

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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 2015 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈核心优势混合	
基金主代码	213006	
交易代码	213006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 3 月 17 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,177,280,434.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
下属分级基金的交易代码:	213006	000241
报告期末下属分级基金的份额总额	2,118,956,420.20 份	58,324,014.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期，本基金根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业，建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上，对于景气度提高的行业给予适当倾斜，以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>根据公司的基本面情况，根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业，建立股票池。本基金在构建投资组合时，强调两端投资，价值与成长性能平衡，兼顾价值与成长型股票，以均衡资产混合策略建立动力资产组合，努力克服单一风格投资所带来的局限性，这样可以较好控制组合市场适应性，一定程度上能够排除对景气误判概率，以求多空环境中都能创造主动管理回报。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取主动投资策略，运用利率预测、久期管理、</p>

	收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金是一只灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险预算范围内追求收益最大化。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	王永民
	联系电话	0755-83276688	010-66594896
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95566
传真		0755-83515599	010-66594942
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518034	100818
法定代表人		李文众	田国立

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、基金托管人住所

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

基金级别	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,547,173,888.66	86,012,977.25
本期利润	1,991,015,171.16	73,129,107.81

加权平均基金份额本期利润	0.5263	0.5731
本期加权平均净值利润率	31.25%	34.32%
本期基金份额净值增长率	26.71%	25.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配利润	1,085,160,281.79	28,700,314.39
期末可供分配基金份额利润	0.5121	0.4921
期末基金资产净值	3,204,116,701.99	87,024,328.82
期末基金份额净值	1.5121	1.4921
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	200.25%	143.19%

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。

5、本基金于 2013 年 8 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合 C”。

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

宝盈核心优势混合 A

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	-20.60%	3.86%	-4.57%	2.28%	-16.03%	1.58%
过去三个月	2.44%	2.91%	7.58%	1.70%	-5.14%	1.21%
过去六个月	26.71%	2.29%	18.48%	1.47%	8.23%	0.82%
过去一年	98.48%	1.83%	64.80%	1.20%	33.68%	0.63%
过去三年	272.72%	1.53%	56.24%	0.97%	216.48%	0.56%
自基金合同生效起至今	200.25%	1.33%	75.92%	1.00%	124.33%	0.33%

宝盈核心优势混合 C

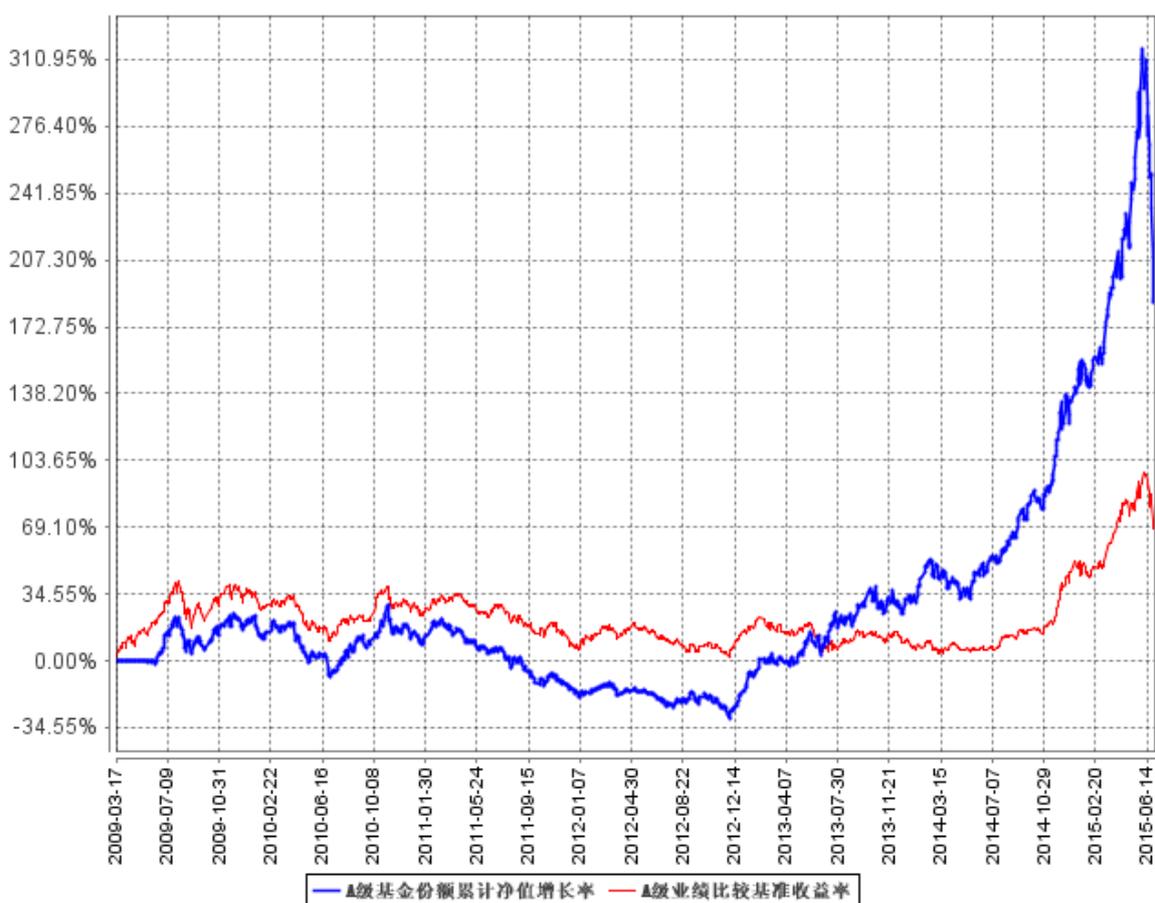
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-20.69%	3.87%	-4.57%	2.28%	-16.12%	1.59%

过去三个月	2.09%	2.91%	7.58%	1.70%	-5.49%	1.21%
过去六个月	25.86%	2.29%	18.48%	1.47%	7.38%	0.82%
过去一年	96.15%	1.83%	64.80%	1.20%	31.35%	0.63%
自基金合同生效起至今	143.19%	1.65%	62.91%	1.00%	80.28%	0.65%

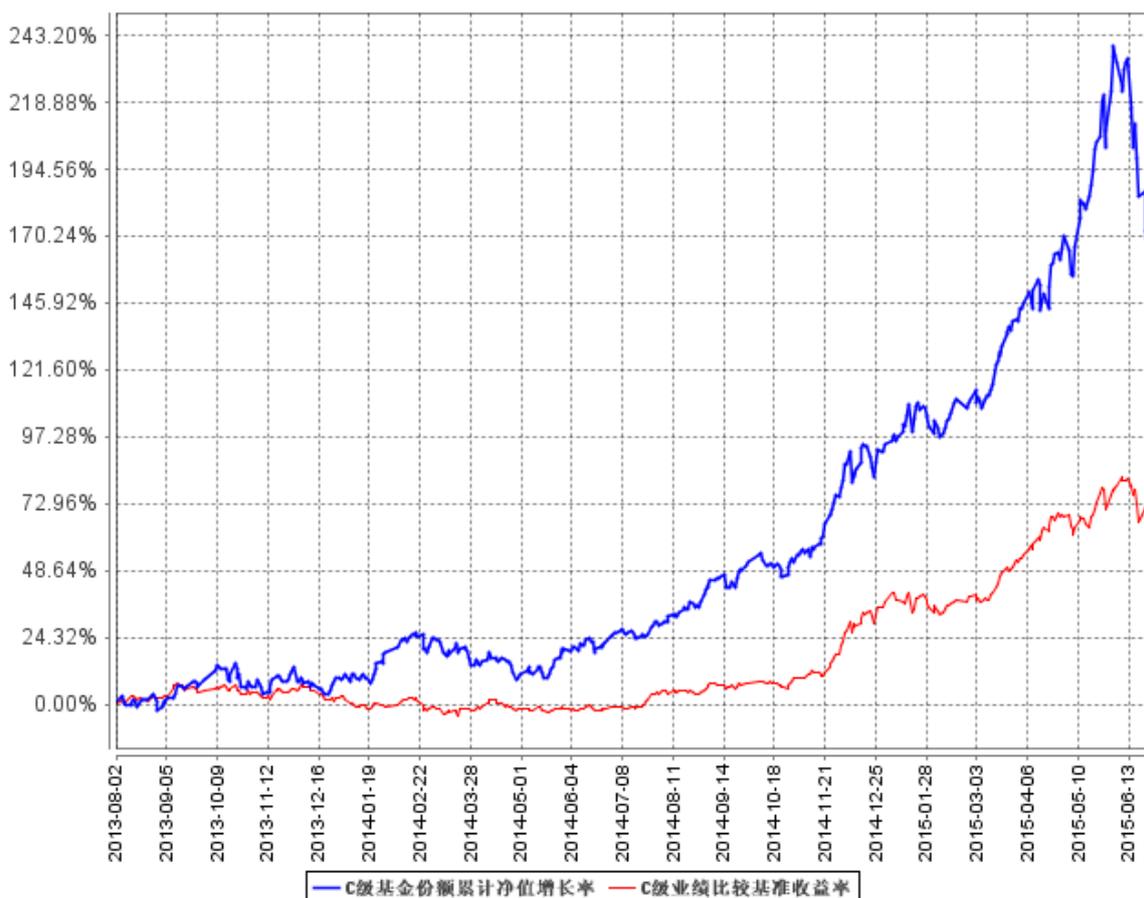
注：本基金于 2013 年 8 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合 C”。

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

A 级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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合C”。

§ 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、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选股票、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、宝盈祥泰养老混合十七只基金，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		
张小仁	本基金基金经理、宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014 年 9 月 26 日	-	8 年	张小仁先生，中山大学经济学硕士。2007 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；
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 6 月 30 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

今年上半年，我国宏观经济仍处于寻底过程中，如中央文件所言，中国经济目前处于经济增长的换挡期、结构调整的阵痛期以及前期刺激政策的消化期。中国经济的结构性问题仍需要时间和智慧来解决，绝非易事。中央政府充分意识到目前中国经济所处的状况，继续推动“互联网+”、“一带一路”、“国企改革”、“万众创新”、“大众创业”等重点方向，为我国经济转型注入了新的能量。

报告期内，上证指数上涨 32.23%，创业板指数上涨 94.23%，各指数均在 6 月中旬创下新高后，开始显著急剧的回落。尤其是前期涨幅巨大的中小板、创业板，出现连续无量跌停的现象。此次市场调整，最本质的原因是前期涨幅过大过快、估值过高，外加“去杠杆”的推手，直接酿成了全球罕见的“股灾”。再加持股集中度较高，更造成了“挤压式卖盘”，从而引起流动性恐慌的迹象。

本基金在一季度仍基本维持了比较均衡的配置，亦即传统蓝筹外加积极成长。进入 5 月份，开始大幅加配成长股；同时为了规避流动性风险，选择大市值的主题股进行配置，但此次交易流动性的枯竭程度还是远超预期，热门主题的大市值公司回落同样巨大，基金净值回落明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

宝盈核心优势混合 A：截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.5121 元。本基金在本报告期内净值增长率是 26.71%，同期业绩比较基准收益率是 18.48%。

宝盈核心优势混合 C：截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.4921 元。本基金在本报告期内净值增长率是 25.86%，同期业绩比较基准收益率是 18.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全年，由于我国经济在资本、人力等方面都遇到了一定瓶颈，加上经济基数已经十分庞大，国内经济增长率中枢的下行是大概率事件；但从经济周期叠加政治周期的角度看，政府扭转经济下滑态势的决心也会越来越强。

市场层面，短期经历暴跌后，投资者的情绪比较摇摆，容易出现极端跌停的现象。与此同时，我们也看到相关部门在积极推出“救市”政策，各参与主体也都纷纷表态，对恢复市场信心有一

定好处，但也需要更多的时间。短期的投资将更遵循买跌不买涨、同时降低收益的幅度预期。就中长期而言，资本市场的活跃度对经济转型、改革创新具有极为重要的作用，理应也将成为居民资产的主要配置方向之一，依然值得看好。

下一阶段，总的思路是紧跟国家政策，中短期很难出现上半年那样的普涨局面，选股的重要性更发显现，将会更加突出估值与市值的同等重要性；充分利用市场的恐慌情绪，率先增持被显著错杀的品种。未来将会灵活调整对本基金的配置。

我们将严格按照基金合同的规定，继续努力尽责做好本基金的管理工作，尽力为投资者谋取较好的回报。

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：当基金实现可分配收益达到 0.04 元或者当基金净值达到 1.10 元或以上时，且满足法定分红条件时，即实施收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少分配 1 次，基金收益分配每年至多 12 次；年度分红 12 次后，如果再次达到分红条

件，收益分配滚存到下一年度实施；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 60%，基金合同生效不满三个月，收益可不分配；基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，报告期内本基金共进行了 12 次收益分配：

1、本基金管理人已于 2015 年 1 月 13 日发布公告，以 2015 年 1 月 5 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.60 元。

2、本基金管理人已于 2015 年 1 月 24 日发布公告，以 2015 年 1 月 16 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.20 元。

3、本基金管理人已于 2015 年 2 月 9 日发布公告，以 2015 年 1 月 29 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.20 元。

4、本基金管理人已于 2015 年 2 月 28 日发布公告，以 2015 年 2 月 11 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.20 元。

5、本基金管理人已于 2015 年 3 月 12 日发布公告，以 2015 年 3 月 3 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

6、本基金管理人已于 2015 年 3 月 25 日发布公告，以 2015 年 3 月 16 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

7、本基金管理人已于 2015 年 4 月 8 日发布公告，以 2015 年 3 月 27 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

8、本基金管理人已于 2015 年 4 月 21 日发布公告，以 2015 年 4 月 10 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

9、本基金管理人已于 2015 年 5 月 5 日发布公告，以 2015 年 4 月 23 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

10、本基金管理人已于 2015 年 5 月 18 日发布公告，以 2015 年 5 月 7 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

11、本基金管理人已于 2015 年 5 月 30 日发布公告，以 2015 年 5 月 20 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 0.10 元。

12、本基金管理人已于 2015 年 6 月 10 日发布公告，以 2015 年 6 月 2 日可供分配利润为基准，每 10 份 A/C 类基金份额派发红利 2.50 元。

本报告期末宝盈核心优势混合 A 可供分配基金份额利润 0.5121 元，基金份额净值 1.5121 元，

宝盈核心优势混合 C 可供分配基金份额利润 0.4921 元，基金份额净值 1.4921 元，符合利润分配条件，但 2015 年上半年度本基金分红次数已达到 12 次，根据合同约定本基金年度分红 12 次后，如果再次达到分红条件，收益分配滚存到下一年度实施。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。）

§ 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：宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	505,240,977.23	281,110,040.20
结算备付金		8,690,427.49	12,825,904.10
存出保证金		2,956,762.59	1,282,939.77
交易性金融资产	6.4.7.2	3,184,319,992.75	7,222,486,263.77
其中：股票投资		2,693,893,957.25	6,080,771,091.89
基金投资		-	-
债券投资		490,426,035.50	1,141,715,171.88
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		62,735,242.72	36,272,090.19
应收利息	6.4.7.5	9,015,651.27	12,224,153.27
应收股利		-	-
应收申购款		15,101,912.36	69,747,139.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,788,060,966.41	7,635,948,531.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	38,070,972.75
应付赎回款		478,954,178.69	140,852,336.56
应付管理人报酬		6,295,244.35	8,033,989.72
应付托管费		1,049,207.41	1,338,998.28
应付销售服务费		179,264.98	237,801.60
应付交易费用	6.4.7.7	8,508,397.76	6,754,516.65
应交税费		70,261.60	70,261.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,863,380.81	598,723.28
负债合计		496,919,935.60	195,957,600.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,177,280,434.63	4,949,278,284.37
未分配利润	6.4.7.10	1,113,860,596.18	2,490,712,646.44
所有者权益合计		3,291,141,030.81	7,439,990,930.81

负债和所有者权益总计		3,788,060,966.41	7,635,948,531.25
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,177,280,434.63 份，其中宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值为 1.5121 元，基金份额为 2,118,956,420.20 份；宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值为 1.4921 元，基金份额为 58,324,014.43 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈核心优势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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		2,152,200,321.97	396,951,856.51
1.利息收入		14,701,254.77	7,579,257.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,449,507.74	921,006.45
债券利息收入		13,180,923.89	6,211,040.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		70,823.14	447,210.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,691,045,332.21	294,915,853.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,627,845,402.86	285,566,899.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	48,883,963.53	1,996,403.12
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	14,315,965.82	7,352,551.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-569,042,586.94	93,361,339.18
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	15,496,321.93	1,095,406.27
减：二、费用		88,056,043.00	37,282,855.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,348,846.34	19,871,752.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,224,807.76	3,311,958.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,596,080.83	516,616.98
4. 交易费用	6.4.7.19	27,548,650.87	13,372,822.97
5. 利息支出		1,091,117.11	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,091,117.11	-
6. 其他费用	6.4.7.20	246,540.09	209,704.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号		2,064,144,278.97	359,669,001.19

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,064,144,278.97	359,669,001.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈核心优势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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	4,949,278,284.37	2,490,712,646.44	7,439,990,930.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,064,144,278.97	2,064,144,278.97
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）	-2,771,997,849.74	-1,970,926,361.61	-4,742,924,211.35
其中：1.基金申购款	4,884,400,178.04	3,340,098,336.00	8,224,498,514.04
2.基金赎回款	-7,656,398,027.78	-5,311,024,697.61	-12,967,422,725.39
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）	-	-1,470,069,967.62	-1,470,069,967.62
五、期末所有者权益（基金净值）	2,177,280,434.63	1,113,860,596.18	3,291,141,030.81
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,619,728,916.65	75,684,183.84	1,695,413,100.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	359,669,001.19	359,669,001.19
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）	1,512,031,532.29	97,611,158.31	1,609,642,690.60
其中：1.基金申购款	2,353,333,737.60	141,253,370.44	2,494,587,108.04
2.基金赎回款	-841,302,205.31	-43,642,212.13	-884,944,417.44
四、本期向基金份额持有人	-	-255,396,646.24	-255,396,646.24

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）	3,131,760,448.94	277,567,697.10	3,409,328,146.04

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：

<u>汪钦</u>	<u>胡坤</u>	<u>何瑜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈核心优势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[2009]第 5 号《关于核准宝盈核心优势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《宝盈核心优势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 776,417,611.14 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报验字(09)第 0003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 776,687,900.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 270,289.02 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《宝盈核心优势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。基金的投资组合比例为:股票资产占基金总资产的比例为 30%-80%;债券为 15%-65%,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 X65%+上证国债指数 X35%。

根据《关于宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金增加收费模式并修改基金合同的公告》,本基金自 2013 年 8 月 1 日起实施分级,在投资者申购时收取前端申购费用的,称为宝盈核心优势混合 A,不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为宝盈核心优势混合 C。

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于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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

除财务报表附注 6.4.5.2 之外, 本基金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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用第三方估值机构根据《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。

自 2015 年 3 月 27 日起, 本公司对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整, 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。2015 年 3 月 27 日, 相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.5%。

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《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，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。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	505,240,977.23
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	505,240,977.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,417,221,939.20	2,693,893,957.25	276,672,018.05

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	241,911,741.90	239,291,035.50	-2,620,706.40
	银行间市场	251,486,650.00	251,135,000.00	-351,650.00
	合计	493,398,391.90	490,426,035.50	-2,972,356.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,910,620,331.10	3,184,319,992.75	273,699,661.65

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	59,912.43
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	3,908.85
应收债券利息	8,933,943.87
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	16,555.62
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,330.50
合计	9,015,651.27

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,495,539.77
银行间市场应付交易费用	12,857.99

合计	8,508,397.76
----	--------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付赎回费	1,665,024.72
预提费用	198,356.09
合计	1,863,380.81

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈核心优势混合 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,793,114,116.67	4,793,114,116.67
本期申购	4,708,103,008.47	4,708,103,008.47
本期赎回(以“-”号填列)	-7,382,260,704.94	-7,382,260,704.94
本期末	2,118,956,420.20	2,118,956,420.20

金额单位：人民币元

宝盈核心优势混合 C		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,164,167.70	156,164,167.70
本期申购	176,297,169.57	176,297,169.57
本期赎回(以“-”号填列)	-274,137,322.84	-274,137,322.84
- 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	58,324,014.43	58,324,014.43

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈核心优势混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	947,686,408.51	1,465,442,304.36	2,413,128,712.87
本期利润	2,547,173,888.66	-556,158,717.50	1,991,015,171.16
本期基金份额交易	-884,725,701.32	-1,009,659,308.70	-1,894,385,010.02

产生的变动数			
其中：基金申购款	1,359,353,029.97	1,865,985,252.80	3,225,338,282.77
基金赎回款	-2,244,078,731.29	-2,875,644,561.50	-5,119,723,292.79
本期已分配利润	-1,424,598,592.22	-	-1,424,598,592.22
本期末	1,185,536,003.63	-100,375,721.84	1,085,160,281.79

单位：人民币元

宝盈核心优势混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,072,975.19	47,510,958.38	77,583,933.57
本期利润	86,012,977.25	-12,883,869.44	73,129,107.81
本期基金份额交易产生的变动数	-39,386,788.01	-37,154,563.58	-76,541,351.59
其中：基金申购款	46,654,054.70	68,105,998.53	114,760,053.23
基金赎回款	-86,040,842.71	-105,260,562.11	-191,301,404.82
本期已分配利润	-45,471,375.40	-	-45,471,375.40
本期末	31,227,789.03	-2,527,474.64	28,700,314.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,299,793.37
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	114,509.95
其他	35,204.42
合计	1,449,507.74

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,028,303,267.98
减：卖出股票成本总额	8,400,457,865.12
买卖股票差价收入	2,627,845,402.86

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,704,911,347.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,632,264,729.55
减：应收利息总额	23,762,654.90

买卖债券差价收入	48,883,963.53
----------	---------------

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无投资收益

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 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,315,965.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,315,965.82

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-569,042,586.94
——股票投资	-483,068,265.84
——债券投资	-85,974,321.10
——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	-569,042,586.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	12,397,133.52
转换费收入	3,099,188.41
合计	15,496,321.93

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类份额赎回费总额的 25% 归入基金资产，C 类份额所收取的赎回费全额计入基金资产；

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 A 类份额赎回费部分的 25% 归入基金资产，C 类份额所收取的赎回费全额计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	27,543,825.87
银行间市场交易费用	4,825.00
合计	27,548,650.87

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	33,184.00
银行间帐户维护费	9,000.00
上清所帐户维护费	6,000.00
合计	246,540.09

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行交易。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	49,348,846.34	19,871,752.13
其中：支付销售机构的客户维护费	8,540,744.99	940,169.54

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 1.5%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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,224,807.76	3,311,958.69

注：支付基金托管人中国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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	合计
宝盈基金管理有限公司	-	1,205,517.01	1,205,517.01
中国银行	-	-	-
合计	-	1,205,517.01	1,205,517.01
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C	合计
宝盈基金管理有限公司	-	338,479.95	338,479.95
中国银行	-	-	-
合计	-	338,479.95	338,479.95

注：1、本基金于 2013 年 8 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈核心优势混合 C”

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×1.5% / 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

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	887,600,000.00	376,946.85
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
基金合同生效日（2009 年 3 月 17 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	4,300,645.16	-
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	4,300,645.16	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2000%	-
-----------------------	---------	---

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
基金合同生效日（2009 年 3 月 17 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	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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

本基金本报告期末及上年度可比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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国银行	505,240,977.23	1,299,793.37	47,930,439.82	772,023.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间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

宝盈核心优势混合 A

金额单位：人民币元

序号	除息日	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2015 年 6 月 15 日	2.5000	322,195,520.00	289,678,506.93	611,874,026.93	
2	2015 年 6 月 2 日	0.1000	12,085,757.50	11,656,985.40	23,742,742.90	

3	2015年5月20日	0.1000	12,476,725.81	12,163,180.26	24,639,906.07	
4	2015年5月7日	0.1000	13,602,267.22	13,557,580.01	27,159,847.23	
5	2015年4月23日	0.1000	15,539,393.61	15,301,070.66	30,840,464.27	
6	2015年4月10日	0.1000	17,811,528.62	17,750,235.86	35,561,764.48	
7	2015年3月27日	0.1000	19,711,825.96	20,183,182.60	39,895,008.56	
8	2015年3月16日	0.1000	24,835,424.46	21,410,253.67	46,245,678.13	
9	2015年3月3日	0.2000	56,103,333.74	43,476,711.17	99,580,044.91	
10	2015年2月11日	0.2000	59,234,846.06	45,648,909.21	104,883,755.27	
11	2015年1月29日	0.2000	57,565,991.31	46,183,217.74	103,749,209.05	
12	2015年1月16日	0.6000	160,384,498.51	116,041,645.91	276,426,144.42	
合计		4.4000	771,547,112.80	653,051,479.42	1,424,598,592.22	

宝盈核心优势混合 C

金额单位：人民币元

序号	除息日	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2015年6月15日	2.5000	10,038,513.15	8,054,292.22	18,092,805.37	
2	2015年6月2日	0.1000	377,535.42	362,138.44	739,673.86	
3	2015年5月20日	0.1000	373,442.99	371,723.87	745,166.86	
4	2015年5月7日	0.1000	600,163.86	479,539.48	1,079,703.34	
5	2015年4月23日	0.1000	603,784.77	562,023.54	1,165,808.31	
6	2015年4月10日	0.1000	642,678.85	686,996.89	1,329,675.74	
7	2015年3月27日	0.1000	677,731.87	773,772.08	1,451,503.95	
8	2015年3月16日	0.1000	726,467.18	866,565.98	1,593,033.16	
9	2015年3月3日	0.2000	1,483,217.36	1,861,276.70	3,344,494.06	
10	2015年2月11日	0.2000	1,536,170.47	1,803,413.46	3,339,583.93	
11	2015年1月29日	0.2000	1,611,337.72	1,801,426.80	3,412,764.52	
12	2015年1月16日	0.6000	4,685,115.54	4,492,046.76	9,177,162.30	
合计		4.4000	23,356,159.18	22,115,216.22	45,471,375.40	

6.4.12 期末（2015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	
600893	中航动力	2014年 7月2 日	2015 年7月 1日	非公开 发行流 通受限	18.58	53.15	1,614,639	29,999,992.62	85,818,062.85	-	
002108	沧州明珠	2014年	-	非公开	14.38	12.39	4,436,051	37,523,775.96	54,962,671.89	2015年6	

		12 月 11 日	发行流 通受限						月 9 日权 益分派
--	--	--------------	------------	--	--	--	--	--	---------------

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
002368	太极股份	2015 年 5 月 14 日	重大事项	52.73	-	-	8,400,000	220,956,997.88	442,932,000.00	-
603898	好莱客	2015 年 6 月 15 日	重大事项	109.46	-	-	219,916	27,007,997.70	24,072,005.36	-
300188	美亚柏科	2015 年 5 月 14 日	重大事项	37.15	2015 年 8 月 21 日	33.44	235,384	7,294,975.00	8,744,515.60	-

注：本基金截至 2015 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

本基金是一只灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于保本基金和债券型基金。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按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险预算范围内追求收益最大化。

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银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	251,135,000.00	701,770,000.00
合计	251,135,000.00	701,770,000.00

注：未评级的部分均为国债和政策性金融债。

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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	37,050,798.00	90,210,000.00
AAA 以下	-	349,735,171.88
未评级	202,240,237.50	-
合计	239,291,035.50	439,945,171.88

注：未评级的部分均为国债和政策性金融债。

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%。本基金所持大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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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 2015 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	505,240,977.23	-	-	-	505,240,977.23
结算备付金	8,690,427.49	-	-	-	8,690,427.49
存出保证金	2,956,762.59	-	-	-	2,956,762.59
交易性金融资产	339,420,798.00	48,657,537.50	102,347,700.00	2,693,893,957.25	3,184,319,992.75
应收证券清算款	-	-	-	62,735,242.72	62,735,242.72
应收利息	-	-	-	9,015,651.27	9,015,651.27
应收申购款	251,527.30	-	-	14,850,385.06	15,101,912.36
资产总计	856,560,492.61	48,657,537.50	102,347,700.00	2,780,495,236.30	3,788,060,966.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	478,954,178.69	478,954,178.69
应付管理人报酬	-	-	-	6,295,244.35	6,295,244.35
应付托管费	-	-	-	1,049,207.41	1,049,207.41
应付销售服务费	-	-	-	179,264.98	179,264.98
应付交易费用	-	-	-	8,508,397.76	8,508,397.76
应交税费	-	-	-	70,261.60	70,261.60
其他负债	-	-	-	1,863,380.81	1,863,380.81
负债总计	-	-	-	496,919,935.60	496,919,935.60
利率敏感度缺口	856,560,492.61	48,657,537.50	102,347,700.00	2,283,575,300.70	3,291,141,030.81
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	281,110,040.20	-	-	-	281,110,040.20
结算备付金	12,825,904.10	-	-	-	12,825,904.10
存出保证金	1,282,939.77	-	-	-	1,282,939.77
交易性金融资产	791,980,000.00	345,675,000.00	4,060,171.88	6,080,771,091.89	7,222,486,263.77
应收证券清算款	-	-	-	36,272,090.19	36,272,090.19
应收利息	-	-	-	12,224,153.27	12,224,153.27
应收申购款	9,956,284.81	-	-	59,790,855.14	69,747,139.95
资产总计	1,097,155,168.88	345,675,000.00	4,060,171.88	6,189,058,190.49	7,635,948,531.25

负债					
应付证券清算款	-	-	-	38,070,972.75	38,070,972.75
应付赎回款	-	-	-	140,852,336.56	140,852,336.56
应付管理人报酬	-	-	-	8,033,989.72	8,033,989.72
应付托管费	-	-	-	1,338,998.28	1,338,998.28
应付销售服务费	-	-	-	237,801.60	237,801.60
应付交易费用	-	-	-	6,754,516.65	6,754,516.65
应交税费	-	-	-	70,261.60	70,261.60
其他负债	-	-	-	598,723.28	598,723.28
负债总计	-	-	-	195,957,600.44	195,957,600.44
利率敏感度缺口	1,097,155,168.88	345,675,000.00	4,060,171.88	5,993,100,590.05	7,439,990,930.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降25个基点	2,668,490.37	6,142,338.30
	市场利率上升25个基点	-2,630,931.90	-6,065,924.20

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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比例为基金总

资产的 30%-80%，债券为 15%-65%。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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,693,893,957.25	81.85	6,080,771,091.89	81.73
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	2,693,893,957.25	81.85	6,080,771,091.89	81.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	114,353,878.08	238,691,894.78
2. 沪深 300 指数下降 5%	-114,353,878.08	-238,691,894.78	

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	2,693,893,957.25	71.12
	其中：股票	2,693,893,957.25	71.12
2	固定收益投资	490,426,035.50	12.95
	其中：债券	490,426,035.50	12.95
	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	513,931,404.72	13.57
7	其他各项资产	89,809,568.94	2.37
8	合计	3,788,060,966.41	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	484,279.65	0.01
B	采矿业	78,520,000.00	2.39
C	制造业	949,239,830.48	28.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	165,421,263.84	5.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	44,790,360.00	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	74,399,032.80	2.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,266,432,728.26	38.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	69,906,457.42	2.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,700,004.80	1.36
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	2,693,893,957.25	81.85

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	002368	太极股份	8,400,000	442,932,000.00	13.46
2	600570	恒生电子	2,400,000	268,920,000.00	8.17
3	002230	科大讯飞	4,834,810	168,928,261.40	5.13
4	000791	甘肃电投	11,042,808	165,421,263.84	5.03
5	300059	东方财富	2,300,000	145,107,000.00	4.41
6	300322	硕贝德	9,205,000	135,865,800.00	4.13
7	603456	九洲药业	2,325,406	118,665,468.18	3.61
8	300006	莱美药业	2,532,698	108,652,744.20	3.30
9	002036	汉麻产业	4,073,051	86,307,950.69	2.62
10	600893	中航动力	1,614,639	85,818,062.85	2.61
11	002698	博实股份	1,545,967	81,627,057.60	2.48
12	000758	中色股份	4,000,000	78,520,000.00	2.39
13	000796	易食股份	2,999,961	74,399,032.80	2.26
14	300104	乐视网	1,409,934	72,978,183.84	2.22
15	600536	中国软件	1,681,500	59,659,620.00	1.81
16	300170	汉得信息	2,312,398	56,168,147.42	1.71
17	002108	沧州明珠	4,436,051	54,962,671.89	1.67
18	000955	欣龙控股	5,307,876	45,647,733.60	1.39
19	000056	深国商	1,524,359	45,486,872.56	1.38
20	300187	永清环保	1,147,920	44,700,004.80	1.36
21	300033	同花顺	500,000	42,995,000.00	1.31
22	002215	诺普信	2,074,099	35,778,207.75	1.09
23	002192	*ST路翔	1,036,346	31,826,185.66	0.97
24	600682	南京新百	812,000	30,474,360.00	0.93
25	000661	长春高新	215,901	28,067,130.00	0.85
26	300449	汉邦高科	261,665	26,088,000.50	0.79
27	300206	理邦仪器	782,308	25,049,502.16	0.76
28	002305	南国置业	2,999,949	24,419,584.86	0.74
29	603898	好莱客	219,916	24,072,005.36	0.73
30	300445	康斯特	200,000	20,632,000.00	0.63
31	002349	精华制药	500,000	20,540,000.00	0.62
32	300256	星星科技	848,700	19,418,256.00	0.59
33	603108	润达医疗	200,000	14,316,000.00	0.43
34	300188	美亚柏科	235,384	8,744,515.60	0.27
35	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.01
36	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.01
37	601968	宝钢包装	1,000	13,950.00	0.00

注：报告期末本基金持有的太极股份处于停牌状态（自 2015 年 5 月 14 日起开始停牌），受市场波动及基金规模变动等影响，本基金持有的太极股份占基金资产净值比例被动超过 10%。本基金管

理人将在该股票复牌后，按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

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	600536	中国软件	330,532,521.64	4.44
2	600570	恒生电子	320,428,221.43	4.31
3	000758	中色股份	207,205,979.10	2.79
4	002230	科大讯飞	204,181,463.53	2.74
5	300006	莱美药业	158,439,764.67	2.13
6	600588	用友网络	155,390,357.03	2.09
7	000796	易食股份	154,565,906.71	2.08
8	600600	青岛啤酒	141,580,515.19	1.90
9	600115	东方航空	129,493,557.66	1.74
10	600030	中信证券	123,060,032.16	1.65
11	000024	招商地产	122,619,750.79	1.65
12	002036	汉麻产业	119,516,084.15	1.61
13	600837	海通证券	113,596,091.85	1.53
14	600999	招商证券	101,263,736.58	1.36
15	300104	乐视网	101,097,989.62	1.36
16	300256	星星科技	99,229,251.19	1.33
17	601328	交通银行	91,737,615.68	1.23
18	601006	大秦铁路	86,868,081.46	1.17
19	300170	汉得信息	77,943,378.03	1.05
20	300033	同花顺	77,226,443.70	1.04

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	601318	中国平安	824,494,783.96	11.08
2	600588	用友网络	696,845,324.42	9.37

3	300288	朗玛信息	424,236,568.53	5.70
4	600536	中国软件	350,795,183.83	4.71
5	002503	搜于特	297,438,113.95	4.00
6	600104	上汽集团	284,245,075.37	3.82
7	601166	兴业银行	282,475,979.09	3.80
8	002368	太极股份	276,244,658.13	3.71
9	600050	中国联通	264,117,310.26	3.55
10	002432	九安医疗	236,270,431.47	3.18
11	300059	东方财富	228,785,176.18	3.08
12	300072	三聚环保	206,946,595.18	2.78
13	601939	建设银行	206,276,216.56	2.77
14	002230	科大讯飞	192,298,063.83	2.58
15	002736	国信证券	187,211,582.62	2.52
16	300322	硕贝德	184,074,561.55	2.47
17	600585	海螺水泥	181,620,004.10	2.44
18	000024	招商地产	162,361,652.33	2.18
19	601328	交通银行	160,072,831.02	2.15
20	600115	东方航空	157,627,974.68	2.12
21	600158	中体产业	154,448,369.96	2.08

注：1、卖出主要指二级市场上主动卖出、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	5,496,648,996.32
卖出股票收入（成交）总额	11,028,303,267.98

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	102,347,700.00	3.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	351,027,537.50	10.67
	其中：政策性金融债	351,027,537.50	10.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债	37,050,798.00	1.13
8	其他	-	-
9	合计	490,426,035.50	14.90

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	140230	14 国开 30	2,000,000	200,960,000.00	6.11
2	010107	21 国债(7)	966,000	102,347,700.00	3.11
3	018001	国开 1301	500,000	51,235,000.00	1.56
4	150211	15 国开 11	500,000	50,175,000.00	1.52
5	018002	国开 1302	448,250	48,657,537.50	1.48

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持有国债期货。

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。

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	2,956,762.59
2	应收证券清算款	62,735,242.72
3	应收股利	-
4	应收利息	9,015,651.27
5	应收申购款	15,101,912.36
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,809,568.94

7.12.4 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。

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	002368	太极股份	442,932,000.00	13.46	重大事项
2	600893	中航动力	85,818,062.85	2.61	非公开发行

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

份额级别	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
宝盈核心优势混合 A	155,310	13,643.40	335,215,996.07	15.82%	1,783,740,424.13	84.18%
宝盈核心优势混合 C	3,737	15,607.18	18,924,932.44	32.45%	39,399,081.99	67.55%
合计	159,047	13,689.54	354,140,928.51	16.27%	1,823,139,506.12	83.73%

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	宝盈核心优势混合 A	776,004.26	0.0366%
	宝盈核心优势混合 C	51,508.89	0.0883%
	合计	827,513.15	0.0380%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

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	份额级别	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	宝盈核心优势混合 A	10~50
	宝盈核心优势混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈核心优势混合 A	0~10
	宝盈核心优势混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈核心优势混合 A	宝盈核心优势混合 C
基金合同生效日（2009年3月17日）基金份额总额	776,687,900.16	-
本报告期初基金份额总额	4,793,114,116.67	156,164,167.70
本报告期基金总申购份额	4,708,103,008.47	176,297,169.57
减：本报告期基金总赎回份额	7,382,260,704.94	274,137,322.84
本报告期末基金份额总额	2,118,956,420.20	58,324,014.43

§ 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：

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重大人事变动情况如下：

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	1	3,456,693,082.37	20.93%	3,058,827.30	20.83%	-
中信证券	1	3,220,335,085.44	19.50%	2,859,197.14	19.47%	-
招商证券	1	1,948,033,517.28	11.80%	1,750,020.75	11.92%	-
安信证券	2	1,634,098,690.67	9.90%	1,446,014.56	9.85%	-
平安证券	1	1,433,398,324.44	8.68%	1,268,416.00	8.64%	-
中金公司	1	1,233,529,525.21	7.47%	1,107,085.48	7.54%	-
齐鲁证券	1	1,177,663,807.69	7.13%	1,061,067.30	7.23%	-
长城证券	1	926,132,498.94	5.61%	829,839.19	5.65%	-
海通证券	1	893,844,719.78	5.41%	790,964.21	5.39%	-
恒泰证券	1	303,896,841.82	1.84%	260,765.21	1.78%	-

东方证券	1	166,134,650.96	1.01%	147,012.90	1.00%	-
长江证券	1	119,880,923.79	0.73%	106,082.62	0.72%	-
申银万国证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	144,074,631.30	9.03%	495,000,000.00	35.48%	-	-
招商证券	275,296,879.50	17.25%	470,000,000.00	33.69%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	4,764,529.30	0.30%	-	-	-	-
中金公司	223,366,031.96	13.99%	-	-	-	-
齐鲁证券	725,806,544.39	45.47%	380,000,000.00	27.24%	-	-
长城证券	132,508,774.82	8.30%	50,000,000.00	3.58%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	90,449,339.40	5.67%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

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。

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。

2、本期本基金未租用和退租交易单元。

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旗下基金参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 8 日
2	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第二十四次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 1 月 13 日
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 21 日
4	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第二十五次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 1 月 24 日
5	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 28 日
6	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第二十六次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 2 月 9 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 证券日报	2015 年 2 月 12 日

	公告		
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年2月12日
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年2月12日
10	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第二十七次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年2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 证券日报	2015年3月3日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月6日
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 证券日报	2015年3月10日
14	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第二十八次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年3月12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 证券日报	2015年3月17日
16	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月19日
17	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月20日
18	宝盈基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月21日
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 证券日报	2015年3月24日
20	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第二十九次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年3月25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	2015年3月25日
22	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年3月28日
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	2015年4月2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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年4月3日

	公告		
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	2015 年 4 月 4 日
26	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 8 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	2015 年 4 月 8 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	2015 年 4 月 9 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	2015 年 4 月 14 日
30	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 16 日
31	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 18 日
32	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十一次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 21 日
33	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 22 日
34	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 23 日
35	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 24 日
36	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 25 日
37	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 30 日
38	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十二次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 5 日
39	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 8 日
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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 12 日

	公告		
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 证券日报	2015 年 5 月 13 日
42	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 15 日
43	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十三次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 18 日
44	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 19 日
45	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 20 日
46	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 21 日
47	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 22 日
48	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 22 日
49	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 26 日
50	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 27 日
51	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十四次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 30 日
52	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行开展的网上银行、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	2015 年 6 月 1 日
53	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 3 日
54	宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金第三十五次分红公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 10 日
55	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 11 日
56	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 12 日

	公告		
57	宝盈基金管理有限公司关于子公司中铁宝盈资产管理有限公司办公地址变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
58	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
59	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 19 日
60	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 20 日
61	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 24 日
62	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 26 日
63	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 27 日
64	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
65	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈核心优势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。

11.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

11.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，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
2015 年 8 月 27 日