

# 宝盈祥泰养老混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	42
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>46</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈祥泰养老混合型证券投资基金
基金简称	宝盈祥泰养老混合
基金主代码	001358
交易代码	001358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,819,766,223.44份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制下行风险的前提下，追求稳定的投资回报，为投资人提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，在控制下行风险的前提下，确定大类资产配置比例，通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益，适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+1%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中等收益/风险特征的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区福华	北京市西城区闹市口大街 1 号

	一路 115 号投行大厦 10 层	院 1 号楼
邮政编码	518034	100033
法定代表人	李文众	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,629,125.93
本期利润	3,594,911.36
加权平均基金份额本期利润	0.0016
本期加权平均净值利润率	0.15%
本期基金份额净值增长率	0.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	64,678,793.52
期末可供分配基金份额利润	0.0355
期末基金资产净值	1,894,003,813.17
期末基金份额净值	1.041
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.10%

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

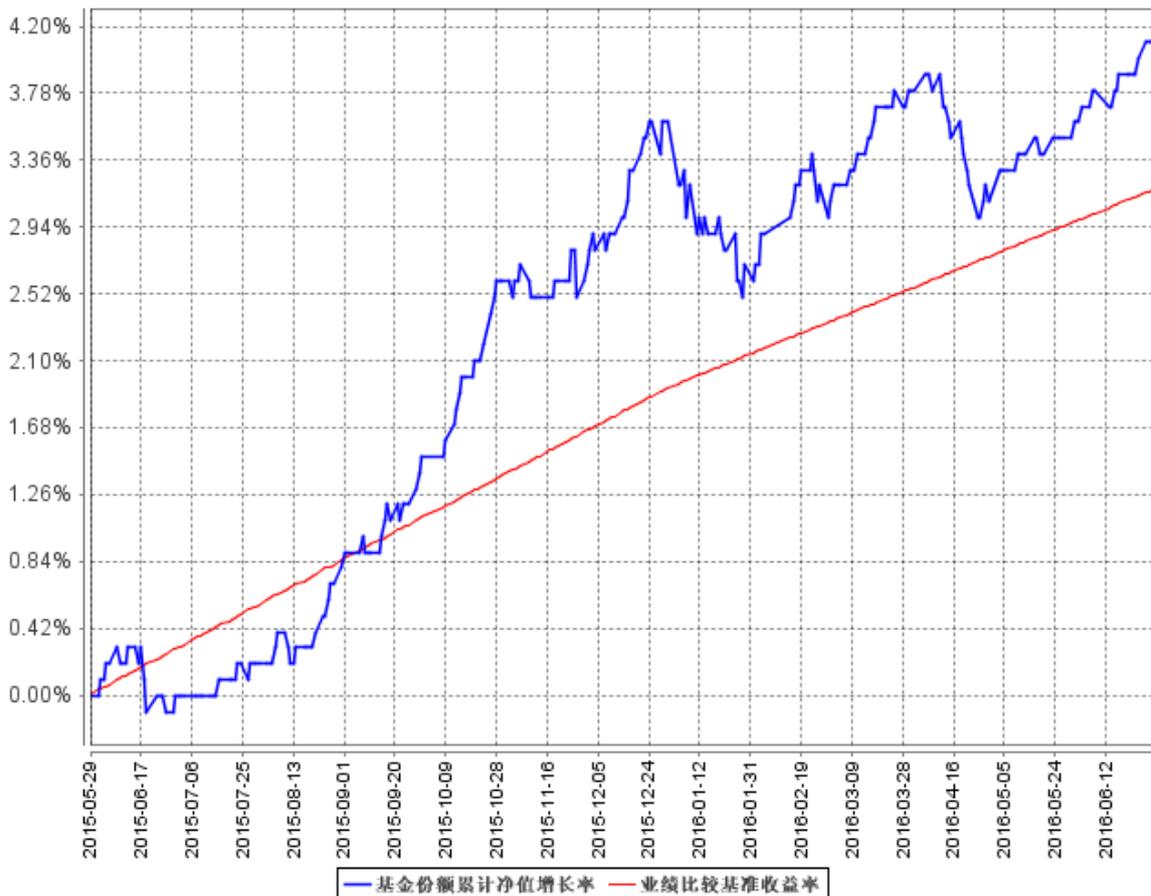
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.48%	0.05%	0.20%	0.01%	0.28%	0.04%
过去三个月	0.29%	0.08%	0.61%	0.01%	-0.32%	0.07%
过去六个月	0.48%	0.10%	1.22%	0.01%	-0.74%	0.09%
过去一年	4.10%	0.09%	2.88%	0.01%	1.22%	0.08%
自基金合同生效起至今	4.10%	0.09%	3.18%	0.01%	0.92%	0.08%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、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、宝盈互联网沪港深混合二十二只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2015 年 5 月 29 日	-	13 年	陈若劲女士，香港中文大学金融 MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作，2008 年 4 月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，尽管经过前期一系列货币和财政刺激措施，宏观经济整体依然低迷，经济数据乏善可陈。持续宽松的货币政策，推动大宗商品和住房价格大幅反弹，叠加天气因素，报告期内 CPI 小幅走高，PPI 跌幅收窄。报告期内，央行适度收缩了货币政策的宽松力度，仅下调一次存款准备金率，并主要通过公开市场操作投放资金，并未采取包括降息在内的更大力度的宽松政策。

报告期内，尽管央行收缩了货币政策的宽松力度，并推行商业银行 MPA 考核，但由于央行加大包括逆回购、MLF 等在内的公开市场操作力度，除个别时点外，市场资金面整体仍维持较为宽松的局面。债券市场方面，春节前债券市场收益率以窄幅震荡为主，春节后随着资金回流，债券市场收益率大幅下行，进入 3 月中旬，随着信用债风险爆发，各债券品种尤其是信用债收益率大幅走高，但在报告期末，随着信用风险事件得到逐步控制以及年中市场资金面状况好于预期，债券市场收益率又小幅回落。报告期内，由于市场资金利率迟迟无法明显下行，同时对信用风险频发或引致流动性风险的担忧，我们整体维持了较低久期的投资组合，债券投资主要以高评级信用

债为主，同时积极参与利率债的波段操作。

报告期内，权益市场走势跌宕起伏，上证指数年初深度调整，随后逐渐企稳回升，出现了局部的结构性机会。我们对权益市场整体持谨慎态度，报告期内维持了较低的二级股票仓位。同时，我们积极参与新股申购，从中选择优质标的进行稳健投资。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.041 元。本基金在本报告期内净值增长率是 0.48%，同期业绩比较基准收益率是 1.22%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望 2016 年下半年，在缺乏有效增长动力情况下，宏观经济仍将低位运行，难以出现明显改观。而在经济增长乏力背景下，通胀压力也将有限。为推动经济增长，下半年货币政策整体仍将维持宽松基调，但受制于外汇以及住房价格大幅上涨压力，预计宽松力度有限。

货币市场方面，下半年，央行或仍将主要靠公开市场操作维持市场资金面相对宽松。债券市场方面，资金利率下限是否打开决定市场收益率下行空间，否则市场收益率预计将以低位窄幅震荡为主。下半年，我们将密切跟踪央行政策导向、内外部经济数据变化情况，在保持组合较低信用风险和良好流动性基础上，择优参与债券市场的波段投资机会。

权益市场方面，多空因素交织，大盘呈现区间震荡态势。我们预计下半年指数波动性会弱于上半年，我们将在控制风险的前提下，耐心等待市场机会的出现，谨慎选择具有较高安全边际的品种参与投资。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型

及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## **§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）**

### **6.1 资产负债表**

会计主体：宝盈祥泰养老混合型证券投资基金

报告截止日： 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,031,810.37	2,205,465.49
结算备付金		1,387,702.51	3,799,898.57
存出保证金		92,970.96	341,579.22
交易性金融资产	6.4.7.2	1,752,865,603.85	2,831,916,321.47
其中：股票投资		33,610,224.85	159,937,321.47
基金投资		-	-
债券投资		1,719,255,379.00	2,671,979,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	158,400,437.60	165,000,687.50
应收证券清算款		-	4,978,598.77
应收利息	6.4.7.5	32,638,853.32	32,989,181.77
应收股利		-	-
应收申购款		122,008.20	127,714.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,000.00	-
资产总计		1,957,540,386.81	3,041,359,447.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		60,000,000.00	35,000,000.00
应付证券清算款		672,339.61	-
应付赎回款		164,996.18	1,242,279.24
应付管理人报酬		1,880,441.38	3,294,577.86
应付托管费		391,758.63	686,370.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	111,681.33	690,175.10
应交税费		-	-
应付利息		26,245.14	2,834.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	289,111.37	181,832.87
负债合计		63,536,573.64	41,098,070.38
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.7.9	1, 819, 766, 223. 44	2, 896, 023, 603. 96
未分配利润	6.4.7.10	74, 237, 589. 73	104, 237, 773. 40
所有者权益合计		1, 894, 003, 813. 17	3, 000, 261, 377. 36
负债和所有者权益总计		1, 957, 540, 386. 81	3, 041, 359, 447. 74

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.041 元，基金份额总额 1, 819, 766, 223. 44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈祥泰养老混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		23, 204, 751. 24	3, 120, 661. 24
1.利息收入		49, 830, 822. 87	5, 791, 183. 66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	114, 682. 85	2, 499, 078. 87
债券利息收入		47, 174, 251. 94	704, 232. 04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2, 541, 888. 08	2, 587, 872. 75
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16, 301, 336. 63	-7, 079, 963. 81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-17, 015, 023. 17	-8, 679, 163. 81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	655, 581. 86	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	58, 104. 68	1, 599, 200. 00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13, 034, 214. 57	4, 358, 586. 85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2, 709, 479. 57	50, 854. 54
<b>减：二、费用</b>		19, 609, 839. 88	6, 214, 312. 12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13, 879, 798. 76	4, 554, 983. 74
2. 托管费	6.4.10.2.2	2, 891, 624. 69	948, 954. 94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	522, 624. 62	657, 517. 98
5. 利息支出		2, 061, 504. 81	11, 037. 15
其中：卖出回购金融资产支出		2, 061, 504. 81	11, 037. 15
6. 其他费用	6.4.7.20	254, 287. 00	41, 818. 31

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,594,911.36	-3,093,650.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,594,911.36	-3,093,650.88

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥泰养老混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,896,023,603.96	104,237,773.40	3,000,261,377.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,594,911.36	3,594,911.36
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）	-1,076,257,380.52	-33,595,095.03	-1,109,852,475.55
其中：1.基金申购款	16,727,433.07	535,210.82	17,262,643.89
2.基金赎回款	-1,092,984,813.59	-34,130,305.85	-1,127,115,119.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,819,766,223.44	74,237,589.73	1,894,003,813.17
项目	上年度可比期间 2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,989,623,187.02	-	3,989,623,187.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,093,650.88	-3,093,650.88



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、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0% - 40%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%;本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人将在履行适当程序后,可以做出相应调整。

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%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. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	12,031,810.37
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	12,031,810.37

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	24,363,723.15	33,610,224.85	9,246,501.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	86,445,880.00	1,245,499.00
	银行间市场	1,628,005,679.30	3,558,320.70
	合计	1,714,451,559.30	4,803,819.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,738,815,282.45	1,752,865,603.85	14,050,321.40

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末衍生金融资产/负债均无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	158,400,437.60	-
合计	158,400,437.60	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,916.04
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	624.50
应收债券利息	32,579,173.87
应收买入返售证券利息	57,089.88

应收申购款利息	7.23
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	41.80
合计	32,638,853.32

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	1,000.00
待摊费用	-
合计	1,000.00

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	56,540.76
银行间市场应付交易费用	55,140.57
合计	111,681.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付赎回费	149.87
预提费用	288,961.50
合计	289,111.37

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,896,023,603.96	2,896,023,603.96
本期申购	16,727,433.07	16,727,433.07
本期赎回(以“-”号填列)	-1,092,984,813.59	-1,092,984,813.59

本期末	1, 819, 766, 223. 44	1, 819, 766, 223. 44
-----	----------------------	----------------------

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75, 938, 762. 08	28, 299, 011. 32	104, 237, 773. 40
本期利润	16, 629, 125. 93	-13, 034, 214. 57	3, 594, 911. 36
本期基金份额交易产生的变动数	-27, 889, 094. 49	-5, 706, 000. 54	-33, 595, 095. 03
其中：基金申购款	475, 479. 98	59, 730. 84	535, 210. 82
基金赎回款	-28, 364, 574. 47	-5, 765, 731. 38	-34, 130, 305. 85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64, 678, 793. 52	9, 558, 796. 21	74, 237, 589. 73

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	84, 575. 10
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	28, 786. 17
其他	1, 321. 58
合计	114, 682. 85

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	193, 164, 144. 69
减：卖出股票成本总额	210, 179, 167. 86
买卖股票差价收入	-17, 015, 023. 17

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	7, 464, 719, 312. 76

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,386,656,889.55
减：应收利息总额	77,406,841.35
买卖债券差价收入	655,581.86

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生品投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	58,104.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	58,104.68

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,034,214.57
——股票投资	-2,840,702.42
——债券投资	-10,193,512.15
——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	-13,034,214.57

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	818,804.25
基金转换费收入	1,890,675.32
合计	2,709,479.57

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	471,224.62
银行间市场交易费用	51,400.00
合计	522,624.62

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	149,179.94
其他	600.00
银行间帐户维护费	18,000.00
银行汇划费用	46,725.50
合计	254,287.00

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本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交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,879,798.76	4,554,983.74
其中：支付销售机构的客户维护费	488,569.46	175,517.09

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
----	----------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	2,891,624.69	948,954.94
----------------	--------------	------------

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年 6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	12,031,810.37	84,575.10	-	-

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配

### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016年6月15日	2016年7月1日	新债流通受限	100.00	100.00	8,860	886,000.00	886,000.00	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
300508	维宏股份	2016年6月30日	临时停牌	254.50	2016年7月6日	242.00	970	19,477.60	246,865.00	-

		日			日					
603919	金徽酒	2016年6月6日	重大事项	30.90	2016年7月5日	33.99	6,604	72,247.76	204,063.60	-
300503	昊志机电	2016年6月30日	临时停牌	84.72	2016年7月5日	82.99	1,863	14,382.36	157,833.36	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 60,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	330,790,000.00	390,426,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	278,858,000.00	1,131,911,000.00
合计	609,648,000.00	1,522,337,000.00

注：以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、超短期融资券、银行定期存单。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	618,326,095.60	690,437,000.00
AAA 以下	401,512,283.40	407,615,000.00
未评级	89,769,000.00	51,590,000.00
合计	1,109,607,379.00	1,149,642,000.00

注：以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本报告期末，除卖出回购金融资产款余额中有 60,000,000.00 元将在 1 个月内到期且计息（其利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,031,810.37	-	-	-	12,031,810.37
结算备付金	1,387,702.51	-	-	-	1,387,702.51
存出保证金	92,970.96	-	-	-	92,970.96
交易性金融资产	887,864,017.00	809,501,362.00	21,890,000.00	33,610,224.85	1,752,865,603.85
买入返售金融资产	158,400,437.60	-	-	-	158,400,437.60
应收利息	-	-	-	32,638,853.32	32,638,853.32
应收申购款	-	-	-	122,008.20	122,008.20
其他资产	-	-	-	1,000.00	1,000.00
资产总计	1,059,776,938.44	809,501,362.00	21,890,000.00	66,372,086.37	1,957,540,386.81
负债					
卖出回购金融资产款	60,000,000.00	-	-	-	60,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	672,339.61	672,339.61
应付赎回款	-	-	-	164,996.18	164,996.18
应付管理人报酬	-	-	-	1,880,441.38	1,880,441.38
应付托管费	-	-	-	391,758.63	391,758.63
应付交易费用	-	-	-	111,681.33	111,681.33
应付利息	-	-	-	26,245.14	26,245.14
其他负债	-	-	-	289,111.37	289,111.37
负债总计	60,000,000.00	-	-	3,536,573.64	63,536,573.64
利率敏感度缺口	999,776,938.44	809,501,362.00	21,890,000.00	62,835,512.73	1,894,003,813.17
上年度末 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	2,205,465.49	-	-	-	2,205,465.49
结算备付金	3,799,898.57	-	-	-	3,799,898.57
存出保证金	341,579.22	-	-	-	341,579.22
交易性金融资产	1,624,675,000.00	996,117,000.00	51,187,000.00	159,937,321.47	2,831,916,321.47
买入返售金融资产	165,000,687.50	-	-	-	165,000,687.50
应收证券清算款	-	-	-	4,978,598.77	4,978,598.77
应收利息	-	-	-	32,989,181.77	32,989,181.77
应收申购款	-	-	-	127,714.95	127,714.95
资产总计	1,796,022,630.78	996,117,000.00	51,187,000.00	198,032,816.96	3,041,359,447.74
负债					
卖出回购金融资产款	35,000,000.00	-	-	-	35,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	1,242,279.24	1,242,279.24
应付管理人报酬	-	-	-	3,294,577.86	3,294,577.86
应付托管费	-	-	-	686,370.35	686,370.35
应付交易费用	-	-	-	690,175.10	690,175.10
应付利息	-	-	-	2,834.96	2,834.96
其他负债	-	-	-	181,832.87	181,832.87
负债总计	35,000,000.00	-	-	6,098,070.38	41,098,070.38
利率敏感度缺口	1,761,022,630.78	996,117,000.00	51,187,000.00	191,934,746.58	3,000,261,377.36

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变动且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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-5,499,908.23	-8,088,802.00
	市场利率下降 25 个基点	5,546,983.09	8,163,227.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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% - 40%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	33,610,224.85	1.77	159,937,321.47	5.33
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	33,610,224.85	1.77	159,937,321.47	5.33

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.77%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	33,610,224.85	1.72
	其中：股票	33,610,224.85	1.72
2	固定收益投资	1,719,255,379.00	87.83
	其中：债券	1,719,255,379.00	87.83
	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	158,400,437.60	8.09
	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	13,419,512.88	0.69
7	其他各项资产	32,854,832.48	1.68
8	合计	1,957,540,386.81	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	191,361.36	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,562,207.70	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	978,892.05	0.05
F	批发和零售业	5,236,556.54	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	9,588,000.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,033,081.10	0.37
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,610,224.85	1.77

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601021	春秋航空	200,000	9,588,000.00	0.51
2	002241	歌尔股份	200,000	5,736,000.00	0.30
3	002727	一心堂	200,000	5,000,000.00	0.26
4	300017	网宿科技	50,000	3,360,000.00	0.18
5	300496	中科创达	25,641	1,736,408.52	0.09
6	002786	银宝山新	28,890	862,944.30	0.05
7	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
8	603996	中新科技	25,093	765,587.43	0.04
9	300494	盛天网络	12,502	580,717.90	0.03
10	300493	润欣科技	7,248	522,653.28	0.03
11	002777	久远银海	4,264	515,944.00	0.03
12	603528	多伦科技	3,112	304,944.88	0.02
13	002778	高科石化	5,600	266,000.00	0.01
14	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
15	300508	维宏股份	970	246,865.00	0.01
16	002788	鹭燕医药	3,663	236,556.54	0.01
17	603919	金徽酒	6,604	204,063.60	0.01
18	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
19	300511	雪榕生物	2,872	191,361.36	0.01
20	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.01
21	300503	昊志机电	1,863	157,833.36	0.01

22	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
23	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.01
24	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.01
25	300505	川金诺	1,893	114,450.78	0.01
26	002789	建艺集团	1,500	107,520.00	0.01
27	603027	千禾味业	2,904	102,424.08	0.01
28	603798	康普顿	1,590	101,585.10	0.01
29	002795	永和智控	1,450	98,716.00	0.01
30	603028	赛福天	3,309	97,317.69	0.01
31	300506	名家汇	1,819	96,097.77	0.01
32	300510	金冠电气	1,365	92,219.40	0.00
33	002793	东音股份	1,413	91,859.13	0.00
34	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.00
35	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
36	603029	天鹅股份	1,618	72,211.34	0.00
37	603726	朗迪集团	1,361	68,798.55	0.00
38	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
39	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
40	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
41	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
42	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
43	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
44	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
45	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
46	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000418	小天鹅A	15,750,370.03	0.52
2	601021	春秋航空	9,898,009.32	0.33
3	600004	白云机场	9,421,238.38	0.31
4	002241	歌尔股份	7,714,763.20	0.26
5	000902	新洋丰	7,364,019.10	0.25
6	000590	启迪古汉	6,217,188.18	0.21

7	600496	精工钢构	5,555,342.15	0.19
8	600755	厦门国贸	4,525,970.00	0.15
9	002727	一心堂	4,345,585.00	0.14
10	600900	长江电力	3,687,000.00	0.12
11	002510	天汽模	3,477,847.00	0.12
12	300017	网宿科技	3,202,466.87	0.11
13	600998	九州通	1,895,234.28	0.06
14	603939	益丰药房	1,641,038.55	0.05
15	002797	第一创业	212,044.56	0.01
16	601966	玲珑轮胎	199,126.18	0.01
17	601611	中国核建	128,594.73	0.00
18	603377	东方时尚	113,750.40	0.00
19	601900	南方传媒	112,559.06	0.00
20	002791	坚朗五金	85,697.61	0.00

注：1. 买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601998	中信银行	32,018,901.74	1.07
2	600755	厦门国贸	17,454,757.61	0.58
3	000418	小天鹅A	17,187,687.79	0.57
4	601009	南京银行	15,601,375.27	0.52
5	000042	中洲控股	14,825,438.96	0.49
6	601628	中国人寿	11,107,047.00	0.37
7	600096	云天化	10,506,832.27	0.35
8	600823	世茂股份	9,862,103.22	0.33
9	600998	九州通	9,729,026.73	0.32
10	600004	白云机场	8,968,376.38	0.30
11	000590	启迪古汉	6,581,979.38	0.22
12	000902	新洋丰	6,420,651.60	0.21
13	600809	山西汾酒	5,891,058.17	0.20
14	600496	精工钢构	4,542,539.25	0.15
15	600900	长江电力	3,726,000.00	0.12
16	002510	天汽模	2,852,913.00	0.10

17	002241	歌尔股份	2,601,925.69	0.09
18	603939	益丰药房	1,705,687.00	0.06
19	603508	思维列控	1,094,539.65	0.04
20	603800	道森股份	947,127.30	0.03

注：1. 卖出主要指基金在二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2. “卖出股票收入”按卖出成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	86,692,773.66
卖出股票收入（成交）总额	193,164,144.69

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	80,048,000.00	4.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,769,000.00	4.74
	其中：政策性金融债	89,769,000.00	4.74
4	企业债券	20,524,000.00	1.08
5	企业短期融资券	431,100,000.00	22.76
6	中期票据	991,671,000.00	52.36
7	可转债（可交换债）	7,643,379.00	0.40
8	同业存单	98,500,000.00	5.20
9	其他	-	-
10	合计	1,719,255,379.00	90.77

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041570003	15 吴华 CP001	1,100,000	110,671,000.00	5.84
2	1282290	12 船重 MTN2	1,000,000	102,320,000.00	5.40
3	111609011	16 浦发 CD011	1,000,000	98,500,000.00	5.20
4	019527	15 国债 27	800,000	80,048,000.00	4.23

5	101454034	14 中南方 MTN001	700,000	74,326,000.00	3.92
---	-----------	---------------	---------	---------------	------

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

## 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	92,970.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,638,853.32
5	应收申购款	122,008.20
6	其他应收款	1,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,854,832.48

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	702,204.00	0.04

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601611	中国核建	775,274.28	0.04	临时停牌

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

# § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,310	787,777.59	1,685,033,320.76	92.60%	134,732,902.68	7.40%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	75,805.58	0.0042%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年5月29日）基金份额总额	3,989,623,187.02
本报告期期初基金份额总额	2,896,023,603.96
本报告期基金总申购份额	16,727,433.07
减：本报告期基金总赎回份额	1,092,984,813.59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,819,766,223.44

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2016年4月27日经宝盈基金管理有限公司第四届第二十一次董事会临时会议通讯表决，同意储诚忠辞去宝盈基金管理有限公司副总经理职务。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会《关于对宝盈基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停办理公募基金产品注册申请3个月，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，针对性的制定、实施整改措施，并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

除上述情况外，报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元数量	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	备注
华泰证券	1	174,003,937.72	62.62%	158,570.89	62.62%	-
东方证券	2	103,856,279.03	37.38%	94,644.21	37.38%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(I) 租用交易单元情况

本报告期内未新增租用交易单元。

(II) 退租交易单元情况

本报告期内未退租已有的交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
华泰证券	70,207,952.89	94.38%	3,677,900,000.00	100.00%	-	-
东方证券	3,277,288.42	4.41%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	907,000.00	1.22%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于指数触发不可恢复熔断当日旗下部分基金开放时间调整的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年1月4日
2	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	2016年1月5日
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行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	2016年1月5日
4	宝盈基金管理有限公司关于指数触发不可恢复熔断当日旗下部分基金开放时间调整的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年1月7日
5	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	2016年1月8日
6	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	2016年1月12日

7	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	2016年1月14日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年1月16日
9	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	2016年1月27日
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	2016年1月28日
11	宝盈祥泰养老混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月2日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月3日
13	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月5日
14	宝盈基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月16日
15	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月19日
16	宝盈基金管理有限公司关于旗下	中国证券报 证券时报	2016年2月24日

	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	上海证券报	
17	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职领薪情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月24日
18	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月25日
19	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	2016年2月26日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年3月1日
21	关于增加中泰证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年3月11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	2016年3月18日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年3月22日
24	关于宝盈基金管理有限公司网上交易平台开通富友支付及费率优惠的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年3月28日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年3月31日
26	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年4月6日

	益法进行估值的提示性公告		
27	宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年4月29日
28	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年5月10日
29	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年5月11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	2016年5月14日
31	宝盈基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理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	2016年5月16日
32	宝盈基金管理有限公司关于新增珠海盈米财富管理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	2016年5月18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	2016年6月2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	2016年6月4日
35	宝盈基金管理有限公司关于新增大泰金石投资管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年6月6日

	优惠活动的公告		
36	宝盈基金管理有限公司关于新增浙江同花顺基金销售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	2016年6月6日
37	宝盈基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售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	2016年6月6日
38	宝盈基金管理有限公司关于新增上海凯石财富基金销售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	2016年6月6日
39	关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的更正公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年6月8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	2016年6月28日
41	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年6月29日
42	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	2016年6月30日

## § 11 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈祥泰养老混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

### 12.2 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：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### 12.3 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8月25日