

鸿阳证券投资基金 2016年第2季度报告

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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈鸿阳封闭
场内简称	基金鸿阳
基金主代码	184728
交易代码	184728
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001 年 12 月 10 日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00 份
投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良而稳定的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险，在保持基金资产良好的流动性的基础上，实现基金资产的稳定增长，为基金持有人谋求长期最佳利益。
投资策略	本基金股票投资包括两部分：一部分为成长型投资，另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整，但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的 30%，最高均不得高于股票投资总额的 70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则，在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合，分散和降低投资风险，确保基金资产安全，谋求基金长期稳定的收益。
业绩比较基准	无。

风险收益特征	风险水平和期望收益适中。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年4月1日—2016年6月30日）
1. 本期已实现收益	47,012,993.36
2. 本期利润	-8,416,962.19
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0042
4. 期末基金资产净值	2,147,510,432.02
5. 期末基金份额净值	1.0738

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、上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。

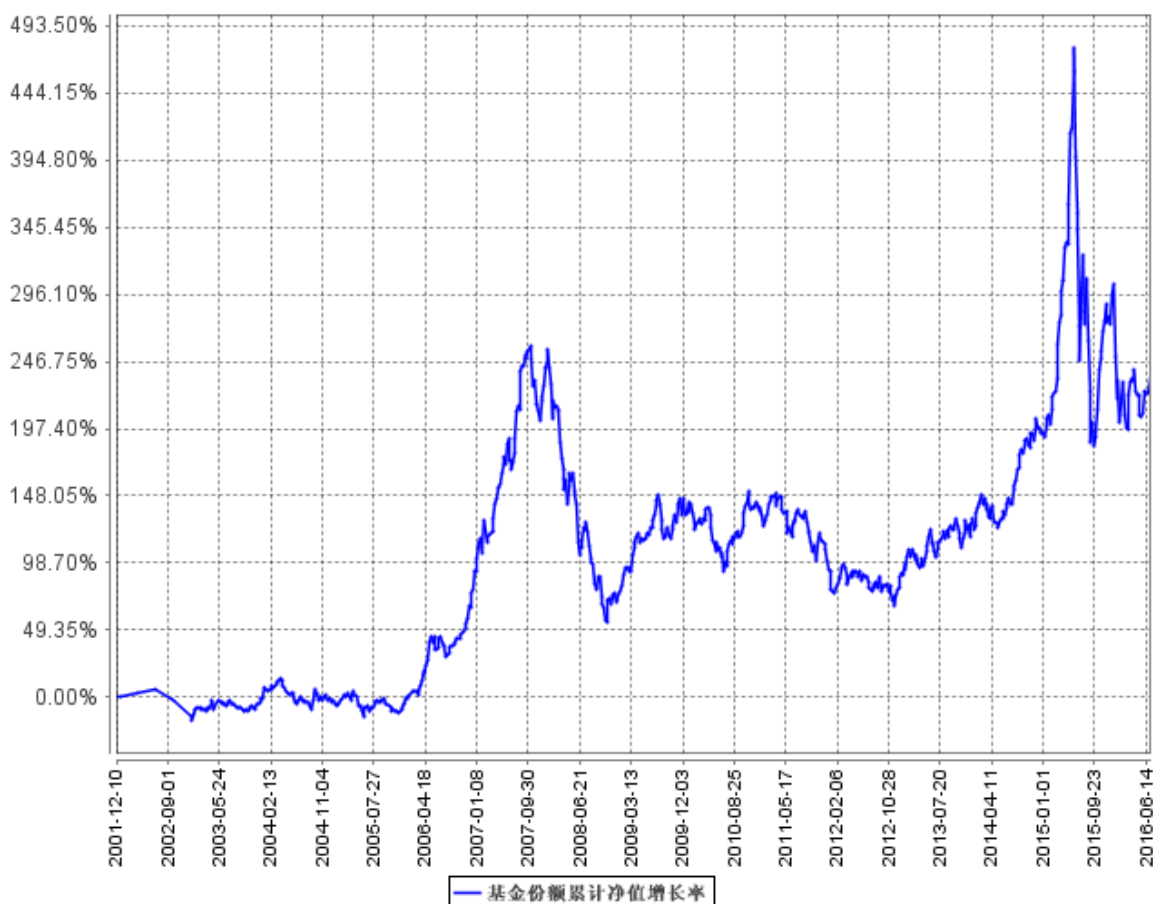
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.03%	2.67%	-	-	-	-

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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨凯	本基金基金经理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈互联网沪港深灵活配置混合	2013年2月5日	-	12年	杨凯先生，中山大学岭南学院工商管理硕士。2003年7月至今在宝盈基金管理有限公司工作，先后担任产品设计师、市场部总监，特定客户资产管理部投资经理、

	型证券投资基金基金经理、副总经理			总监，研究部总监，总经理助理等职务。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	------------------	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年国内宏观经济增长维持在低位，通货膨胀稳中向下，地产、商品市场等价格上涨幅度加大，在这些因素的制约下，利率进一步大幅下降的空间有限。但目前的物价回升趋势也不足以引发货币政策收紧，总体而言流动性环境偏充裕。

2016 年上半年 A 股市场继续大幅波动，“熔断机制”加剧了市场的波动。但随着投资者信心的恢复和相对充裕的流动性，市场见底企稳，保持震荡格局。截止到 2016 年 6 月 30 日上证指数较 2015 年年底下跌 17.22%。

二季度开始，市场信心逐步恢复，流动性相对充裕。且美国流动性收缩的进度低于市场预

期，对后市我们相对乐观。我们仍然坚持自下而上的选股方法，保持了较高的仓位，重点投资了 TMT、环保、大消费、化工等行业；在主题上布局了云计算、核电、通航、半导体以及主业稳健且大概率有望在新兴产业转型成功的品种。

4.5 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 0.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,684,911,092.93	78.04
	其中：股票	1,684,911,092.93	78.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	432,240,332.40	20.02
	其中：债券	432,240,332.40	20.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,695,830.74	1.70
8	其他资产	5,073,539.84	0.24
9	合计	2,158,920,795.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	966,708,206.77	45.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,494,604.36	0.26
E	建筑业	185,525,795.02	8.64

F	批发和零售业	20,315,844.84	0.95
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	224,152,676.57	10.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	90,433,542.67	4.21
L	租赁和商务服务业	45,880,950.00	2.14
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	56,313,540.00	2.62
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	90,065,806.60	4.19
	合计	1,684,911,092.93	78.46

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002482	广田集团	21,968,305	166,519,751.90	7.75
2	002368	太极股份	3,550,881	126,162,801.93	5.87
3	002019	亿帆鑫富	6,682,300	102,773,774.00	4.79
4	002097	山河智能	9,920,309	102,079,979.61	4.75
5	300378	鼎捷软件	3,224,241	92,600,201.52	4.31
6	600260	凯乐科技	5,449,935	89,160,936.60	4.15
7	300396	迪瑞医疗	2,048,100	88,232,148.00	4.11
8	300090	盛运环保	10,749,782	86,965,736.38	4.05
9	002698	博实股份	4,000,000	77,040,000.00	3.59
10	002366	台海核电	1,277,926	68,126,235.06	3.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	432,240,332.40	20.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	432,240,332.40	20.13

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010303	03 国债(3)	2,937,450	304,231,696.50	14.17
2	010107	21 国债(7)	1,054,710	113,993,056.80	5.31
3	010213	02 国债(13)	139,890	14,015,579.10	0.65

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	565,158.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,021,637.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	486,743.58
8	其他	-
9	合计	5,073,539.84

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.25

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

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。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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳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。

8.2 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：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

8.3 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 7 月 20 日