股	15,313,092.00	2.20
171	002104	恒宝股份	15,293,582.00	2.20
172	600096	云天化	15,227,058.00	2.19
173	600028	中国石化	15,113,530.56	2.17
174	002675	东诚药业	14,873,037.50	2.14
175	600276	恒瑞医药	14,800,678.06	2.13
176	002223	鱼跃医疗	14,635,769.78	2.10
177	002268	卫 士 通	14,433,108.00	2.08
178	002222	福晶科技	14,338,929.15	2.06
179	000036	华联控股	14,222,619.82	2.05

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	12,021,086,041.20
卖出股票收入（成交）总额	9,706,883,488.37

注：买入股票成本（成交）总额与卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,002,800.00	0.79
	其中：政策性金融债	28,002,800.00	0.79
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	28,002,800.00	0.79

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	018001	国开 1301	280,000	28,002,800.00	0.79

8.7 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。

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。

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发行主体中没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除九洲药业（代码：603456）外未受到公开谴责、处罚。

2015 年 1 月 17 日，浙江九洲药业股份有限公司（以下简称“公司”）位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故，造成 1 名工人受伤，经抢救无效死亡。事故发生后，公司立即启动突发事件应急处置预案，并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内，未对公司生产经营造成重大影响，也未对公司的经营业绩产生较大影响。

2015 年 4 月 22 日，公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书，认定该事故为一般生产安全责任事故，给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司预计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。

我们关注到此事是公司管理细节上的问题，确实需要改进，但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值，因此在事故发生后及处罚决定下达后未做减持。

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	2,535,985.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,676,212.94
5	应收申购款	33,087,758.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,299,956.40

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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
68,846	30,207.04	426,017,669.43	20.49%	1,653,616,217.46	79.51%

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	3,033,410.08	0.1459%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 4 月 10 日）基金份额总额	433,920,136.81
本报告期期初基金份额总额	602,925,189.87
本报告期基金总申购份额	5,783,042,576.89
减:本报告期基金总赎回份额	4,306,333,879.87
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	2,079,633,886.89

§ 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

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 90,000 元，目前事务所已连续 2 年为本基金提供审计服务。

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	
光大证券		25,038,825,967.65	23.19%	4,494,760.36	22.97%	-
申万宏源		23,768,808,563.53	17.35%	3,434,518.92	17.55%	-
安信证券		23,513,576,541.16	16.17%	3,171,586.60	16.21%	-
中信证券		12,726,260,917.57	12.55%	2,444,081.49	12.49%	-
方正证券		21,994,937,362.97	9.18%	1,817,988.53	9.29%	-
招商证券		21,848,440,866.97	8.51%	1,671,976.67	8.55%	-
兴业证券		11,563,745,676.06	7.20%	1,401,327.42	7.16%	-
华创证券		11,202,960,580.27	5.54%	1,064,500.68	5.44%	-
中银国际	1	69,857,461.29	0.32%	63,660.85	0.33%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期内租用方正证券上海、深圳交易单元各 1 个、海通证券上海、深圳交易单元各 1 个、安信证券上海、深圳交易单元各 1 个、招商证券上海、深圳交易单元各 1 个、中金公司上海、深圳交易单元各 1 个、申万宏源证券上海、深圳交易单元各 1 个、国信证券上海、深圳交易单元各 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。

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
光大证券	-	-	293,400,000.00	21.52%	-	-
申万宏源	-	-	48,800,000.00	3.58%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	150,883,501.06	100.00%	1,021,400,000.00	74.90%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金恢复申购等业务并限制大额申购、转换转入、定期定额投资金额的公告	证券时报 证券日报	2015 年 1 月 17 日
4	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 1 月 21 日
5	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
6	宝盈基金管理有限公司关于增加杭州数米基金销售有限公司为宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报 证券日报	2015 年 1 月 30 日
7	宝盈基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报 证券日报	2015 年 2 月 9 日
8	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
9	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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日

	优惠活动的公告		
10	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
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 3 日
12	宝盈基金管理有限公司关于增加国信证券股份有限公司为宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报 证券日报	2015 年 3 月 6 日
13	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
14	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
15	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金第一次分红公告	证券时报 证券日报	2015 年 3 月 11 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 17 日
17	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
18	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

19	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参加相关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
20	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
21	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
22	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
23	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
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 3 月 24 日
25	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报 证券日报	2015 年 3 月 25 日
26	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金调整限制申购、转换转入及定期定额投资业务金额的公告	证券时报 证券日报	2015 年 3 月 25 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 3 月 25 日

28	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
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	2015 年 4 月 2 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 3 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 4 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	2015 年 4 月 8 日
33	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
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 14 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 4 月 16 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 4 月 18 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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 22 日

	进行估值的提示性公告		
38	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
39	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
40	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
41	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金第二次分红公告	证券时报 证券日报	2015 年 4 月 30 日
42	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
43	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
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 13 日
45	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参与相关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 5 月 15 日
46	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
47	宝盈基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报 证券时报	2015 年 5 月 20 日

	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	上海证券报 证券日报	
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 21 日
49	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
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 5 月 22 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 5 月 26 日
52	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
53	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
54	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
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 12 日
56	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
57	宝盈基金管理有限公司关于从业人	中国证券报 证券时报	2015 年 6 月 17 日

	员在子公司兼职情况的公告	上海证券报	
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 19 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 20 日
60	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
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 26 日
62	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
63	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
64	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
65	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
66	宝盈基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 7 月 1 日

67	宝盈基金管理有限公司关于增加中国建设银行股份有限公司为宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报 证券日报	2015 年 7 月 1 日
68	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 7 月 2 日
69	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 7 月 3 日
70	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业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	2015 年 7 月 3 日
71	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 7 月 4 日
72	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 7 月 7 日
73	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 7 月 8 日
74	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 7 月 9 日
75	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 7 月 10 日
76	宝盈基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报 证券时报	2015 年 7 月 11 日

	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	上海证券报	
77	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券时报 证券日报	2015 年 7 月 14 日
78	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 7 月 14 日
79	宝盈基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报 证券日报	2015 年 7 月 15 日
80	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 7 月 18 日
81	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 7 月 22 日
82	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告	证券时报 证券日报	2015 年 7 月 24 日
83	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 7 月 28 日
84	宝盈基金管理有限公司关于增加中国农业银行股份有限公司为旗下部分基金的代销机构并参与相关费率优惠的公告	中国证券报 证券时报 证券日报	2015 年 8 月 3 日
85	宝盈基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报 证券时报	2015 年 8 月 4 日

	金参加长城证券股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报 证券日报	
86	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 8 月 4 日
87	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 8 月 4 日
88	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 8 月 12 日
89	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加平安证券有限责任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 8 月 12 日
90	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 8 月 15 日
91	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 8 月 18 日
92	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 8 月 19 日
93	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际金融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 8 月 19 日
94	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 8 月 25 日

95	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 8 月 26 日
96	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 8 月 27 日
97	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报 证券日报	2015 年 8 月 28 日
98	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 8 月 28 日
99	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 9 月 2 日
100	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 9 月 7 日
101	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 9 月 9 日
102	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 9 月 10 日
103	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加上海好买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 9 月 14 日
104	宝盈基金管理有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下基	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 9 月 30 日

	金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告		
105	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 10 月 13 日
106	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 10 月 21 日
107	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 10 月 22 日
108	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 10 月 24 日
109	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 10 月 28 日
110	宝盈基金管理有限公司关于调整周净值短信服务形式的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 11 月 3 日
111	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 11 月 7 日
112	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 11 月 12 日
113	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 11 月 13 日
114	宝盈基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报 证券时报	2015 年 11 月 21 日

	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	上海证券报 证券日报	
115	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 11 月 28 日
116	关于增加中国银行股份有限公司为宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报 证券日报	2015 年 12 月 15 日
117	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 12 月 18 日
118	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金在指数熔断机制下调整开放时间的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 12 月 31 日
119	关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司开放式公募基金组合、定投产品费率优惠的活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

13.2 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

13.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日