

宝盈新兴产业灵活配置混合型 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

§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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
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.....	10
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.....	11
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
§5 托管人报告	11
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
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.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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.....	35
7.7 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.....	35
7.8 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.....	35
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.11 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息	37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
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.....	37
§9 开放式基金份额变动.....	37
§10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
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.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§12 备查文件目录.....	44
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	宝盈新兴产业混合
基金主代码	001128
交易代码	001128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 13 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,988,922,108.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，精选新兴产业及其相关行业中的优质企业进行投资，分享新兴产业发展所带来的投资机会，力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。 本基金所指的新兴产业是指随着科研、技术、工艺、产品、服务、商业模式以及管理等方面的创新和变革而产生和发展起来的新兴产业部门。当前所指的新兴产业主要包括：新能源、节能环保、新能源汽车、信息产业、生物医药、国防军工、新材料、高端装备制造、现代服务业及海洋产业等。本基金管理人将重点投资新兴产业及其上下游延伸产业的相关个股，深入挖掘主题投资机会，分享这一投资机遇。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×65% + 中证综合债券指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqing1.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一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 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	-196,093,880.59
本期利润	-462,421,699.85
加权平均基金份额本期利润	-0.1132
本期加权平均净值利润率	-18.12%
本期基金份额净值增长率	-13.86%
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	-1,568,487,711.61
期末可供分配基金份额利润	-0.3932
期末基金资产净值	2,751,200,267.45
期末基金份额净值	0.690
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	-31.00%

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。

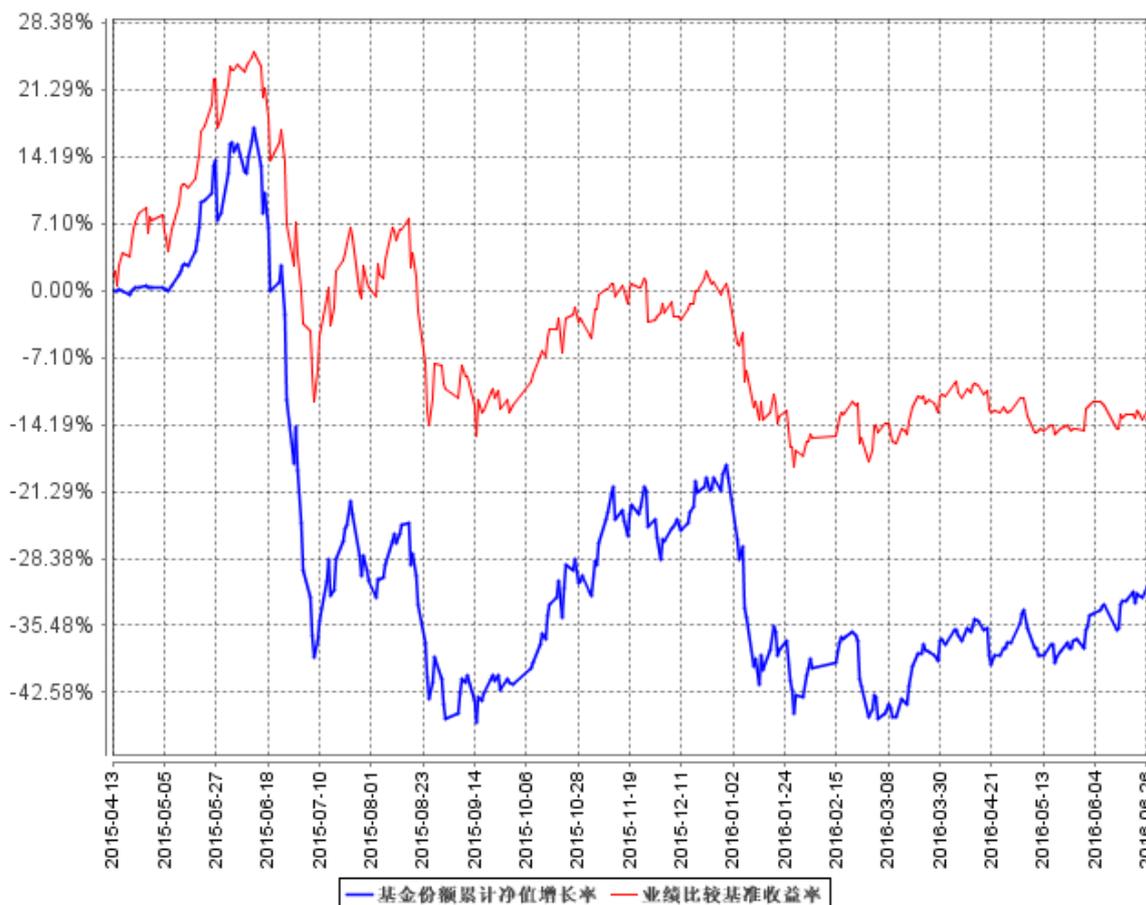
3.2 基金净值表现

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	7.81%	1.59%	1.05%	0.92%	6.76%	0.67%
过去三个月	9.35%	1.61%	-0.75%	0.91%	10.10%	0.70%
过去六个月	-13.86%	2.54%	-11.58%	1.50%	-2.28%	1.04%
过去一年	-19.30%	2.77%	-17.67%	1.85%	-1.63%	0.92%
自基金合同生效起至今	-31.00%	2.74%	-11.69%	1.87%	-19.31%	0.87%

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		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金经理	2015 年 4 月 13 日	-	11 年	盖俊龙先生，经济学硕士。2005 年 8 月至 2011 年 5 月，在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011 年 6 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2016 年 6 月 30 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2016 年上半年，首先 1 月份经历了一轮快速大幅下跌，进入 2 月以后，虽然 A 股市场整体是一种震荡走势，但有些主题表现突出，例如动力电池和 OLED 等产业链，以及稀土黄金等品种。本基金重点投资在新兴产业领域，所以持仓以成长股为主。

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 0.690 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 -13.86%，业绩比较基准收益率为 -11.58%。

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 7 月 1 日，国家统计局与中国物流与采购联合会公布：6 月份制造业 PMI 为 50.0%，较上月下降 0.1 个百分点。制造业 PMI 连续 5 个月处于历史同期的低位附近，显示工业生产整体仍然偏弱。6 月份 PMI 生产端（PMI 生产指数 52.5%，较上月小幅上升 0.2 个百分点）仍有小幅上升，表明前期稳增长政策效应仍在发挥作用；但需求端（新订单和新出口订单指数分别录得 50.5% 和 49.6%，较上月回落 0.2 和 0.4 个百分点）疲弱态势延续，且企业对未来形势的疑虑加大，企业信心持续减弱。供需两端呈现持续分化的态势，判断当前经济仍然面临较大的下行压力。

近期全球风险资产和避险资产价格双双上涨。美国和英国股市不但收复英国脱欧公投冲击的失地，英国股市还创下新高，某些大宗商品价格也有反弹。全球市场出现戏剧性变化的根源在于市场对全球各国央行新一轮宽松预期上升，靠货币宽松推动的资产价格上涨具有很强的泡沫属性。

展望下半年的资本市场，仍将面临一系列不确定性因素，例如大部分成长股的估值仍然过高等。因此，预计下半年市场行情仍将呈现震荡走势，投资机会以结构性为主。

本基金重点投资在新兴产业领域，将以成长股投资为主，成长股以新兴产业的龙头股为主，将重点关注能源互联网（电改、储能）、军工电子化、半导体等行业，另外，也会密切关注体育、OLED、VR 等主题中的个股若有深度调整带来的投资机会。

另外，因为 2016 年 A 股市场的不确定性很大，基金管理人会适度调整本基金的股票仓位，希望达到收益与风险匹配的目标。

本基金主要以个股投资价值判断为主。基金管理人将遵循基金合同约定的投资策略，为投资者追求较高的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。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、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的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	949,963,716.34	245,574,881.27
结算备付金		4,149,245.78	7,815,122.46
存出保证金		679,675.70	2,433,846.42
交易性金融资产	6.4.7.2	1,764,190,542.28	3,155,758,730.54
其中：股票投资		1,764,190,542.28	2,955,528,730.54
基金投资		-	-
债券投资		-	200,230,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		43,713,437.04	-
应收利息	6.4.7.5	189,440.81	7,559,118.29
应收股利		-	-
应收申购款		266,488.06	1,678,376.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		2,763,152,546.01	3,420,820,075.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	109,373,920.43
应付赎回款		4,548,196.97	12,796,714.52
应付管理人报酬		3,296,556.12	4,094,588.45
应付托管费		549,426.03	682,431.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,234,136.96	5,532,685.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	323,962.48	229,602.05
负债合计		11,952,278.56	132,709,942.20
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,988,922,108.56	4,102,849,407.05
未分配利润	6.4.7.10	-1,237,721,841.11	-814,739,273.87
所有者权益合计		2,751,200,267.45	3,288,110,133.18
负债和所有者权益总计		2,763,152,546.01	3,420,820,075.38

注：报告截止 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.690 元，基金份额总额 3,988,922,108.56 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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4月13日(基 金合同生效日)至 2015年6月30日
一、收入		-432,255,843.41	-717,733,519.06
1.利息收入		3,644,529.16	12,144,840.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,665,351.08	3,343,608.32
债券利息收入		979,178.08	898,916.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,902,315.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-169,858,877.63	67,890,023.71

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-172,263,772.31	60,669,732.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,124,682.80	-
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	6,529,577.48	7,220,291.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-266,327,819.26	-803,639,351.00
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	286,324.32	5,870,967.59
减：二、费用		30,165,856.44	38,923,549.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,078,165.47	22,719,379.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,179,694.25	3,786,563.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,715,444.44	12,314,749.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	192,552.28	102,857.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-462,421,699.85	-756,657,068.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-462,421,699.85	-756,657,068.82

注：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 13 日，上年度可比期间为 2015 年 4 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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）	4,102,849,407.05	-814,739,273.87	3,288,110,133.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-462,421,699.85	-462,421,699.85
三、本期基金份额交易	-113,927,298.49	39,439,132.61	-74,488,165.88

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	146,073,704.27	-54,888,348.28	91,185,355.99
2.基金赎回款	-260,001,002.76	94,327,480.89	-165,673,521.87
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)	3,988,922,108.56	-1,237,721,841.11	2,751,200,267.45
项目	上年度可比期间 2015年4月13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)	6,932,275,586.95	-	6,932,275,586.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-756,657,068.82	-756,657,068.82
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)	-1,367,085,403.59	-48,812,660.00	-1,415,898,063.59
其中: 1.基金申购款	126,240,182.29	6,948,575.10	133,188,757.39
2.基金赎回款	-1,493,325,585.88	-55,761,235.10	-1,549,086,820.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	5,565,190,183.36	-805,469,728.82	4,759,720,454.54

注: 本基金合同生效日为 2015 年 4 月 13 日, 上年度可比期间为 2015 年 4 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

汪钦
基金管理人负责人

胡坤
主管会计工作负责人

何瑜
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]361号《关于核准宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集包括认购资金利息共募集 6,932,275,586.95 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第 288 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 6,932,275,586.95 份基金份额,其中认购资金利息折合 261,651.25 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%,其中投资于新兴产业相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%;其他金融工具的投资比例按照法律法规或者监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%。

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 2016 年半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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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须说明的会计差错更正。

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》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

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	949,963,716.34
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	949,963,716.34

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	1,610,143,061.59	1,764,190,542.28	154,047,480.69
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,610,143,061.59	1,764,190,542.28	154,047,480.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无余额。

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

本基金本报告期末无余额。

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	187,208.56
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	1,867.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	59.25
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	305.90
合计	189,440.81

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	3,234,136.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,234,136.96

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,000.98
预提费用	318,961.50
合计	323,962.48

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	4,102,849,407.05	4,102,849,407.05
本期申购	146,073,704.27	146,073,704.27
本期赎回(以“-”号填列)	-260,001,002.76	-260,001,002.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,988,922,108.56	3,988,922,108.56

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	-1,416,795,410.66	602,056,136.79	-814,739,273.87
本期利润	-196,093,880.59	-266,327,819.26	-462,421,699.85
本期基金份额交易产生的变动数	44,401,579.64	-4,962,447.03	39,439,132.61
其中：基金申购款	-53,359,492.15	-1,528,856.13	-54,888,348.28
基金赎回款	97,761,071.79	-3,433,590.90	94,327,480.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,568,487,711.61	330,765,870.50	-1,237,721,841.11

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	2,630,413.87
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	26,150.46
其他	8,786.75
合计	2,665,351.08

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	2,822,080,688.58

减：卖出股票成本总额	2,994,344,460.89
买卖股票差价收入	-172,263,772.31

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）成交总额	208,460,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	204,124,682.80
减：应收利息总额	8,460,000.00
买卖债券差价收入	-4,124,682.80

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期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

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	6,529,577.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,529,577.48

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	-266,327,819.26
——股票投资	-270,222,502.06
——债券投资	3,894,682.80

——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	-266,327,819.26

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	243,160.82
转换费	43,163.50
合计	286,324.32

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。交易费用

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	7,715,444.44
银行间市场交易费用	-
合计	7,715,444.44

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
银行汇划费用	3,590.78
合计	192,552.28

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

截至资产负债表日，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

本基金本报告期存在控制关系或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（以下简称“中国建设银行”）	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

本基金本报告期间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4月13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	19,078,165.47	22,719,379.35
其中：支付销售机构的客户维护费	10,935,685.73	14,903,452.40

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

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4月13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	3,179,694.25	3,786,563.24

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间市场交易。

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

份额单位：份

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4月13日(基金合同生效日)至2015年6月30日
基金合同生效日(2015年4月13日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	14,835,311.57	-
期间申购/买入总份额	-	-
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	14,835,311.57	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.37%	-

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。

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4月13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	949,963,716.34	2,630,413.87	365,699,295.74	3,087,574.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未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

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

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	-

6.4.12.2 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
002452	长高集团	2016年6月14日	重大事项	13.03	2016年7月12日	10.82	7,199,979	83,961,169.29	93,815,726.37	-

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	-
--------	------	------------	------	-------	-----------	-------	--------	------------	------------	---

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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券）。

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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

本基金本报告期末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	949,963,716.34	-	-	-	949,963,716.34
结算备付金	4,149,245.78	-	-	-	4,149,245.78
存出保证金	679,675.70	-	-	-	679,675.70
交易性金融资产	-	-	-	1,764,190,542.28	1,764,190,542.28
应收证券清算款	-	-	-	43,713,437.04	43,713,437.04
应收利息	-	-	-	189,440.81	189,440.81
应收申购款	4,975.12	-	-	261,512.94	266,488.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	954,797,612.94	-	-	1,808,354,933.07	2,763,152,546.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,548,196.97	4,548,196.97
应付管理人报酬	-	-	-	3,296,556.12	3,296,556.12
应付托管费	-	-	-	549,426.03	549,426.03
应付交易费用	-	-	-	3,234,136.96	3,234,136.96
其他负债	-	-	-	323,962.48	323,962.48

负债总计	-	-	-	11,952,278.56	11,952,278.56
利率敏感度缺口	954,797,612.94	-	-	-1,796,402,654.51	2,751,200,267.45
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	245,574,881.27	-	-	-	245,574,881.27
结算备付金	7,815,122.46	-	-	-	7,815,122.46
存出保证金	2,433,846.42	-	-	-	2,433,846.42
交易性金融资产	200,230,000.00	-	-	-2,955,528,730.54	3,155,758,730.54
应收利息	-	-	-	7,559,118.29	7,559,118.29
应收申购款	-	-	-	1,678,376.40	1,678,376.40
资产总计	456,053,850.15	-	-	-2,964,766,225.23	3,420,820,075.38
负债					
应付证券清算款	-	-	-	109,373,920.43	109,373,920.43
应付赎回款	-	-	-	12,796,714.52	12,796,714.52
应付管理人报酬	-	-	-	4,094,588.45	4,094,588.45
应付托管费	-	-	-	682,431.41	682,431.41
应付交易费用	-	-	-	5,532,685.34	5,532,685.34
其他负债	-	-	-	229,602.05	229,602.05
负债总计	-	-	-	132,709,942.20	132,709,942.20
利率敏感度缺口	456,053,850.15	-	-	-2,832,056,283.03	3,288,110,133.18

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

2016 年 6 月 30 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 0.00% (2015 年 12 月 31 日：6.09%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日：同)。

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 0-95%，其中投资于新兴产业相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。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	1,764,190,542.28	64.12	2,955,528,730.54	89.89
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	1,764,190,542.28	64.12	2,955,528,730.54	89.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证新兴产业指数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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 中证新兴产业指数上升 5%	146,664,987.17	-
2. 中证新兴产业指数下降 5%	-146,664,987.17	-	

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	1,764,190,542.28	63.85
	其中：股票	1,764,190,542.28	63.85
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	954,112,962.12	34.53
7	其他各项资产	44,849,041.61	1.62
8	合计	2,763,152,546.01	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,581,849,309.59	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.03
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	144,321,070.55	5.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	37,224,761.76	1.35
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	1,764,190,542.28	64.12

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	300342	天银机电	5,200,000	158,392,000.00	5.76
2	300395	菲利华	4,275,994	114,511,119.32	4.16
3	600702	沱牌舍得	4,400,000	111,056,000.00	4.04
4	300365	恒华科技	2,199,914	100,646,065.50	3.66
5	002452	长高集团	7,199,979	93,815,726.37	3.41
6	002733	雄韬股份	2,700,000	79,515,000.00	2.89
7	000801	四川九洲	6,399,820	78,845,782.40	2.87
8	002546	新联电子	6,421,585	78,792,847.95	2.86
9	002519	银河电子	3,100,000	69,502,000.00	2.53
10	000810	创维数字	3,840,400	69,396,028.00	2.52
11	300114	中航电测	2,299,719	68,531,626.20	2.49
12	300304	云意电气	2,100,000	67,368,000.00	2.45
13	300232	洲明科技	3,999,856	63,397,717.60	2.30
14	300403	地尔汉宇	1,099,921	61,122,609.97	2.22
15	300140	启源装备	2,449,960	54,389,112.00	1.98
16	000901	航天科技	1,299,928	52,192,109.20	1.90
17	300316	晶盛机电	3,901,300	51,107,030.00	1.86
18	300322	硕贝德	2,300,000	49,450,000.00	1.80
19	300075	数字政通	1,699,981	43,604,512.65	1.58
20	002371	七星电子	1,000,000	41,820,000.00	1.52
21	000534	万泽股份	2,499,984	37,224,761.76	1.35
22	002350	北京科锐	1,699,930	34,338,586.00	1.25
23	002326	永太科技	1,499,940	30,598,776.00	1.11
24	300068	南都电源	1,300,000	28,418,000.00	1.03
25	603799	华友钴业	700,000	26,040,000.00	0.95

26	002169	智光电气	999,909	22,747,929.75	0.83
27	002097	山河智能	2,200,000	22,638,000.00	0.82
28	300389	艾比森	835,880	20,537,571.60	0.75
29	002079	苏州固锴	1,799,967	20,105,631.39	0.73
30	002025	航天电器	499,936	12,343,419.84	0.45
31	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
32	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
33	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
34	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
35	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
36	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
37	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
38	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
39	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
40	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
41	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
42	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
43	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
44	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	300395	菲利华	109,863,983.82	3.34
2	600702	沱牌舍得	101,140,969.78	3.08
3	002733	雄韬股份	99,128,956.99	3.01
4	002452	长高集团	83,961,169.29	2.55
5	300207	欣旺达	74,177,528.66	2.26
6	002655	共达电声	72,297,450.49	2.20
7	002546	新联电子	68,130,910.14	2.07
8	002341	新纶科技	68,060,854.38	2.07
9	000810	创维数字	67,663,250.25	2.06
10	002371	七星电子	65,397,065.13	1.99
11	300114	中航电测	59,966,002.30	1.82

12	300232	洲明科技	59,384,225.69	1.81
13	300304	云意电气	59,123,245.95	1.80
14	300458	全志科技	58,875,010.06	1.79
15	002533	金杯电工	58,037,103.39	1.77
16	300140	启源装备	53,901,407.29	1.64
17	300342	天银机电	52,410,990.80	1.59
18	000901	航天科技	51,482,296.69	1.57
19	300068	南都电源	50,196,866.95	1.53
20	300327	中颖电子	49,137,331.14	1.49

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、“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	002546	新联电子	223,475,996.00	6.80
2	002123	荣信股份	216,316,394.48	6.58
3	300327	中颖电子	140,937,611.26	4.29
4	300078	思创医惠	127,580,974.15	3.88
5	300213	佳讯飞鸿	99,173,034.39	3.02
6	300322	硕贝德	94,345,120.29	2.87
7	300366	创意信息	89,101,505.27	2.71
8	002323	雅百特	83,598,436.62	2.54
9	300458	全志科技	83,293,809.81	2.53
10	002519	银河电子	75,377,831.54	2.29
11	300425	环能科技	75,063,237.48	2.28
12	300246	宝莱特	75,060,768.35	2.28
13	300207	欣旺达	73,836,197.69	2.25
14	002533	金杯电工	71,689,019.01	2.18
15	002341	新纶科技	69,682,470.79	2.12
16	300384	三联虹普	68,787,131.63	2.09
17	000810	创维数字	63,689,702.59	1.94
18	002655	共达电声	60,679,229.99	1.85
19	002364	中恒电气	55,653,881.81	1.69
20	600865	百大集团	53,001,970.06	1.61

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

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	2,073,228,774.69
卖出股票收入（成交）总额	2,822,080,688.58

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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持有股指期货。

7.9.2 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	679,675.70
2	应收证券清算款	43,713,437.04
3	应收股利	-
4	应收利息	189,440.81
5	应收申购款	266,488.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,849,041.61

7.11.4 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。

7.11.5 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	002452	长高集团	93,815,726.37	3.41	重大事项

7.11.6 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
45,702	87,281.13	24,267,646.28	0.61%	3,964,654,462.28	99.39%

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	1,990.16	0.00%

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4月13日）基金份额总额	6,932,275,586.95
本报告期期初基金份额总额	4,102,849,407.05
本报告期基金总申购份额	146,073,704.27
减：本报告期基金总赎回份额	260,001,002.76
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	3,988,922,108.56

§ 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
国信证券	1	1,575,198,161.78	32.19%	1,435,479.28	32.19%	-
长江证券	2	1,267,610,887.72	25.90%	1,155,176.43	25.91%	-
平安证券	1	1,051,428,507.20	21.49%	958,165.96	21.49%	-
西南证券	1	672,602,301.69	13.75%	612,943.14	13.75%	-
华泰证券	1	326,472,903.28	6.67%	297,511.43	6.67%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

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

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

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

3、本基金与本基金管理公司管理的宝盈资源优选股票型证券投资基金共用交易单元，本报告期末

租用和退租证券公司交易单元。

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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年1月16日

	估值的提示性公告		
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
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 5 日
13	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
14	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
15	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 24 日
16	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
17	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
18	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

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 3 月 1 日
20	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
21	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
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 22 日
23	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
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	2016 年 3 月 31 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 4 月 6 日
26	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
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	2016 年 5 月 10 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 证券日报	2016 年 5 月 11 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 14 日
30	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
31	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
32	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金投资长方集团非公开发行股票的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016 年 5 月 19 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
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	中国证券报 证券时报	2016 年 6 月 6 日

	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	报 上海证券报 证券 日报	
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新兴产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈新兴产业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。

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