

宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈祥瑞养老混合
基金主代码	000639
交易代码	000639
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 21 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,360,672,546.63 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	<p>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、股票投资策略和权证投资策略四个部分组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。</p> <p>（二）固定收益类资产投资策略</p> <p>在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式构建备选股票库。</p> <p>（四）权证投资策略</p> <p>本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，</p>

	将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。
业绩比较基准	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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	张燕
	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年 5 月 21 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	426,037,971.63	77,917,387.54
本期利润	427,468,316.95	116,061,170.92
加权平均基金份额本期利润	0.2368	0.1378
本期基金份额净值增长率	30.12%	14.24%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3305	0.0152
期末基金资产净值	3,252,645,417.42	913,272,614.53
期末基金份额净值	1.378	1.059

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

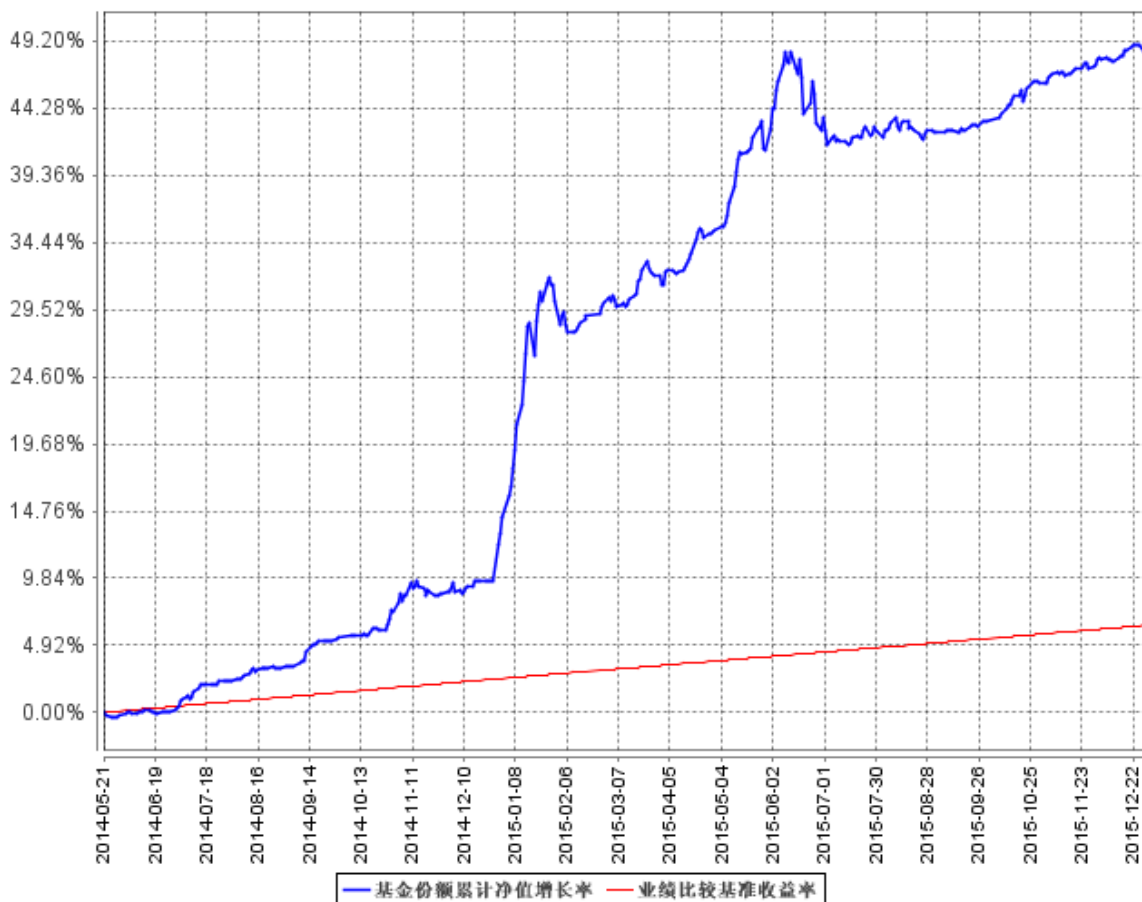
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.69%	0.16%	0.95%	0.01%	2.74%	0.15%
过去六个月	3.53%	0.19%	1.91%	0.01%	1.62%	0.18%
过去一年	30.12%	0.48%	3.82%	0.01%	26.30%	0.47%
自基金合同生效起至今	48.65%	0.42%	6.41%	0.01%	42.24%	0.41%

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

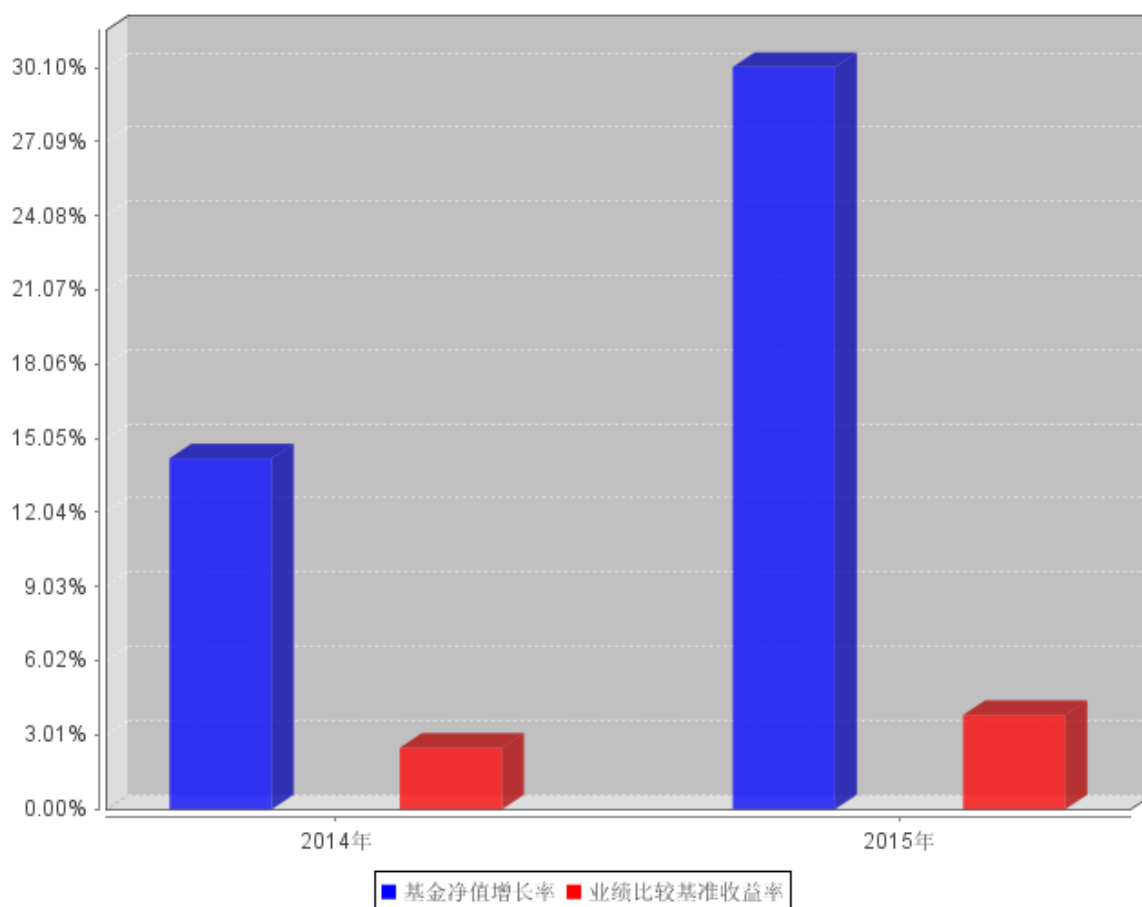
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	0.8000	47,928,094.95	19,546,812.68	67,474,907.63	
合计	0.8000	47,928,094.95	19,546,812.68	67,474,907.63	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地

在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票二十一只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2014 年 5 月 21 日	-	12 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。
于启明	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理	2014 年 5 月 21 日	2015 年 6 月 13 日	8 年	于启明先生，经济学学士。2007 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，历任投研秘书（集中交易员）及债券组合研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理均为首任基金经理，“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

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 12 月 31 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，宏观经济走势整体持续低迷，各项经济增长指标和通货膨胀继续下行。为缓解经济增长压力，报告期内，央行持续加大货币政策宽松力度，多次降准降息，并通过 MLF、SLF 等方式向市场注入流动性，于此同时，包括减税、加大基础设施建设力度在内的财政刺激政策也接连推出，但上述政策措施整体成效有限。

报告期内，受益于经济下行和货币政策持续宽松，债券收益率整体继续大幅下行，代表性品种 10 年政策性金融债收益率下行幅度达到 96bp 左右，1 年 AAA 信用债收益率下行幅度达到 185bp 左右，5 年 AAA 信用债收益率下行幅度达到 154bp 左右，短端收益率下行幅度超过长端收益率，收益率曲线结构趋于陡峭化。报告期内，我们整体保持较高的债券组合仓位和债券久期，并积极参与中长期利率债和中高评级信用债的一二级价差交易，到年末，随着市场收益率逐步接近历史底部水平，而资金利率却难以明显下行，我们适当减持部分期限较长的信用债和利率债，增加部分期限较短的信用债配置。

报告期内，权益市场方面，6 月份前，市场情绪高涨，入市资金充沛，指数节节攀升，上证指数最高触及 5178 点，个股涨幅巨大。但 6 月末，随着资金面的紧张和去杠杆的进行，权益市场出现了大幅波动，指数回撤较大，市场由暖转冷。一级市场从年初到年末，都维持了较高的超额收益，新股破发现象难觅，配售率随着参与机构的增加也开始逐渐下降。报告期内，我们在上半年保持较高的权益仓位，权益市场的上涨对净值的增长贡献较大，下半年，随着基本面因素出现恶化，我们减持了部分权益仓位，有效的控制了净值回撤。全年，我们均积极参与股票的一级市场投资，在新股超额收益的带动下，对净值表现起到了有力的支撑作用。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是 30.12%，同期业绩比较基准收益率是 3.82%。

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，我们认为宏观经济依然难有明显改观，但受益于前期刺激措施以及房地产市场逐步回暖，经济增速继续大幅下行空间不大。由于经济增长基础依然不牢靠，预计货币政策整体仍将延续宽松基调，但汇率因素可能会制约货币政策的宽松力度。此外，2016 年，预计加快

信贷投放、基础设施建设等相关经济刺激措施仍将进一步推出。

货币市场方面，在政策整体宽松基调下，预计市场资金面仍将较为充裕，但人民币贬值可能加快及其预期强化，以及信贷投放加速，可能会在阶段性增加市场资金面扰动，2016 年市场资金面宽松程度或低于 2015 年。债券市场方面，2015 年末市场收益率大幅下行，一定程度上透支未来经济和政策预期，未来如果资金利率无法大幅回落，或宽松政策力度超出预期，市场收益率将缺乏明显下行空间。2016 年，我们将密切跟踪人民币汇率、资金利率、政策和经济预期变化情况，在保持组合良好流动性基础上，择优参与债券波段操作。

权益市场方面，市场估值体系呈现两极分化，成长股普遍估值较高，价值股估值处于合理区间，市场人气较低迷。汇率的变化成为影响 2016 年权益市场的新变量。2016 年，我们将密切跟踪政策和经济基本面的变化情况，结合资金利率等因素，在一级市场，坚持积极参与股票和可转债的投资，在二级市场，总体持更加谨慎的态度，我们将在控制净值回撤风险的前提下，选择具有较高安全边际和估值优势的品种适时参与。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本基金 2015 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2016)第 22192 号“标准无保留意见的审计报告”，投

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,394,872.71	4,108,895.69
结算备付金	17,699,151.94	11,244,193.28
存出保证金	829,266.78	738,716.63
交易性金融资产	3,247,892,995.49	846,872,337.63
其中：股票投资	408,758,934.16	152,160,851.23
基金投资	-	-
债券投资	2,839,134,061.33	694,711,486.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	743,801,755.70	346,281,319.42
应收证券清算款	105,515,233.15	968,933.31
应收利息	32,058,704.87	17,191,194.74
应收股利	-	-
应收申购款	578,561.80	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,149,770,542.44	1,227,405,590.70
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	870,000,000.00	311,999,859.80
应付证券清算款	21,892,453.06	-
应付赎回款	351,471.02	137,006.30
应付管理人报酬	2,864,886.53	701,579.44
应付托管费	572,977.30	140,315.90

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,150,532.80	958,164.75
应交税费	-	-
应付利息	92,011.55	135,888.75
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,792.76	60,161.23
负债合计	897,125,125.02	314,132,976.17
所有者权益：		
实收基金	2,360,672,546.63	862,521,388.63
未分配利润	891,972,870.79	50,751,225.90
所有者权益合计	3,252,645,417.42	913,272,614.53
负债和所有者权益总计	4,149,770,542.44	1,227,405,590.70

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.378 元，基金份额总额

2,360,672,546.63 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 5 月 21 日(基金合 同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	482,425,647.10	133,120,990.15
1. 利息收入	97,692,312.03	22,944,701.45
其中：存款利息收入	1,521,832.58	476,817.35
债券利息收入	91,017,635.31	19,041,409.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,152,844.14	3,426,474.68
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	373,961,961.67	71,332,778.38
其中：股票投资收益	371,301,103.60	47,696,877.61
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-124,421.45	23,465,818.25
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,785,279.52	170,082.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填	1,430,345.32	38,143,783.38

列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	9,341,028.08	699,726.94
减: 二、费用	54,957,330.15	17,059,819.23
1. 管理人报酬	23,365,138.41	5,374,403.28
2. 托管费	4,673,027.71	1,074,880.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,825,694.81	2,867,998.47
5. 利息支出	14,690,053.49	7,543,805.97
其中: 卖出回购金融资产支出	14,690,053.49	7,543,805.97
6. 其他费用	403,415.73	198,730.77
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	427,468,316.95	116,061,170.92
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	427,468,316.95	116,061,170.92

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	862,521,388.63	50,751,225.90	913,272,614.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	427,468,316.95	427,468,316.95
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)	1,498,151,158.00	413,753,327.94	1,911,904,485.94
其中: 1. 基金申购款	3,591,013,525.64	1,008,431,839.79	4,599,445,365.43
2. 基金赎回款	-2,092,862,367.64	-594,678,511.85	-2,687,540,879.49
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）	2,360,672,546.63	891,972,870.79	3,252,645,417.42
项目	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	950,024,158.14	-	950,024,158.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	116,061,170.92	116,061,170.92
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）	-87,502,769.51	2,164,962.61	-85,337,806.90
其中：1. 基金申购款	165,759,160.06	13,760,452.87	179,519,612.93
2. 基金赎回款	-253,261,929.57	-11,595,490.26	-264,857,419.83
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）	-	-67,474,907.63	-67,474,907.63
五、期末所有者权益（基金净值）	862,521,388.63	50,751,225.90	913,272,614.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

汪钦

胡坤

何瑜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

宝盈祥瑞养老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[2014]第435号《关于核准宝盈祥瑞养老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《宝盈祥瑞养老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949,880,773.02元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第262号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,

《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 950,024,158.14 份基金份额，其中认购资金利息折合 143,385.12 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产占基金总资产的比例为 0%-40%；债券、货币市场工具、现金以及其他资产的比例合计不低于基金资产的 60%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%。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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

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

数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司(以下简称“宝盈基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,365,138.41	5,374,403.28
其中：支付销售机构的客户维护费	704,732.79	18,787.82

注：支付基金管理人宝盈基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,673,027.71	1,074,880.74

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31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
招商银行	29,630,702.05	234,078,294.29	-	-	8,895,520,000.00	1,840,807.34
上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年12月31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
招商银行	52,101,526.03	42,181,755.07	-	-	-	-

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
基金合同生效日（ 2014年5月21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	8,216,105.18	-
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	8,216,105.18	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.3500%	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2. 基金管理人宝盈基金公司在本年度转换转入本基金的交易委托第一创业证券办理，无手续费。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至 2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,394,872.71	1,260,268.99	4,108,895.69	363,246.72

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 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
002778	高科石化	2015 年 12 月 28 日	2016 年 1 月 6 日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.10.1.2 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
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 23 日	2016 年 1 月 8 日	新债流通受限	99.99	99.99	6,520	651,957.13	651,957.13	-

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本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 870,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 7 日前先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 408,711,334.16 元，属于第二层次的余额为 2,839,181,661.33 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 525,788,337.63 元，第二层次 321,084,000.00，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 27 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	408,758,934.16	9.85
	其中：股票	408,758,934.16	9.85
2	固定收益投资	2,839,134,061.33	68.42
	其中：债券	2,839,134,061.33	68.42
	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	743,801,755.70	17.92
	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	19,094,024.65	0.46
7	其他各项资产	138,981,766.60	3.35
8	合计	4,149,770,542.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,420,000.00	0.20
C	制造业	96,768,722.72	2.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,571,551.95	0.05
F	批发和零售业	79,165,865.28	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	28,459,672.71	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,588,208.18	0.08
J	金融业	138,644,490.42	4.26

K	房地产业	54,048,306.29	1.66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	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	982,724.40	0.03
S	综合	-	-
	合计	408,758,934.16	12.57

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601998	中信银行	10,000,000	72,200,000.00	2.22
2	000042	中洲控股	1,999,919	41,818,306.29	1.29
3	000418	小天鹅A	1,258,146	30,195,504.00	0.93
4	002727	一心堂	500,000	28,915,000.00	0.89
5	600755	厦门国贸	3,054,697	28,469,776.04	0.88
6	600004	白云机场	1,999,977	28,459,672.71	0.87
7	601628	中国人寿	999,982	28,309,490.42	0.87
8	002126	银轮股份	1,500,000	27,675,000.00	0.85
9	601336	新华保险	500,000	26,105,000.00	0.80
10	600998	九州通	1,099,938	21,558,784.80	0.66

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司 <http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	302,129,396.65	33.08
2	601766	中国中车	211,425,131.89	23.15
3	601299	中国北车	196,157,317.79	21.48
4	000822	山东海化	161,962,551.44	17.73
5	601818	光大银行	159,098,673.00	17.42
6	601699	潞安环能	106,224,401.19	11.63
7	600348	阳泉煤业	103,725,896.81	11.36
8	002521	齐峰新材	100,372,435.33	10.99
9	601998	中信银行	96,513,798.98	10.57
10	300431	暴风科技	88,910,802.55	9.74
11	002128	露天煤业	88,820,007.52	9.73
12	002078	太阳纸业	86,394,918.32	9.46
13	600031	三一重工	80,962,177.44	8.87
14	600585	海螺水泥	79,143,959.30	8.67
15	601169	北京银行	75,864,525.79	8.31
16	600675	中华企业	75,694,411.24	8.29
17	601088	中国神华	72,479,871.82	7.94
18	600694	大商股份	68,364,086.70	7.49
19	601166	兴业银行	67,362,032.80	7.38
20	600123	兰花科创	67,037,615.21	7.34
21	601898	中煤能源	66,190,647.38	7.25
22	600096	云天化	65,519,951.61	7.17
23	601988	中国银行	62,753,316.64	6.87
24	600970	中材国际	62,646,091.99	6.86
25	002234	民和股份	61,654,254.38	6.75
26	000042	中洲控股	60,883,290.90	6.67
27	600028	中国石化	60,324,840.00	6.61
28	600755	厦门国贸	59,158,103.26	6.48
29	600000	浦发银行	53,011,150.56	5.80
30	601857	中国石油	52,831,544.47	5.78
31	600720	祁连山	50,447,505.23	5.52
32	600841	上柴股份	49,573,087.28	5.43
33	601628	中国人寿	48,767,736.57	5.34
34	601336	新华保险	46,844,802.41	5.13

35	002557	洽洽食品	42,515,396.42	4.66
36	002458	益生股份	38,595,144.91	4.23
37	601009	南京银行	37,340,684.85	4.09
38	600376	首开股份	31,972,122.43	3.50
39	600823	世茂股份	30,511,518.61	3.34
40	000418	小天鹅 A	29,906,659.56	3.27
41	600004	白云机场	28,590,685.07	3.13
42	002126	银轮股份	27,967,545.18	3.06
43	600073	上海梅林	27,229,751.49	2.98
44	002727	一心堂	24,195,783.00	2.65
45	002134	天津普林	23,293,414.16	2.55
46	600837	海通证券	22,824,130.71	2.50
47	600998	九州通	21,931,685.72	2.40
48	601211	国泰君安	21,612,271.50	2.37
49	600809	山西汾酒	19,348,767.19	2.12

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	291,909,501.50	31.96
2	601766	中国中车	186,773,560.65	20.45
3	601299	中国北车	172,686,941.65	18.91
4	002736	国信证券	165,695,255.35	18.14
5	000822	山东海化	161,596,634.29	17.69
6	601818	光大银行	147,638,908.81	16.17
7	300431	暴风科技	140,637,910.35	15.40
8	601699	潞安环能	115,064,914.51	12.60
9	002521	齐峰新材	113,394,541.59	12.42
10	600348	阳泉煤业	109,136,603.98	11.95
11	002078	太阳纸业	106,775,022.18	11.69
12	600028	中国石化	96,654,218.85	10.58
13	600970	中材国际	96,597,905.62	10.58
14	002128	露天煤业	92,040,593.37	10.08
15	002234	民和股份	81,768,496.99	8.95

16	600585	海螺水泥	81,413,657.60	8.91
17	600031	三一重工	79,096,053.09	8.66
18	600675	中华企业	72,588,326.53	7.95
19	600096	云天化	70,359,087.12	7.70
20	600123	兰花科创	70,213,151.99	7.69
21	601166	兴业银行	68,050,143.63	7.45
22	601169	北京银行	67,707,789.01	7.41
23	600694	大商股份	66,730,025.23	7.31
24	601088	中国神华	65,525,482.61	7.17
25	601898	中煤能源	60,201,807.98	6.59
26	600000	浦发银行	57,600,802.40	6.31
27	601988	中国银行	55,373,664.67	6.06
28	601857	中国石油	53,537,446.75	5.86
29	002557	洽洽食品	53,145,625.41	5.82
30	600841	上柴股份	52,321,242.05	5.73
31	600720	祁连山	46,856,800.23	5.13
32	601009	南京银行	38,650,336.75	4.23
33	600755	厦门国贸	35,179,168.50	3.85
34	002458	益生股份	33,761,239.19	3.70
35	000042	中洲控股	32,375,678.84	3.55
36	600958	东方证券	31,844,934.20	3.49
37	600073	上海梅林	27,920,551.10	3.06
38	600376	首开股份	27,723,225.22	3.04
39	002134	天津普林	25,754,248.44	2.82
40	601985	中国核电	24,796,066.00	2.72
41	600837	海通证券	22,413,267.90	2.45
42	601211	国泰君安	20,879,581.00	2.29
43	600185	格力地产	20,261,978.64	2.22
44	601998	中信银行	19,320,259.00	2.12
45	002740	爱迪尔	19,212,712.00	2.10
46	600823	世茂股份	18,823,485.98	2.06

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,809,631,695.86
卖出股票收入（成交）总额	3,908,555,396.05

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	750,996,148.00	23.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	230,990,956.20	7.10
5	企业短期融资券	661,908,000.00	20.35
6	中期票据	1,144,982,000.00	35.20
7	可转债（可交换债）	651,957.13	0.02
8	同业存单	49,605,000.00	1.53
9	其他	-	-
10	合计	2,839,134,061.33	87.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019527	15 国债 27	3,200,000	320,256,000.00	9.85
2	019522	15 国债 22	1,900,000	191,957,000.00	5.90
3	1382180	13 中金集 MTN1	1,500,000	151,500,000.00	4.66
4	020080	15 贴债 06	1,200,000	118,092,000.00	3.63
5	1282290	12 船重 MTN2	1,000,000	102,690,000.00	3.16

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内，本基金投资的前十名证券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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	829,266.78
2	应收证券清算款	105,515,233.15
3	应收股利	-
4	应收利息	32,058,704.87
5	应收申购款	578,561.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,981,766.60

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,760	495,939.61	2,198,183,213.05	93.12%	162,489,333.58	6.88%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,107,167.52	0.0893%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年5月21日）基金份额总额	950,024,158.14
本报告期期初基金份额总额	862,521,388.63
本报告期基金总申购份额	3,591,013,525.64
减：本报告期基金总赎回份额	2,092,862,367.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,360,672,546.63

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2015 年 3 月 21 日，本基金管理人发布关于董事长（法定代表人）变更的公告，李文众先生任宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人），李文众先生基金行业任职资格核准文号为：证监许可（2015）409 号。李建生女士退休，不再担任董事长（法定代表人）职务。截止至报告期末，基金管理人已完成办理法定代表人工商变更登记等相关手续。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 100,000 元，目前事务所已连续 2 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券		13,147,477,318.05	41.17%	2,781,234.67	41.03%	-
光大证券		21,705,669,915.52	22.31%	1,529,402.38	22.56%	-
华创证券		11,691,023,871.35	22.12%	1,496,388.21	22.07%	-

中银国际	1	643,753,321.25	8.42%	563,584.92	8.31%	-
中信证券	1	331,535,828.15	4.34%	294,344.06	4.34%	-
招商证券	1	125,292,131.99	1.64%	114,178.73	1.68%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

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

2、席位变更情况

(1) 租用交易单元情况

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

(2) 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
兴业证券	151,704,547.90	11.48%	9,584,100,000.00	45.39%	-	-
光大证券	1,169,400,742.05	88.52%	11,494,500,000.00	54.43%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	38,000,000.00	0.18%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司
2016年3月26日