

宝盈新价值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：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

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。

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。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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来构建备选股票库。 （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 $\times 65\%$ + 中债综合指数收益率 $\times 35\%$ 。
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	zhang.j@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201

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	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

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

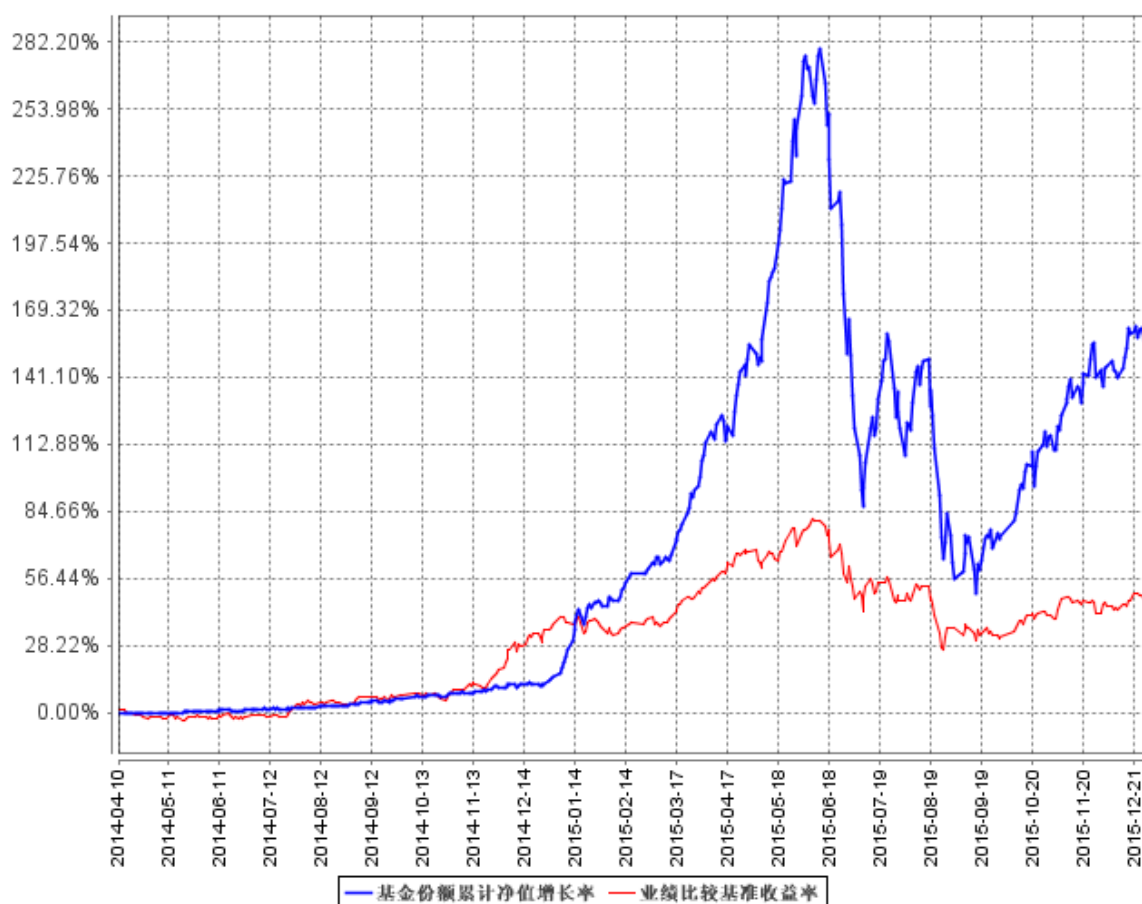
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

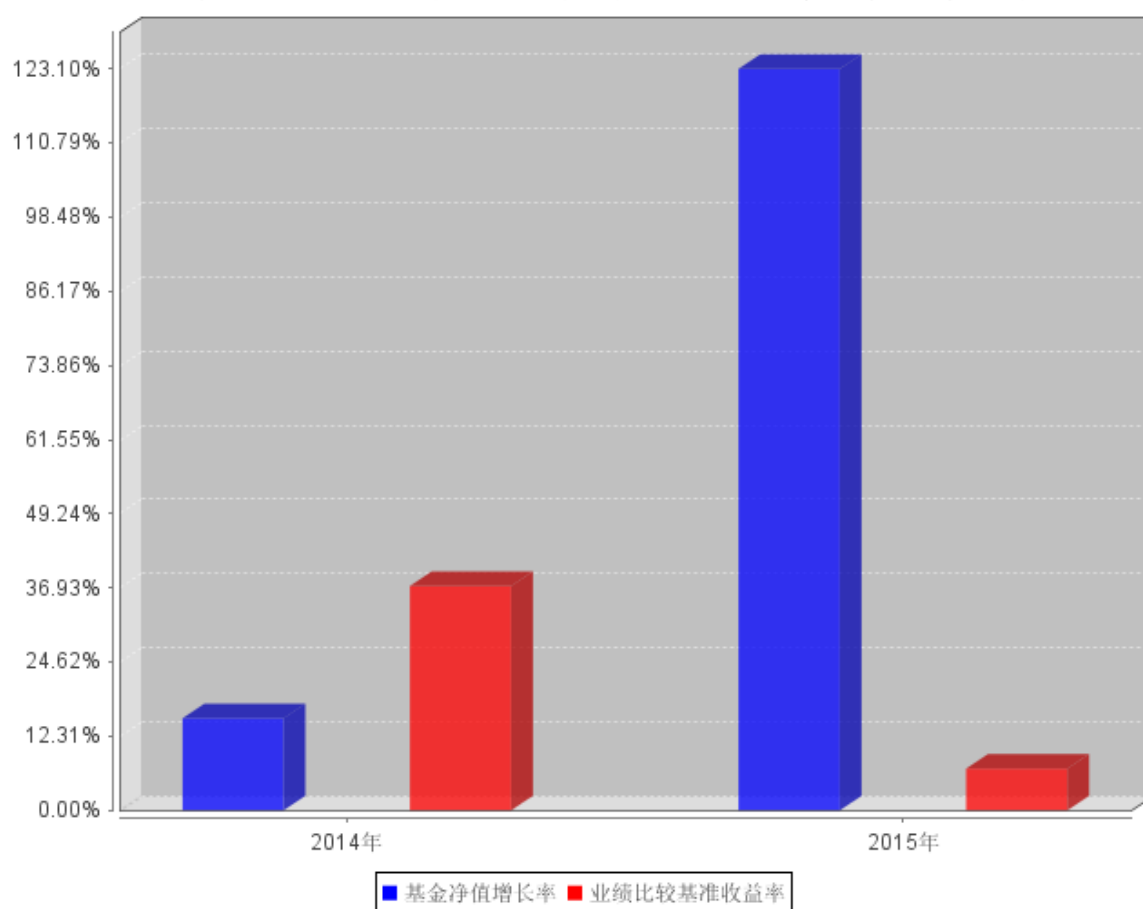
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	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

	置混合型证券投资基金的基金经理助理				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，也不要去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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份

额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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

本基金 2015 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2016)第 22202 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈新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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	397,596,279.67
应收利息	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	-	-
资产总计	3,653,256,611.71	704,816,110.40
负债和所有者权益	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	-	-
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	7,088,270.01	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	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	2,079,633,886.89	602,925,189.87
未分配利润	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	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	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	553,390,717.68	34,632,174.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	160,309.40	-140,009.40
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	2,097,866.12	412,575.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	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	27,354,815.97	5,899,307.46
2. 托管费	4,559,136.01	983,217.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	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

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 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。

7.4.7.2.2 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。

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.7.5 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	481,865.83

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。

7.4.7.6 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。

7.4.7.7 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。

7.4.8 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.8.2 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。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.9 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，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	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

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。

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	2	1,848,440,866.97	8.51%	1,671,976.67	8.55%	-
兴业证券	1	1,563,745,676.06	7.20%	1,401,327.42	7.16%	-
华创证券	1	1,202,960,580.27	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				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	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日