

宝盈资源优选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	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	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	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	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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的真实、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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	38
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39

§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈资源优选混合型证券投资基金
基金简称	宝盈资源优选混合
基金主代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月15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	2,756,550,553.46份
基金合同存续期	不定期

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，处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值，相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型，优选各个行业中具有资源优势的上市公司，建立股票池。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>本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合，并注重资产在各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。</p> <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>本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。</p> <p>在个股选择层面，本基金以净资产收益率、预期 PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。</p> <p>3、债券及短期金融工具投资策略</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、收益率曲线预测、相对价值评估、收</p>

	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。 4、权证投资策略 本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区福华一路 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	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	-373,182,545.30

本期利润	-1,387,162,307.84
加权平均基金份额本期利润	-0.4319
本期加权平均净值利润率	-25.72%
本期基金份额净值增长率	-16.47%
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	-303,429,756.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1101
期末基金资产净值	5,038,336,684.26
期末基金份额净值	1.8278
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	158.90%

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

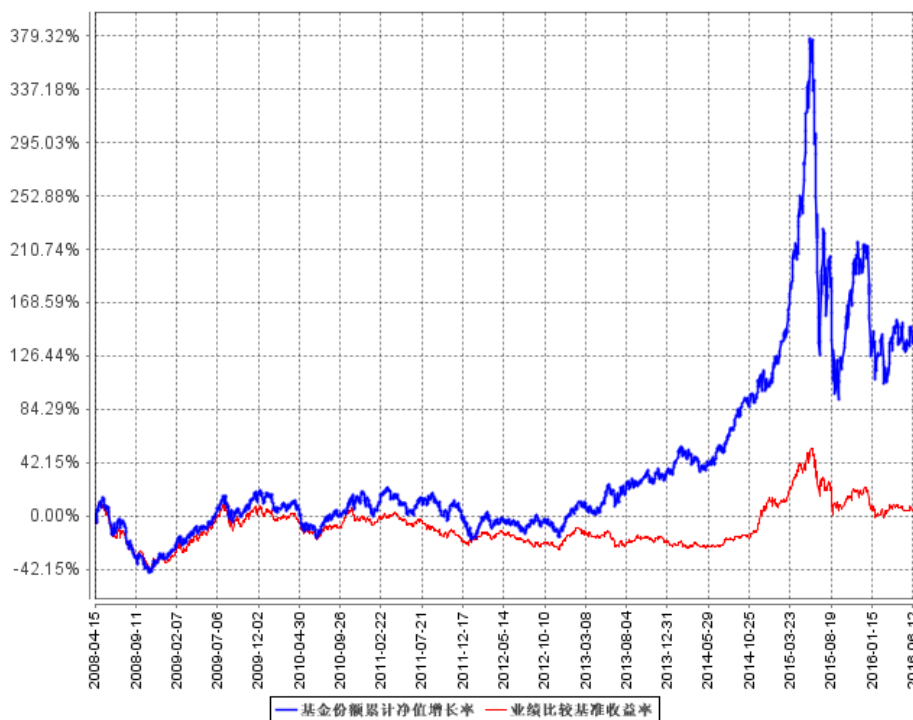
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	6.06%	1.55%	-0.28%	0.74%	6.34%	0.81%
过去三个月	7.08%	1.73%	-1.28%	0.76%	8.36%	0.97%
过去六个月	-16.47%	2.71%	-11.05%	1.38%	-5.42%	1.33%
过去一年	-23.56%	3.38%	-21.06%	1.73%	-2.50%	1.65%
过去三年	133.81%	2.38%	38.63%	1.38%	95.18%	1.00%
自基金合同生效起至今	158.90%	1.97%	6.50%	1.39%	152.40%	0.58%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数×75%+上证国债指数×25%

3.2.2 自基金转型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		
彭敢	本基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；总经理助理；投资部总监	2010 年 11 月 5 日	-	15 年	彭敢先生，金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010 年 9 月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2015 年 1 月 30 日	2016 年 3 月 26 日	5 年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。历任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员，2014 年 11 月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、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 2016 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

2016年上半年股票市场走势单边下跌，上证指数跌幅17.22%、沪深300跌幅15.47%、深成指跌幅17.17%，同期，创业板指数跌幅17.92%，中小板指数跌幅为17.88%；整体来看市场表现差异不大，深市比沪市相对调整较多。

本基金管理人认为，政府多次强调经济转型是当前我国必然之路，从政策效果来说虽然短期没有能体现经济结构明显改观，同时反腐在深入人心，某种程度上短期对经济及职能效率有一定程度影响，但长期来看，出清腐败、加强监管、巩固执政理念，有利于更强有力的改革措施出台，减少改革阻力。目前来看，实体经济增速放缓趋势依然严峻，GDP增速在持续下滑调整过程中，政府需要通过各种货币政策工具来降低实体经济利率，给企业减压输血，同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级；从整体来看，政府依然能有决心实现稳步的经济增长，同时也全面支持发展新兴产业，无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展，都能体现国家对经济结构转型升级的决心。

从改革开放三十多年的经济发展历程来看，不要去质疑政府对发展经济作为第一要务的决心，也不要轻易判断经济会断崖式下跌或者硬着陆等，我们需要积极的去适应当前经济转型的新常态，需要有耐心的寻找产业转型新的方向和政府职能转变后新的机遇，总之，我们处在激烈变革的新时代，必然伴随着社会行为及市场主体发生着相应的波动行为，我们相信当前的一切痛苦可以是一个深度的自然净化过程，我们需要的是一种坚持的信念。同时，本基金管理人二季度梳理了一线城市和准一线城市的经济结构和人才结构，整体来说这梯度的城市代表着中国未来的经济

转型希望，也是上市公司最集中的区域，已经不少公司逐渐借助资本的力量逐渐成为全国 500 强企业或者行业龙头，研发投入占收入比重越来越大，也有一种新的现象就是不少国内上市公司加大走出去力度，未来将会有更多的公司出海，这也是经济转型的一大契机。

回顾市场，一季度整体市场由于熔断频出，出现了恐慌性调整，后面二季度整体来说颇为平淡，也是难得出现一个季度的盘整态势，总体来说，市场经历了一季度下跌后，风险充分释放，参与者逐渐情绪企稳，虽然未能观察到明显的资金进场，但也未发现资金加速离场现象，市场在漫长的企稳过程中已经度过一个季度。本报告期主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、体育、新能源汽车、泛娱乐等方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.8278 元。本基金在本报告期内净值增长率是 -16.47%，同期业绩比较基准收益率是 -11.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

正如我们之前强调过，2016 年中国的宏观经济仍然处于持续触底的过程，尽管政府出台了多项改革和稳增长的财政和货币政策，但经济增长的固有规律在发挥作用，过剩产能以及前期大量的房地产和固定资产投资仍然成为经济的主要风险。而油价的大幅下跌虽然短期有利于中国经济成本降低，但是否会带来输入性通缩，并与产能过剩带来的内在的经济通缩叠加，对企业经营已经构成了下行压力，目前来看国家在稳定经济增长方面信心十足，及时的提出供给侧改革让我们更坚定的看好本届政府对经济转型的决心。

从我们分析来看，A 股经历了三年的牛市上升通道，主要核心逻辑主要在如下几点：（1）中国的经济结构正在发生近 30 年来前所未有的变化，新技术、新商业模式的企业三年来加速呈现在市场中；（2）2013 年后中国的货币政策基本处于宽松的氛围中，流动性宽裕、政策面宽松；（3）政府对党政机关及国企反腐态势蔓延，民众对改革转型预期较强，市场也给予了较高的改革估值溢价；（4）传统的民营上市企业在经济转型中走在时代前列，在注册制没有放开的过去三年，通过兼并整合等资本运作方式给市场带来了不少新板块、新龙头和大量投资热点，市场参与热情高涨，新增资金入市积极。在我们看来，这三年 A 股市场演绎着这个时代的转型特征，中国需要新经济、政府需要新增长，虽然市场制度在进行循序渐进的改革尝试，但是新一代的企业家和主动迎合时代发展趋势的企业家正在成为市场新的主力龙头，互联网金融、数字营销、新媒体、机器人等都从市场追逐概念变成了较为成熟的板块，带来了巨大的财富效应和社会效应；我们坚信一个大时代的变迁不会是短短三年能完成变迁的，从国外发达经济体的转型之路来看也是一个较为

长期充满波折的长期过程，在过去的 2015 年经历了波澜壮阔的涨跌行情，从另一种角度也可以体现为大变革时代的一种显著特征。

我们认为中国资本市场不管是过去、现在还是未来的走势均是对中国经济前景和改革信心的反应。从目前宏观经济数据和改革管理措施来看，看不到改善的迹象，各种改革措施总体来说也是雷声大雨点小，资本市场的大环境难言乐观。但从另一方面来看，中国经济的韧性和中国企业家的创新精神和奋斗意识在全球横向比较中仍然有一定的优势，中国经济的前景也无需过于担心。

因此，二季度是今年经历熔断以来难得市场情绪企稳的一个阶段，虽然我们依然认为市场在熊市通道中。投资者信心的恢复依然需要时间，而市场重新走出趋势性的上涨行情需要更多的宏观经济数据的变化和政府改革措施的落实实施，并给投资者带来信心。但从目前来看，市场的悲观因素反应较为充分，而市场积极的因素在累积，如 G20 会议带来的全球宏观政策的协调、美联储加息政策的变化、国家以供给侧改革为核心的国有企业改革措施的落实等等。所以在目前阶段，虽然市场信心较弱，但在经历多次下跌后，市场目前所处的位置具有较好的风险收益比。考虑到目前市场与历史估值比较相对偏低的位置，三季度可能存在一轮趋势性上涨的机会。投资的热点可能集中在周期性板块反弹机会、国企改革带来的国企控股优质公司的变革，成长股方面，新能源汽车板块、储能、体育传媒等新兴消费服务业、以云计算大数据为核心的科技产业、以 VR 等技术变革为中心的新技术产业可能会有持续的盈利机会。

从价值投资的角度来看，我们必须承认目前这个阶段自下而上选股可投资的股票越来越多，有相当一部分股票进入合理乃至极有价值的投资区间。虽然我们认为市场未来仍有调整空间，但市场分化也将产生，我们相信，部分优质公司的选择仍能提供较好的获利机会，我们坚信在市场情绪低点买入好公司并长期持有终究会赢得不错的投资收益。

从 2016 年全年来看，今年中国资本市场新变革的起点，深港通等都可能要一一落地，新的 2016 年是变革之年，也是经历了 2015 年 A 股市场大震荡后市场重建的一年。我们认为新的一年需要去耐心观察新机制推出后产生新的变化、也需要主动适应新的变化、更需要积极寻找新的机遇，可以判断的是经历了三年上期上涨趋势后，2016 年不大会出现 2015 年上半年高收益的基础，也不能排除 2015 年三季度暴跌动荡的可能性，但个人认为市场企稳后结构性行情依然存在，我们需要在新的 2016 年降低投资收益的预期，但也需要充分寻找新的投资机会，为持有人获取较好的投资回报。

当然我们也需要看到目前市场的一些主要风险因素，正如我们前面已经提到的：1、投资者的对经济企稳和政治体系稳定的信心；2、货币政策与汇率稳定的关系；3、资本市场改革进度和措施低于预期及市场适应新制度的能力；4、“互联网+”创新显著低于预期；5、楼市及部分固定资

产快速泡沫化后的消化能力。

基金管理人秉承几个最基本的投资理念：1、投资不可能赚到所有的钱，投资要赚自己所理解和能把握的钱。投资收益有两类钱，一类是市场博弈赚趋势交易的钱，我的收益即是他人的亏损。在这个充分竞争的市场机会本基金管理人不可能持久赚到博弈的钱；2、第二类投资收益是赚公司成长的钱。优质的成长股不管在何种市场风口，最后必然超越市场涨幅，在无法判别市场风向的市场，挑选最强健的猪。尤其是成长空间巨大的公司，要有充分的耐心，这是本基金管理人的目标收益；3、中国的经济已经进入必须转型的阶段，中国经济的核心不可能是靠地产和传统国企来支撑。变革和转型创新是中国经济更重要的部分。而目前传统产业在中国股票市场中的市值比率并不低，这类企业无论是从静态还是动态估值跟国际对比偏贵、从管理水平和制度结构来说跟跨国公司对比也差距巨大。

本基金将继续重点以个股投资价值判断为主，继续采取自下而上的投资策略。基金管理人将坚持价值投资的理念，结合资源优选基金重点投资技术资源、渠道资源、品牌资源的特点，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及其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

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：宝盈资源优选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	933,971,459.84	283,262,802.66
结算备付金		3,699,840.48	12,737,939.46
存出保证金		1,285,239.84	3,792,085.71
交易性金融资产	6.4.7.2	4,415,525,694.89	7,554,401,191.65

其中：股票投资		4,415,525,694.89	7,205,095,264.55
基金投资		-	-
债券投资		-	349,305,927.10
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		35,828,210.28	39,999,983.76
应收利息	6.4.7.5	175,318.81	20,215,633.90
应收股利		-	-
应收申购款		3,502,709.04	7,361,462.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,393,988,473.18	7,921,771,099.21
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		-	55,178,722.13
应付赎回款		343,396,035.97	44,446,483.04
应付管理人报酬		6,559,086.71	10,017,549.37
应付托管费		1,093,181.12	1,669,591.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,535,216.44	6,788,512.64
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	1,068,268.68	397,735.97
负债合计		355,651,788.92	118,498,594.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,534,216,814.62	3,278,265,708.49
未分配利润	6.4.7.10	2,504,119,869.64	4,525,006,795.99
所有者权益合计		5,038,336,684.26	7,803,272,504.48
负债和所有者权益总计		5,393,988,473.18	7,921,771,099.21

注：报告截止 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8278 元，基金份额总额 2,756,550,553.46 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈资源优选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1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-1,329,845,242.25	2,802,470,806.32
1. 利息收入		3,429,428.15	7,645,660.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,123,965.82	1,712,731.10
债券利息收入		111,001.19	5,932,929.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		194,461.14	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-321,564,560.90	1,566,378,936.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-327,306,750.98	1,537,242,003.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-10,062,775.50	-231,026.00
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	15,804,965.58	29,367,959.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,013,979,762.54	1,211,243,824.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,269,653.04	17,202,384.56
减：二、费用		57,317,065.59	104,118,825.98
1. 管理人报酬		40,347,492.53	64,365,268.74
2. 托管费		6,724,582.06	10,727,544.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,997,951.47	28,179,001.69
5. 利息支出		-	636,558.19
其中：卖出回购金融资产支出		-	636,558.19
6. 其他费用	6.4.7.20	247,039.53	210,452.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,387,162,307.84	2,698,351,980.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,387,162,307.84	2,698,351,980.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈资源优选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)	3,278,265,708.49	4,525,006,795.99	7,803,272,504.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,387,162,307.84	-1,387,162,307.84
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)	-744,048,893.87	-633,724,618.51	-1,377,773,512.38
其中：1.基金申购款	658,604,718.62	545,533,732.40	1,204,138,451.02
2.基金赎回款	-1,402,653,612.49	-1,179,258,350.91	-2,581,911,963.40
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)	2,534,216,814.62	2,504,119,869.64	5,038,336,684.26
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,184,068,811.87	1,731,462,056.97	3,915,530,868.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,698,351,980.34	2,698,351,980.34
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)	1,780,255,453.55	3,470,515,405.54	5,250,770,859.09
其中：1.基金申购款	6,382,024,548.01	12,920,747,792.95	19,302,772,340.96
2.基金赎回款	-4,601,769,094.46	-9,450,232,387.41	-14,052,001,481.87
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)	-	-1,553,302,311.87	-1,553,302,311.87
五、期末所有者权益(基金净值)	3,964,324,265.42	6,347,027,130.98	10,311,351,396.40

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

宝盈资源优选混合型证券投资基金(原名为宝盈资源优选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原鸿飞证券投资基金(以下简称“基金鸿飞”)基金份额持有人大会于 2008 年 2 月 6 日至 2008 年 2 月 28 日决议通过的《关于鸿飞证券投资基金转型有关事项的议案》,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]392 号《关于核准鸿飞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》,由原鸿飞证券投资基金转型而来。原基金鸿飞为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2008 年 4 月 14 日止。根据深交所深证复[2008]17 号《关于同意鸿飞证券投资基金终止上市的批复》,原基金鸿飞于 2008 年 4 月 14 日进行终止上市权利登记。自 2008 年 4 月 15 日起,原基金鸿飞终止上市,原基金鸿飞更名为宝盈资源优选股票型证券投资基金,《鸿飞证券投资基金基金合同》失效的同时《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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。

原基金鸿飞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 587,318,195.00 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《宝盈资源优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原鸿飞证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金于 2008 年 6 月 25 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1: 1.0877285,并于 2008 年 6 月 25 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2008 年 5 月 22 日至 2008 年 6 月 20 日期间内开放集中申购,共募集 53,001,904.19 元,其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 19,187.54 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报(验)字(08)第 0006 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2008 年 6 月 25 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 53,001,904.19 份基金份额,其中包括集中申购资金利息折合的 19,187.54 份基金份额,并于 2008 年 6 月 25 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈资源优选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良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票投资的比例范围为基金资产的

60%-95%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0%-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有资源优势的股票。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 X 75%+上证国债指数 X 25%。

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”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈资源优选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 2016 年上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 年上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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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》、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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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 2016年6月30日
活期存款	933,971,459.84
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	933,971,459.84

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	4,305,939,034.90	4,415,525,694.89	109,586,659.99
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	4,305,939,034.90	4,415,525,694.89	109,586,659.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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买入返售金融资产。

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	172,581.20
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	1,665.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	494.31
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	578.30
合计	175,318.81

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	3,534,083.89
银行间市场应付交易费用	1,132.55
合计	3,535,216.44

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	751,233.15
预提费用	313,824.52
应付转出费	3,211.01
合计	1,068,268.68

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	3,565,885,731.68	3,278,265,708.49
本期申购	716,388,772.36	658,604,718.62
本期赎回（以“-”号填列）	-1,525,723,950.58	-1,402,653,612.49
本期末	2,756,550,553.46	2,534,216,814.62

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,429,121.96	4,517,577,674.03	4,525,006,795.99
本期利润	-373,182,545.30	-1,013,979,762.54	-1,387,162,307.84
本期基金份额交易产生的变动数	62,323,666.62	-696,048,285.13	-633,724,618.51
其中：基金申购款	-49,921,537.52	595,455,269.92	545,533,732.40
基金赎回款	112,245,204.14	-1,291,503,555.05	-1,179,258,350.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-303,429,756.72	2,807,549,626.36	2,504,119,869.64

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	3,061,301.82
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	47,539.24
其他	15,124.76
合计	3,123,965.82

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	3,846,123,973.14
减：卖出股票成本总额	4,173,430,724.12
买卖股票差价收入	-327,306,750.98

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	369,528,718.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	359,333,775.50
减：应收利息总额	20,257,718.00
买卖债券差价收入	-10,062,775.50

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

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	15,804,965.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,804,965.58

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	-1,013,979,762.54
——股票投资	-1,024,007,610.94
——债券投资	10,027,848.40
——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	-1, 013, 979, 762. 54

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	2, 186, 387. 79
基金转换费收入	83, 265. 25
合计	2, 269, 653. 04

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	9, 997, 951. 47
银行间市场交易费用	-
合计	9, 997, 951. 47

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	64, 644. 58
信息披露费	149, 179. 94
其他	200. 00
银行汇划费用	10, 515. 01
银行间帐户维护费	22, 500. 00
合计	247, 039. 53

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

本基金本报告期内无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内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

本基金本报告期不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。

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	40,347,492.53	64,365,268.74
其中：支付销售机构的客户维护费	8,832,692.31	8,469,254.39

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：

日基金管理人报酬 = 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,724,582.06	10,727,544.79

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日（2008年4月15日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,499,697.49	-
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	5,499,697.49	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2000%	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016年6月30日		2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国对外经济贸易信托有限公司	413,523.18	0.0200%	413,523.18	0.0100%

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1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	933,971,459.84	3,061,301.82	96,200,138.15	1,503,438.86

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

本基金本报告期间及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间无需披露其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300005	探路者	2016年6月2日	2017年6月5日	非公开发行流通受限	15.88	15.97	3,189,762	50,653,420.56	50,940,499.14	-
000050	深天马A	2016年1月14日	2017年1月14日	非公开发行流通受限	17.82	19.21	2,244,668	39,999,983.76	43,120,072.28	-
603456	九洲药业	2015年12月7日	2016年12月2日	非公开发行流通受限	58.00	25.82	711,555	41,270,190.00	18,372,351.10	-
603456	九洲药业	2015年12月7日	2016年12月2日	非公开发行-分红送股	-	25.82	711,555	-	18,372,350.10	-
300301	长方集团	2016年5月17日	2017年5月19日	非公开发行流通受限	7.60	7.71	3,125,000	23,750,000.00	24,093,750.00	-
002023	海特高新	2015年9月1日	2016年9月2日	非公开发行流通受限	20.00	17.33	1,000,000	20,000,000.00	17,330,000.00	-
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	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让；基金可使用以基金名义开设的股票账户参与认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002373	千方科技	2016年5月12日	重大资产重组	17.12	2016年8月16日	16.43	8,804,632	182,692,907.31	150,735,299.84	-
600358	国旅联合	2016年4月5日	重大资产重组	13.50	2016年8月5日	12.57	2,075,865	37,370,178.93	28,024,177.50	-
002445	中南文化	2016年6月14日	重大资产重组	22.99	-	-	1,030,835	26,403,840.81	23,698,896.65	-
000547	航天发展	2016年4月19日	重大资产重组	15.36	-	-	752,800	13,780,976.04	11,563,008.00	-

002587	奥拓电子	2016年4月19日	重大资产重组	14.45	2016年7月28日	14.00	651,164	7,998,297.61	9,409,319.80	-
002672	东江环保	2016年5月23日	重大事项停牌	17.33	2016年7月15日	19.06	249,925	4,163,928.50	4,331,200.25	-
300299	富春通信	2016年2月29日	重大资产重组	27.51	-	-	128,921	6,039,658.10	3,546,616.71	-
601611	中国核建	2016年6月30日	股票异动停牌	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

截至本报告期末2016年6月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和权证投资等。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，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：同)。

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。

于 2016 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 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	933,971,459.84	-	-	-	933,971,459.84
结算备付金	3,699,840.48	-	-	-	3,699,840.48
存出保证金	1,285,239.84	-	-	-	1,285,239.84
交易性金融资产	-	-	-	4,415,525,694.89	4,415,525,694.89
应收证券清算款	-	-	-	35,828,210.28	35,828,210.28
应收利息	-	-	-	175,318.81	175,318.81
应收申购款	93,667.84	-	-	3,409,041.20	3,502,709.04
资产总计	939,050,208.00	-	-	4,454,938,265.18	5,393,988,473.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	343,396,035.97	343,396,035.97
应付管理人报酬	-	-	-	6,559,086.71	6,559,086.71
应付托管费	-	-	-	1,093,181.12	1,093,181.12
应付交易费用	-	-	-	3,535,216.44	3,535,216.44
其他负债	-	-	-	1,068,268.68	1,068,268.68
负债总计	-	-	-	355,651,788.92	355,651,788.92
利率敏感度缺口	939,050,208.00	-	-	4,099,286,476.26	5,038,336,684.26
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	283,262,802.66	-	-	-	283,262,802.66
结算备付金	12,737,939.46	-	-	-	12,737,939.46
存出保证金	3,792,085.71	-	-	-	3,792,085.71
交易性金融资产	349,305,927.10	-	-	7,205,095,264.55	7,554,401,191.65
应收证券清算款	-	-	-	39,999,983.76	39,999,983.76
应收利息	-	-	-	20,215,633.90	20,215,633.90
应收申购款	100,000.00	-	-	7,261,462.07	7,361,462.07
资产总计	649,198,754.93	-	-	7,272,572,344.28	7,921,771,099.21
负债					
应付证券清算款	-	-	-	55,178,722.13	55,178,722.13
应付赎回款	-	-	-	44,446,483.04	44,446,483.04
应付管理人报酬	-	-	-	10,017,549.37	10,017,549.37
应付托管费	-	-	-	1,669,591.58	1,669,591.58
应付交易费用	-	-	-	6,788,512.64	6,788,512.64
其他负债	-	-	-	397,735.97	397,735.97
负债总计	-	-	-	118,498,594.73	118,498,594.73
利率敏感度缺口	649,198,754.93	-	-	7,154,073,749.55	7,803,272,504.48

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

于 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：4.48%)，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比例为基金总资产的 60%-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具为基金总资产 0%-40%。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	4,415,525,694.89	87.64	7,205,095,264.55	92.33
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,415,525,694.89	87.64	7,205,095,264.55	92.33

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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	213,187,577.57	318,753,650.00
2. 沪深 300 指数下降 5%	-213,187,577.57	-318,753,650.00	

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	4,415,525,694.89	81.86
	其中：股票	4,415,525,694.89	81.86

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	937,671,300.32	17.38
7	其他各项资产	40,791,477.97	0.76
8	合计	5,393,988,473.18	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	43,323,513.66	0.86
B	采矿业	53,188,741.00	1.06
C	制造业	3,018,984,735.26	59.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	86,386,083.14	1.71
F	批发和零售业	55,817,393.12	1.11
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	746,494,908.73	14.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	124,614,402.74	2.47
L	租赁和商务服务业	47,205,365.26	0.94
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	134,520,315.25	2.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,510,000.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	90,460,110.63	1.80
S	综合	-	-
	合计	4,415,525,694.89	87.64

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	002522	浙江众成	21,847,400	409,638,750.00	8.13
2	300252	金信诺	9,643,389	319,485,477.57	6.34
3	002023	海特高新	17,921,152	310,573,564.16	6.16
4	603456	九洲药业	9,332,810	240,973,154.20	4.78
5	002773	康弘药业	4,723,271	219,868,265.05	4.36
6	300170	汉得信息	12,015,000	182,387,700.00	3.62
7	002368	太极股份	4,783,113	169,944,004.89	3.37
8	002373	千方科技	8,804,632	150,735,299.84	2.99
9	002549	凯美特气	13,491,100	130,189,115.00	2.58
10	300047	天源迪科	6,099,695	121,688,915.25	2.42
11	002215	诺普信	10,417,436	107,716,288.24	2.14
12	300005	探路者	6,449,428	106,517,804.44	2.11
13	600201	生物股份	2,838,420	77,574,018.60	1.54
14	002518	科士达	3,097,932	77,076,548.16	1.53
15	300367	东方网力	2,646,231	65,705,915.73	1.30
16	002053	云南盐化	2,068,599	58,727,525.61	1.17
17	300318	博晖创新	5,973,820	56,691,551.80	1.13
18	002745	木林森	1,554,243	52,828,719.57	1.05
19	300088	长信科技	3,541,634	52,664,097.58	1.05
20	300291	华录百纳	2,227,021	52,401,804.13	1.04
21	300373	扬杰科技	2,020,291	48,709,216.01	0.97
22	002659	中泰桥梁	2,695,205	48,675,402.30	0.97
23	603308	应流股份	1,869,268	46,993,397.52	0.93
24	000558	莱茵体育	2,665,627	44,089,470.58	0.88
25	600219	南山铝业	5,880,200	43,513,480.00	0.86
26	000050	深天马A	2,244,668	43,120,072.28	0.86
27	002675	东诚药业	896,200	41,700,186.00	0.83
28	600382	广东明珠	2,581,876	41,310,016.00	0.82
29	300326	凯利泰	1,563,271	39,066,142.29	0.78
30	002184	海得控制	1,406,192	36,996,911.52	0.73
31	002671	龙泉股份	2,990,800	36,936,380.00	0.73
32	300094	国联水产	2,494,443	36,468,756.66	0.72
33	002098	浔兴股份	2,875,091	33,408,557.42	0.66
34	600867	通化东宝	1,440,039	29,794,406.91	0.59
35	600711	盛屯矿业	3,884,965	28,748,741.00	0.57

36	600565	迪马股份	4,385,000	28,327,100.00	0.56
37	600358	国旅联合	2,075,865	28,024,177.50	0.56
38	300446	乐凯新材	568,400	27,965,280.00	0.56
39	002047	宝鹰股份	2,736,877	27,368,770.00	0.54
40	600990	四创电子	310,007	26,874,506.83	0.53
41	002413	雷科防务	1,933,250	26,543,522.50	0.53
42	002513	*ST 蓝丰	1,743,761	26,156,415.00	0.52
43	600894	广日股份	1,931,336	25,744,708.88	0.51
44	600458	时代新材	1,650,300	25,711,674.00	0.51
45	300033	同花顺	308,642	25,138,890.90	0.50
46	000581	威孚高科	1,239,840	24,995,174.40	0.50
47	300084	海默科技	2,000,000	24,440,000.00	0.49
48	300301	长方集团	3,125,000	24,093,750.00	0.48
49	002445	中南文化	1,030,835	23,698,896.65	0.47
50	000882	华联股份	5,801,100	23,668,488.00	0.47
51	000892	星美联合	1,523,195	21,553,209.25	0.43
52	000042	中洲控股	1,228,693	21,035,224.16	0.42
53	600261	阳光照明	2,916,600	20,591,196.00	0.41
54	002093	国脉科技	1,610,400	19,985,064.00	0.40
55	002131	利欧股份	1,075,835	18,386,020.15	0.36
56	000681	视觉中国	766,800	18,134,820.00	0.36
57	600057	象屿股份	1,717,742	17,658,387.76	0.35
58	002481	双塔食品	2,267,500	16,552,750.00	0.33
59	002739	万达院线	200,000	15,980,000.00	0.32
60	600195	中牧股份	842,881	15,424,722.30	0.31
61	300347	泰格医药	500,000	14,510,000.00	0.29
62	002034	美欣达	399,907	14,388,653.86	0.29
63	600566	济川药业	501,654	12,912,573.96	0.26
64	000060	中金岭南	1,228,001	12,808,050.43	0.25
65	000068	华控赛格	1,250,493	12,104,772.24	0.24
66	000801	四川九洲	975,000	12,012,000.00	0.24
67	000547	航天发展	752,800	11,563,008.00	0.23
68	002421	达实智能	599,910	10,480,427.70	0.21
69	002123	荣信股份	470,600	9,783,774.00	0.19
70	002310	东方园林	399,943	9,566,636.56	0.19
71	002587	奥拓电子	651,164	9,409,319.80	0.19
72	300002	神州泰岳	880,000	9,363,200.00	0.19
73	603898	好莱客	299,909	9,324,170.81	0.19
74	300229	拓尔思	430,078	9,195,067.64	0.18

75	600338	西藏珠峰	300,000	8,817,000.00	0.17
76	600879	航天电子	487,828	7,600,360.24	0.15
77	000732	泰禾集团	385,500	7,494,120.00	0.15
78	600562	国睿科技	200,000	6,858,000.00	0.14
79	300463	迈克生物	248,200	6,718,774.00	0.13
80	600584	长电科技	300,000	6,087,000.00	0.12
81	300396	迪瑞医疗	134,000	5,772,720.00	0.11
82	300213	佳讯飞鸿	200,000	5,648,000.00	0.11
83	601933	永辉超市	1,322,644	5,462,519.72	0.11
84	300233	金城医药	202,000	5,229,780.00	0.10
85	300219	鸿利光电	319,927	4,984,462.66	0.10
86	000987	广州友谊	378,206	4,878,857.40	0.10
87	600398	海澜之家	400,000	4,520,000.00	0.09
88	002041	登海种业	289,050	4,491,837.00	0.09
89	002672	东江环保	249,925	4,331,200.25	0.09
90	603009	北特科技	100,000	4,254,000.00	0.08
91	600993	马应龙	200,000	4,166,000.00	0.08
92	002341	新纶科技	188,700	4,062,711.00	0.08
93	300287	飞利信	300,000	4,020,000.00	0.08
94	002343	慈文传媒	81,309	3,943,486.50	0.08
95	300299	富春通信	128,921	3,546,616.71	0.07
96	300189	神农基因	421,950	2,362,920.00	0.05
97	601689	拓普集团	57,900	1,907,805.00	0.04
98	300071	华谊嘉信	141,000	1,522,800.00	0.03
99	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
100	300137	先河环保	47,876	708,086.04	0.01
101	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
102	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
103	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
104	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
105	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
106	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
107	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
108	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
109	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
110	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
111	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
112	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
113	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	300005	探路者	91,157,303.24	1.17
2	002053	云南盐化	69,150,360.39	0.89
3	300088	长信科技	66,667,863.71	0.85
4	300420	五洋科技	60,978,281.42	0.78
5	002745	木林森	50,879,546.39	0.65
6	300291	华录百纳	50,441,358.70	0.65
7	002341	新纶科技	49,698,267.67	0.64
8	000558	莱茵体育	46,862,546.65	0.60
9	600382	广东明珠	45,363,851.24	0.58
10	300467	迅游科技	44,237,132.15	0.57
11	300322	硕贝德	41,124,135.54	0.53
12	600219	南山铝业	40,874,753.00	0.52
13	000050	深天马A	39,999,983.76	0.51
14	002671	龙泉股份	38,135,390.67	0.49
15	002675	东诚药业	37,905,530.81	0.49
16	002131	利欧股份	37,147,715.36	0.48
17	603308	应流股份	36,909,490.40	0.47
18	600990	四创电子	35,292,332.36	0.45
19	002097	山河智能	35,026,947.49	0.45
20	000099	中信海直	33,833,169.94	0.43

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。

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	300463	迈克生物	138,527,459.55	1.78
2	300367	东方网力	122,149,506.68	1.57

3	600975	新五丰	121,112,223.29	1.55
4	300467	迅游科技	101,939,189.53	1.31
5	002286	保龄宝	93,806,564.38	1.20
6	300094	国联水产	93,697,983.19	1.20
7	603703	盛洋科技	87,495,486.57	1.12
8	002341	新纶科技	83,183,673.68	1.07
9	002522	浙江众成	77,805,250.41	1.00
10	002053	云南盐化	75,501,859.97	0.97
11	002157	正邦科技	74,503,518.62	0.95
12	300420	五洋科技	67,083,286.06	0.86
13	300326	凯利泰	63,328,479.12	0.81
14	300071	华谊嘉信	57,487,564.85	0.74
15	000971	高升控股	56,900,768.95	0.73
16	603308	应流股份	53,545,856.54	0.69
17	600061	国投安信	51,676,238.12	0.66
18	002746	仙坛股份	49,484,285.28	0.63
19	300373	扬杰科技	48,265,504.96	0.62
20	000070	特发信息	47,207,865.85	0.60

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，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	2,407,868,765.40
卖出股票收入（成交）总额	3,846,123,973.14

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指买卖成交金额，即成交单价乘以成交数量，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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资贵金属。

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除凯美特气外未受到公开谴责、处罚。

湖南凯美特气体股份有限公司（以下简称“公司”）于2015年8月18日公告收到《湖南凯美特气体股份有限公司关于收到湖南证监局行政监管措施决定书的公告》，对上市公司重大资产重组事项做出了采取责令公开说明的监管措施。公司在2015年9月2日公告了《湖南凯美特气体股份有限公司关于对中国证券监督管理委员会湖南监管局〈关于对湖南凯美特气体股份有限公司采取责令公开说明措施的决定〉（[2015]9号）的回函公告》，对于监管机构的问询作出了详细说明。

我们关注到此次事件是公司在信息披露上不够规范造成，事件发生后，公司也立即根据监管

机构的要求作出了相关说明。我们对于公司的价值判断在于对公司主营业务发展的持续看好。且公司已于 2015 年 11 月 3 日公告终止重大资产购买，以上事件不影响我们对于公司长期投资逻辑和价值的判断。

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	1,285,239.84
2	应收证券清算款	35,828,210.28
3	应收股利	-
4	应收利息	175,318.81
5	应收申购款	3,502,709.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,791,477.97

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	002373	千方科技	150,735,299.84	2.99	重大资产重组
2	603456	九洲药业	36,744,700.20	0.73	非公开发行流通受限
3	002023	海特高新	17,330,000.00	0.34	非公开发行流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
187,832	14,675.62	148,409,453.60	5.38%	2,608,141,099.86	94.62%

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	63,595.65	0.0023%

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（2008年4月15日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,565,885,731.68
本报告期基金总申购份额	716,388,772.36
减：本报告期基金总赎回份额	1,525,723,950.58
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	2,756,550,553.46

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

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

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	
长江证券	2	1,371,839,001.20	22.35%	1,250,158.51	22.29%	-
西南证券	1	1,344,148,434.08	21.90%	1,224,923.26	21.84%	-
银河证券	2	1,250,203,123.13	20.37%	1,139,309.52	20.32%	-
华泰证券	1	719,757,893.95	11.73%	655,912.64	11.70%	-
国泰君安	2	594,750,994.38	9.69%	553,890.01	9.88%	-
中金公司	2	565,980,364.48	9.22%	515,778.18	9.20%	-
国金证券	2	176,973,343.24	2.88%	161,276.74	2.88%	-
海通证券	1	113,939,478.16	1.86%	106,110.99	1.89%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-

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，并能为本基金提供全面的信息服务。
 - ⑥ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
- 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

① 租用交易单元情况

本基金本报告期内无租用交易单元情况。

② 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元情况。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	500,000,000.00	62.50%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	300,000,000.00	37.50%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年1月7日

	调整的公告		
5	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年1月8日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年1月12日
7	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年1月14日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年1月16日
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金投资深天马A非公开发行股票的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年1月16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27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1月28日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月3日
13	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月5日
14	宝盈基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月16日

	示性公告		
15	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月19日
16	宝盈基金管理有限公司关于旗下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
17	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职领薪情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月24日
18	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月25日
19	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年2月26日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2016年3月1日
21	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	中国证券报 证券时报	2016年4月6日

	有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	上海证券报 证券日报	
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	关于增加申万宏源西部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	2016年5月13日
30	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年5月14日
31	宝盈基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年5月16日
32	宝盈基金管理有限公司关于新增珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年5月18日
33	关于旗下基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行“基金通”平台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5月18日
34	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
35	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

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	2016年6月4日
37	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金投资探路者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6月4日
38	宝盈基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2016年6月6日
39	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
40	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
41	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
42	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
43	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
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	2016年6月29日
45	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

中国证监会批复鸿飞基金的名称变更为宝盈资源优选股票型证券投资基金的文件。

根据《关于宝盈资源优选股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈资源优选股票型证券投资基金名称变更为宝盈资源优选混合型证券投资基金。

《宝盈资源优选混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈资源优选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