

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年八月二十五日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012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,保证基金报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2.1 基金基本情况
基金简称:宝盈核心优势混合
基金代码:213006
交易代码:213006

2.2 基金产品说明
基金的投资目标:本基金投资于宏观经济景气度高,对资本市场未来持乐观态度,稳健增长的预期,本基金根据研究宏观经济景气度,选取各个行业中具有竞争优势、具有成长性、具有技术优势、具有新增长点、具有管理优势的龙头企业,建立投资组合。

投资策略:本基金采取主动投资管理,运用利率预期、久期管理、收益率曲线策略、相对价值策略、行业轮动策略、资产配置策略及利用正回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超越债券市场的收益。

业绩比较基准:沪深300指数*65%+上证国债指数*35%
风险收益特征:本基金是一只灵活配置型混合基金,属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种,本基金的风险与预期收益都高于债券型基金,高于保本基金和货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人
项目:基金管理人 基金托管人
名称:宝盈基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
信息披露网址:www.bylfunds.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
3.1.1 期间数据和指标 报告期末(2012年1月1日至2012年6月30日)

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 报告期末(2012年1月1日至2012年6月30日). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

3.2 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

Table with 6 columns: 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. Rows include 过去一个月, 过去三个月, etc.

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的比较
宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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,建仓期间本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关规定。

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。

4.1.2 基金经理
姓名 职务 任职本基金的基金经理期限 证券从业年限
王蔚园 本基金基金经理 2012-06-30 - 4年

4.2 基金运作分析
4.2.1 基金运作概况
4.2.2 基金业绩表现
截至本报告期末,本基金的份额净值为0.6689元。本报告期内本基金的份额净值收益率为-4.25%,业绩比较基准收益率为4.06%。

4.3 公平交易制度的执行情况
基金管理人根据《证券投资基金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》对基金的交易行为进行监控。

4.4 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2012年上半年,上证指数从去年底的2199点,微涨至6月底的2225点,涨幅1%,期间呈现先涨后跌的态势。

4.6 报告期内基金投资组合的重大调整
截至本报告期末,本基金的资产配置比例为:股票资产占基金资产净值的比例为65.40%,债券资产占基金资产净值的比例为34.60%。

4.7 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.8 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.9 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.10 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.11 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.12 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.13 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.14 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.15 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.16 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.17 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.18 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.19 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

4.20 基金管理人内部控制的完善情况
基金管理人按照中国证监会和中国证监会相关规定和基金合同关于治理结构的约定,对基金持有人的投资品种进行评价。

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

本基金经理定期说明的重大会计估计变更。
6.4.5.3 差错更正的说明
本基金经理定期说明的重大会计差错更正。

6.4.6 关联交易
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

6.4.8 关联方交易
6.4.8.1 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
6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.3 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
6.4.8.4 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.5 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.6 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.7 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.8 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.9 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.10 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.11 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.12 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.13 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.14 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.15 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.16 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.17 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.18 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.19 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.20 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.21 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.22 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.23 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.24 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.25 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.26 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.27 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.28 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.29 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.30 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.31 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.32 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.33 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.34 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.35 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.36 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.37 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.38 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.39 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.40 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.41 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.42 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.43 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.44 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.45 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.46 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.47 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.48 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.49 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.50 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.51 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.52 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.53 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.54 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.55 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.56 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.57 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.58 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.59 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.60 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.61 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.62 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.63 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.64 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.65 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.66 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.67 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.68 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.69 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.70 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.71 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.72 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.73 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.74 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.75 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.76 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.77 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.78 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8.79 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
6.4.8.80 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

注:1.买入包括基金二级市场主动买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,2.买入金额较大成交金额 较大溢价或以成交数量 孰列,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

Table with 6 columns: 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(%)

注:1.卖出主要指二级市场主动卖出,换股要约收购、发行人回购及行权等减持的股票,2.卖出金额较大成交金额 较大溢价或以成交数量 孰列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票的成本-成交总额, 卖出股票的收入-成交总额

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(成交价款以成交数量)孰列,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

Table with 6 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 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(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
本基金本报告期末持有权证。

7.9 报告期内本基金所投资的前十名证券的发行主体没有发生重大违法违规,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.1 报告期内本基金所投资的前十名证券的发行主体没有发生重大违法违规,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 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。

7.9.5 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。

7.9.6 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,分项与合计数可能存在尾差。

8 基金持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 6 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
项目:持有基金份额(份), 占基金总份额比例

注:1.本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有仅以基金份额总量的数量区间为:0至10万份(份);

2.该只基金的基金经理持有该只基金总份额总量的数量区间为:0至10万份(份)。

9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日, 基金份额变动

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
报告期内基金管理人、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、基金托管人、基金托管业务的诉讼
报告期内无涉及基金管理人、基金托管人、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 报告期内改聘会计师事务所情况
本报告期末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监管部门稽查或处罚的情况
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。

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

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 债券交易, 回购交易, 权证交易

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:
a) 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;
b) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营业绩稳定;
c) 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;
d) 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;
e) 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证券交易的需要,并能为本基金提供及时的信息服务;
f) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2.应支付券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不包括代销券商佣金。

3.本基金本报告期末租用以及退租证券公司交易单元。

宝盈基金管理有限公司
二〇一二年八月二十五日