

鸿阳证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 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。

基金托管人中国农业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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2001-12-18

2.2 基金产品说明

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	作为成长价值复合型基金，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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	林葛
	联系电话	0755-83276688	010-66060069
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95599

传真	0755-83515599	010-68121816
----	---------------	--------------

2.4 信息披露方式

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

§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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	345,558,596.08
本期利润	1,055,287,747.03
加权平均基金份额本期利润	0.5276
本期基金份额净值增长率	50.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0796
期末基金资产净值	3,146,353,631.78
期末基金份额净值	1.5732

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

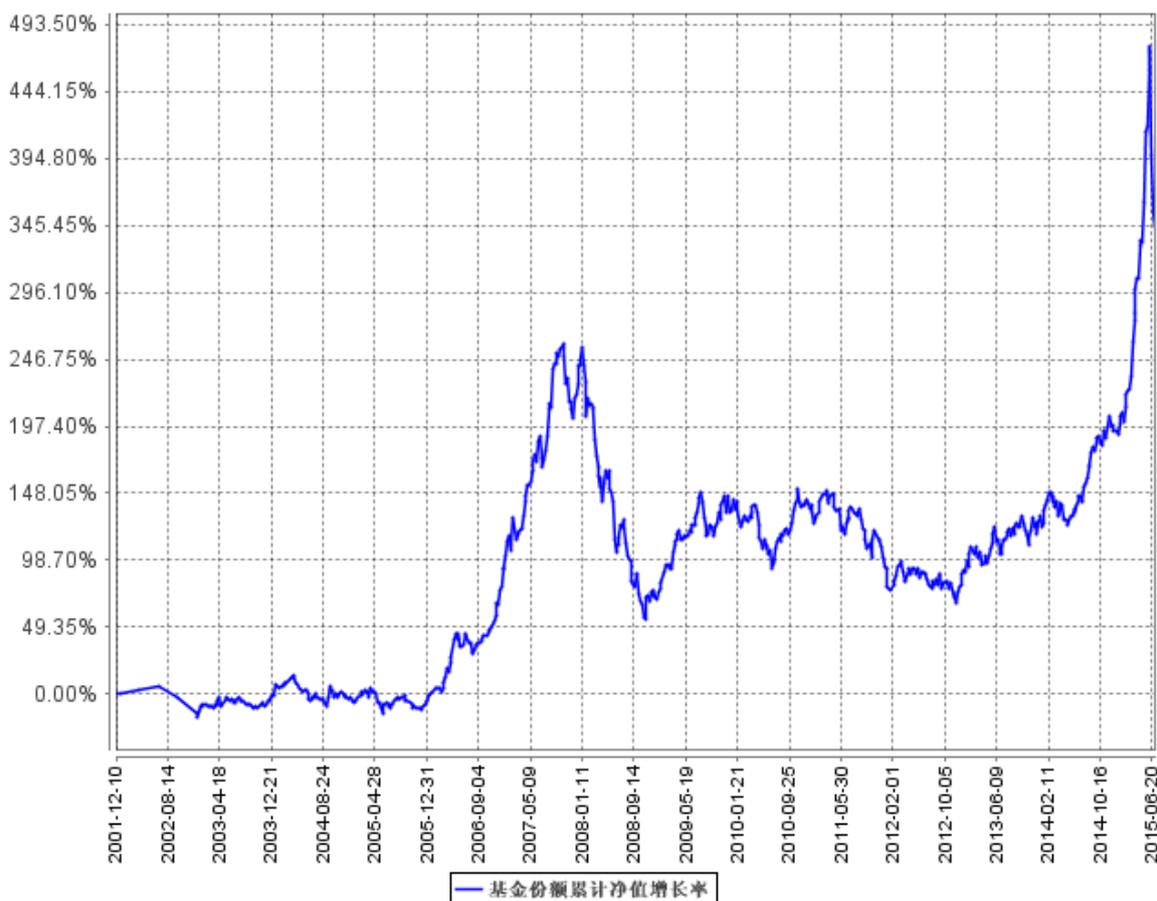
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-14.62%	8.63%	-	-	-	-
过去三个月	16.49%	6.50%	-	-	-	-
过去六个月	50.47%	4.92%	-	-	-	-
过去一年	83.59%	3.70%	-	-	-	-
过去三年	134.53%	2.89%	-	-	-	-
自基金合同	342.82%	2.77%	-	-	-	-

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、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		
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、副总经理	2013 年 2 月 5 日	-	11 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、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。
郝淼	本基金基金经理助理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2015 年 1 月 30 日	-	4 年	郝淼先生，中国科学院生物化学与分子生物学博士。历任中科院上海生命科学院助理研究员、平安证券研究所医药行业研究员，2013 年 6 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。
李进	本基金基金经理助理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2015 年 6 月 8 日	-	4 年	李进先生，武汉大学金融学硕士。历任中国农业银行深圳市分行信贷审批员、华泰联合证券研究所研究员，2014 年 8 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（助理）非首任基金经理（助理），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

2015 年上半年国内经济依然低迷，通货膨胀保持在低位，货币政策及流动性维持宽松格局，1-5 月份 A 股大幅上涨。随着 6 月份监管层采取措施去杠杆，市场风险偏好大幅降低，出现流动性危机，中小板个股出现踩踏事件，市场大幅下跌。我们仍然坚持自下而上的选股方法，重点投资了环保、新能源汽车、电子、高端设备制造等行业，为平衡组合风险，保留了部分银行、地产、汽车、消费等蓝筹品种；在主题上布局了国企改革、军工、互联网应用等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金的份额净值为 1.5732 元。本报告期内本基金的份额净值增长率为 50.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，我国经济增速存在进一步下滑的风险，流动性整体宽松，无风险利率继续维持在低位，

政府通过加快投资项目批复、国企改革等方式来稳增长，降低经济下行的风险。在此预期下，我们依然看好 A 股的投资机会。

在当前位置，A 股的整体估值水平已经明显下降，政府采取了一系列稳增长和防范金融风险的措施，预计市场会逐步企稳。市场在经历前期大幅杀跌后，部分个股已经具备良好的投资价值，后续我们会精心被错杀的确定性成长股。此类个股必须符合两个条件：第一，业绩确定性高成长，估值和业绩增速匹配；第二，企业具备稀缺属性。

基于上述考虑，本基金将继续坚持自下而上个股选择的投资思路，在价值和成长中构建相对均衡的组合，并将根据市场风格、两者估值比较做一定的配置权重调节，以达到净值稳健增长的目的。在目前这个阶段，我们倾向于保持均衡配置的策略。低估值蓝筹股中我们相对看好大消费中的金融、汽车、家电、医药、食品饮料等。成长股中我们看好互联网垂直应用、新能源汽车、环保、新材料、电子元器件、高端装备制造等标的；受益于国企改革等主题的个股也有很好的投资机会。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管鸿阳证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《鸿阳证券投资基金基金合同》、《鸿阳证券投资基金托管协议》的约定，对鸿阳证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司在鸿阳证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的鸿阳证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§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：鸿阳证券投资基金
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末	上年度末
-----	-----	------

	2015 年 6 月 30 日	2014 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	69,602,152.59	28,342,097.69
结算备付金	33,897,551.42	4,103,465.70
存出保证金	621,455.08	455,496.55
交易性金融资产	3,069,711,330.77	2,471,334,132.57
其中: 股票投资	2,441,944,359.97	1,646,805,105.97
基金投资	-	-
债券投资	627,766,970.80	824,529,026.60
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	-	-
应收证券清算款	33,135,099.36	-
应收利息	6,182,455.18	4,414,104.76
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,213,150,044.40	2,508,649,297.27
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 6 月 30 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	60,000,000.00	388,000,000.00
应付证券清算款	-	24,102,929.39
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,620,149.96	2,676,278.57
应付托管费	770,024.98	446,046.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,175,119.23	2,100,234.02
应交税费	-	-
应付利息	3,009.58	157,924.11
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	228,108.87	100,000.00
负债合计	66,796,412.62	417,583,412.52
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	1,146,353,631.78	91,065,884.75
所有者权益合计	3,146,353,631.78	2,091,065,884.75

负债和所有者权益总计	3, 213, 150, 044. 40	2, 508, 649, 297. 27
------------	----------------------	----------------------

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5732 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鸿阳证券投资基金

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	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	1, 088, 785, 807. 65	108, 448, 771. 94
1.利息收入	11, 313, 009. 25	7, 235, 833. 00
其中：存款利息收入	354, 873. 96	91, 492. 21
债券利息收入	10, 880, 160. 28	7, 144, 340. 79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	77, 975. 01	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	367, 743, 647. 45	66, 820, 124. 71
其中：股票投资收益	340, 741, 164. 53	62, 525, 193. 69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	19, 945, 796. 16	-909, 640. 04
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	7, 056, 686. 76	5, 204, 571. 06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	709, 729, 150. 95	34, 392, 814. 23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	33, 498, 060. 62	17, 782, 308. 24
1. 管理人报酬	20, 844, 909. 98	12, 436, 597. 47
2. 托管费	3, 474, 151. 63	2, 072, 766. 13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4, 546, 072. 00	2, 898, 488. 96
5. 利息支出	4, 379, 519. 29	135, 647. 46
其中：卖出回购金融资产支出	4, 379, 519. 29	135, 647. 46
6. 其他费用	253, 407. 72	238, 808. 22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1, 055, 287, 747. 03	90, 666, 463. 70

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,055,287,747.03	90,666,463.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鸿阳证券投资基金

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）	2,000,000,000.00	91,065,884.75	2,091,065,884.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,055,287,747.03	1,055,287,747.03
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	2,000,000,000.00	1,146,353,631.78	3,146,353,631.78
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）	2,000,000,000.00	-376,895,080.86	1,623,104,919.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,666,463.70	90,666,463.70
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）	-	-	-

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》、《鸿阳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

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》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 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	20,844,909.98	12,436,597.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

6.4.8.2.2 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	3,474,151.63	2,072,766.13

注：支付基金托管人中国农业银行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

6.4.8.3 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债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2001 年 12 月 10 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	0.25%

注：本基金管理人运用固有资金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。

6.4.8.4.2 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 2015年6月30日		上年度末 2014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	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
华泰联合证券	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
重庆国际信托有限公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
天津信托投资有限责任公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
山东省国际信托有限公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%

注：1、本基金以上各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。

2、以上各关联方均为本基金发起人。

6.4.8.5 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
中国农业银行	69,602,152.59	136,602.87	5,416,938.75	74,255.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
000050	深天马 A	2014 年 9 月 26 日	2015 年 9 月 29 日	非公开发行流通受限	14.60	21.17	4,159,530	60,729,138.00	88,057,250.10	-
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	1,130,248	21,000,007.84	60,072,681.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购，基金作为个人投资者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。

6.4.9.2 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
002549	凯美特气	2015 年 4 月 2 日	重大事项	19.97	-	-	15,203,020	112,687,463.41	303,604,309.40	-
002368	太极股份	2015 年 5 月 14 日	重大事项	52.73	-	-	4,360,091	129,351,462.07	229,907,598.43	-
002522	浙江众成	2015 年 6 月 23 日	重大事项	26.64	2015 年 7 月 13 日	27.54	4,000,000	15,307,900.50	106,560,000.00	-
002309	中利科技	2015 年 6 月 2 日	重大事项	27.94	2015 年 7 月 21 日	30.05	3,693,100	75,205,659.30	103,185,214.00	-
002316	键桥通讯	2015	重大事项	14.95	-	-	2,000,095	19,999,786.92	29,901,420.25	-

		年 2月 17日								
000024	招商地产	2015 年 4月 3日	重大事项	36.43	-	-	808,454	20,469,409.04	29,451,979.22	-
002739	万达院线	2015 年 5月 13日	重大事项	244.09	2015 年 7月 3日	219.68	99,920	11,948,958.60	24,389,472.80	-
002303	美盈森	2015 年 6月 9日	重大事项	47.70	2015 年 7月 13日	21.43	300,000	5,337,145.44	14,310,000.00	-
600978	宜华木业	2015 年 6月 18日	重大事项	22.44	-	-	500,000	11,120,308.55	11,220,000.00	-
300431	暴风科技	2015 年 6月 11日	重大事项	307.56	2015 年 7月 13日	276.80	20,205	144,263.70	6,214,249.80	-
600061	国投安信	2015 年 6月 8日	重大事项	27.45	2015 年 7月 20日	34.04	68,000	2,044,156.00	1,866,600.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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 60,000,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。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。

6.4.10 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	2,441,944,359.97	76.00
	其中：股票	2,441,944,359.97	76.00
2	固定收益投资	627,766,970.80	19.54
	其中：债券	627,766,970.80	19.54
	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	103,499,704.01	3.22
7	其他各项资产	39,939,009.62	1.24
8	合计	3,213,150,044.40	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	26,500,950.00	0.84
B	采矿业	22,185,000.00	0.71
C	制造业	1,306,820,456.89	41.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,984,610.22	2.89
E	建筑业	775,610.00	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,879,934.02	9.02
J	金融业	43,941,975.00	1.40
K	房地产业	202,444,003.84	6.43

L	租赁和商务服务业	30,865,600.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	303,604,309.40	9.65
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	24,389,472.80	0.78
S	综合	105,552,437.80	3.35
	合计	2,441,944,359.97	77.61

7.3 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	002549	凯美特气	15,203,020	303,604,309.40	9.65
2	002368	太极股份	4,360,091	229,907,598.43	7.31
3	002305	南国置业	20,275,433	165,042,024.62	5.25
4	002698	博实股份	2,991,772	157,965,561.60	5.02
5	002522	浙江众成	4,000,000	106,560,000.00	3.39
6	300053	欧比特	2,218,481	103,381,214.60	3.29
7	002309	中利科技	3,693,100	103,185,214.00	3.28
8	000791	甘肃电投	6,073,739	90,984,610.22	2.89
9	000050	深天马 A	4,159,530	88,057,250.10	2.80
10	300301	长方照明	7,931,957	78,685,013.44	2.50
11	000009	中国宝安	4,368,000	71,242,080.00	2.26
12	002690	美亚光电	1,800,000	70,686,000.00	2.25
13	600893	中航动力	1,130,248	60,072,681.20	1.91
14	000488	晨鸣纸业	5,979,986	53,640,474.42	1.70
15	603001	奥康国际	1,474,065	46,020,309.30	1.46
16	002023	海特高新	2,006,842	45,454,971.30	1.44
17	601788	光大证券	1,630,500	43,941,975.00	1.40
18	000532	力合股份	1,155,620	34,310,357.80	1.09
19	600686	金龙汽车	1,300,000	33,462,000.00	1.06
20	603806	福斯特	480,520	31,325,098.80	1.00
21	600415	小商品城	2,020,000	30,865,600.00	0.98
22	600172	黄河旋风	1,469,020	30,599,686.60	0.97

23	600234	山水文化	1,199,967	30,323,166.09	0.96
24	002316	键桥通讯	2,000,095	29,901,420.25	0.95
25	000024	招商地产	808,454	29,451,979.22	0.94
26	002402	和而泰	999,976	29,099,301.60	0.92
27	300006	莱美药业	618,717	26,542,959.30	0.84
28	600975	新五丰	1,611,000	26,500,950.00	0.84
29	002739	万达院线	99,920	24,389,472.80	0.78
30	000858	五粮液	720,500	22,839,850.00	0.73
31	600055	华润万东	446,500	22,525,925.00	0.72
32	300157	恒泰艾普	1,500,000	22,185,000.00	0.71
33	002019	亿帆鑫富	499,902	17,146,638.60	0.54
34	603456	九洲药业	331,853	16,934,458.59	0.54
35	000810	创维数字	680,000	16,864,000.00	0.54
36	300348	长亮科技	149,950	16,494,500.00	0.52
37	002192	*ST 路翔	499,907	15,352,143.97	0.49
38	002303	美盈森	300,000	14,310,000.00	0.45
39	002366	丹甫股份	158,600	11,638,068.00	0.37
40	600685	广船国际	212,691	11,430,014.34	0.36
41	600978	宜华木业	500,000	11,220,000.00	0.36
42	300258	精锻科技	676,687	10,522,482.85	0.33
43	002029	七匹狼	499,923	10,498,383.00	0.33
44	002313	日海通讯	500,000	9,580,000.00	0.30
45	000036	华联控股	1,000,000	7,950,000.00	0.25
46	300431	暴风科技	20,205	6,214,249.80	0.20
47	300206	理邦仪器	155,842	4,990,060.84	0.16
48	300318	博晖创新	100,000	4,770,000.00	0.15
49	300342	天银机电	115,127	4,219,404.55	0.13
50	600061	国投安信	68,000	1,866,600.00	0.06
51	300414	中光防雷	14,120	1,184,950.40	0.04
52	300449	汉邦高科	11,723	1,168,783.10	0.04
53	300468	四方精创	12,309	1,059,804.90	0.03
54	300438	鹏辉能源	14,318	989,373.80	0.03
55	002766	索菱股份	25,350	862,153.50	0.03
56	002314	雅致股份	60,500	775,610.00	0.02
57	603026	石大胜华	24,000	552,960.00	0.02
58	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.01
59	300461	田中精机	6,050	293,304.00	0.01

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> 网站的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	123,644,127.68	5.91
2	002305	南国置业	122,729,939.26	5.87
3	601166	兴业银行	81,062,348.79	3.88
4	601788	光大证券	67,498,428.81	3.23
5	002142	宁波银行	62,180,465.87	2.97
6	000876	新希望	53,426,738.68	2.56
7	300157	恒泰艾普	51,540,701.71	2.46
8	000024	招商地产	50,637,135.34	2.42
9	000488	晨鸣纸业	38,768,455.27	1.85
10	000732	泰禾集团	36,552,695.58	1.75
11	600518	康美药业	36,308,259.48	1.74
12	600234	山水文化	36,151,011.10	1.73
13	002402	和而泰	34,482,656.12	1.65
14	300407	凯发电气	32,570,734.48	1.56
15	002368	太极股份	29,964,246.12	1.43
16	603806	福斯特	29,408,948.28	1.41
17	000532	力合股份	29,120,950.74	1.39
18	600172	黄河旋风	27,833,002.00	1.33
19	600415	小商品城	27,581,219.99	1.32
20	600686	金龙汽车	27,108,114.42	1.30

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	137,793,748.04	6.59
2	600894	广日股份	107,126,436.38	5.12
3	601166	兴业银行	91,282,064.00	4.37

4	002142	宁波银行	78,776,546.94	3.77
5	600967	北方创业	76,625,798.32	3.66
6	601218	吉鑫科技	61,660,156.17	2.95
7	000876	新希望	59,252,507.29	2.83
8	300157	恒泰艾普	58,063,634.40	2.78
9	002522	浙江众成	55,684,703.19	2.66
10	000732	泰禾集团	54,917,291.94	2.63
11	002309	中利科技	51,627,238.00	2.47
12	600887	伊利股份	50,731,503.00	2.43
13	600518	康美药业	48,751,676.38	2.33
14	601208	东材科技	46,694,025.61	2.23
15	002023	海特高新	44,194,418.42	2.11
16	300407	凯发电气	39,902,588.90	1.91
17	000024	招商地产	38,597,819.63	1.85
18	600104	上汽集团	34,652,522.57	1.66
19	600287	江苏舜天	34,277,949.71	1.64
20	600660	福耀玻璃	33,984,783.73	1.63

注：1、卖出主要指基金在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、“卖出股票收入”按卖出成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，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	1,358,456,150.96
卖出股票收入（成交）总额	1,644,826,315.82

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	587,711,970.80	18.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,055,000.00	1.27
	其中：政策性金融债	40,055,000.00	1.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	627,766,970.80	19.95

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	010303	03 国债(3)	3,816,970	382,842,091.00	12.17
2	010107	21 国债(7)	1,518,660	160,902,027.00	5.11
3	010213	02 国债(13)	239,890	23,873,852.80	0.76
4	140023	14 付息国债 23	200,000	20,094,000.00	0.64
5	110212	11 国开 12	200,000	19,980,000.00	0.64

7.7 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。

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投资。

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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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未受到公开谴责、处罚。

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	621,455.08
2	应收证券清算款	33,135,099.36
3	应收股利	-
4	应收利息	6,182,455.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,939,009.62

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	002549	凯美特气	303,604,309.40	9.65	重大事项
2	002368	太极股份	229,907,598.43	7.31	重大事项
3	002522	浙江众成	106,560,000.00	3.39	重大事项

4	002309	中利科技	103,185,214.00	3.28	重大事项
5	000050	深天马 A	88,057,250.10	2.80	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

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
24,688	81,011.00	1,362,469,185.00	68.12%	637,530,815.00	31.88%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总 份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	268,926,214.00	13.45%
2	中国人寿再保险股份有限公司	143,169,346.00	7.16%
3	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	135,893,900.00	6.79%
4	中国人寿保险股份有限公司	94,942,779.00	4.75%
5	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	57,000,126.00	2.85%
6	中信证券—华夏银行—中信证券贵宾定制 1 号集合资产管理计划	54,266,359.00	2.71%
7	阳光人寿保险股份有限公司—万能保险产品	52,920,564.00	2.65%
8	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	50,799,144.00	2.54%
9	中国通用技术（集团）控股有限责任公司	49,129,175.00	2.46%
10	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	43,542,741.00	2.18%

注：上述本基金前十名持有人相关资料由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

§9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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	
申银万国	2	979,190,246.46	33.96%	866,484.95	33.57%	-
中信万通证券	1	769,460,825.30	26.69%	700,517.23	27.14%	-
长城证券	1	463,264,144.24	16.07%	409,942.01	15.88%	-
长江证券	1	308,797,742.43	10.71%	277,989.87	10.77%	-
国泰君安证券	2	175,856,331.78	6.10%	160,098.99	6.20%	-
国信证券	1	124,994,853.32	4.34%	110,607.99	4.29%	-

中金公司	1	61,620,224.20	2.14%	55,280.06	2.14%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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

(I) 租用交易单元情况

本基金本报告期内无新增租用交易单元。

(II) 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元。

9.7.2 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
申银万国	-	-	-	-	-	-

中信万通证券	199,681,369.47	22.42%	13,204,000,000.00	45.53%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	500,324,190.34	56.17%	6,242,000,000.00	21.52%	-	-
国泰君安证券	134,596,152.50	15.11%	6,882,000,000.00	23.73%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	56,104,238.10	6.30%	2,671,000,000.00	9.21%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

宝盈基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日