宝盈鸿利收益证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014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:2014年8月28日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月27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2014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	宝盈鸿利收益混合
基金主代码	213001
交易代码	213001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年10月8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	1,659,261,055.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳收益。
投资策略	本基金为收益型基金,主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益: 战略资产配置策略:基金正常运作时期,本基金债券投资占基金净值的比例不低于20%,股票投资占基金净值的比例不高于75%,现金留存比例为5%左右;在上述比例范围之内,基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标,对不同市场的风险收益状况做出判断,据此调整股票、债券和现金资产的配置比例。 行业资金配置策略:首先由行业分析师估计各行业今后两到三年的期望增长速度,以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整,寻找总体投资价值被相对低估的行业,根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标,结合经济发展不同阶段对不同行业的影响,决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。 公司选择策略:在股票投资方面,发现并选择业绩能够保持高速增长的上市公司进行投资,通过公司业绩的高速增长实现投资收益,积极则是指在对所投资上市公司合理定价的基础上,以积极策略决定买入和卖出时机,当市场价格低于合理定价时买入,市场价格高于合理定价时卖出。本基金为积极成长型基金,投资于成长型企业的比例不低于基金股票投资总额的50%。 债券投资方面:本基金综合平衡不同债券的收益性、安全性和流动性,希望通过长期持有获得稳定的现金利息收益,更好地降低基金投资组合的整体风险;同时,根据不同发行人和不同期限债券间到期收益率、即期收益率、远期收益率之间的结构性差异,积极寻求风险套利和无风险套利机会。
业绩比较基准	以中信综合指数×80%+上证国债指数×20%(国内A股统一指数推出后则变更为国内A股统一指数×80%+国债指数×20%)为投资的参照基准。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	李芳菲
	联系电话	0755-83276688	010-66060069
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	lifangfei@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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	56,529,894.70
本期利润	70,716,858.99
加权平均基金份额本期利润	0.0625
本期基金份额净值增长率	14.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1057
期末基金资产净值	1,040,012,829.56
期末基金份额净值	0.6268

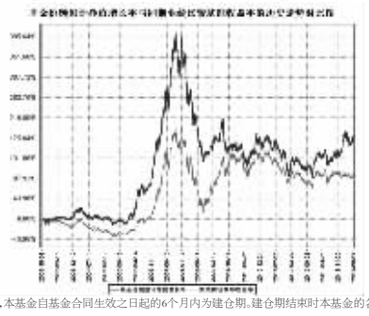
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.84%	0.90%	1.48%	0.67%	4.36%	0.23%
过去三个月	4.69%	0.95%	1.83%	0.72%	2.86%	0.23%
过去六个月	14.97%	1.09%	-0.84%	0.85%	15.81%	0.24%
过去一年	29.99%	1.06%	8.92%	0.93%	21.07%	0.13%
过去三年	8.63%	1.09%	-13.90%	1.05%	22.53%	0.04%
自基金合同生效起至今	183.68%	1.22%	94.99%	1.38%	88.69%	-0.16%

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



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		
彭敢	本基金基金经理、宝盈资源优选股票型证券投资基金基金经理、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、投资部总监	2013年8月1日	-	13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。
张小仁	本基金基金经理、宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理	2014年1月7日	-	7年	张小仁先生,中山大学经济学硕士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

注:1、本基金基金经理均非首任基金经理,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2014年6月30日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

经济方面,总体数据不佳,加强了市场对保增长的政策预期,中央高层也频频表态稳经济的重要性,目前看,较大可能处于筑底过程中。中长期看,经济增速稳中有降可能是“新常态”,其中房地产的走势比较关键,目前看基建更多地仍只是对冲手段,但很难独立支撑经济。调结构仍将是长期共识,关注点仍主要在改革的落实和长期受益于经济调结构的品种。流动性方面,货币政策的实质放松已经启动,只是边际改果还在较强的把控范围内,去年6月末的“钱荒”没再出现;除特殊日期外,国债的长端收益率也呈现出稳步下行的趋势,但仍未降到市场所预期的水平。整个二季度在经历了4月份低迷后,5月中旬开始迎来反弹,表现较好的行业包括:军工、TMT、交运设备等,表现较差的行业则包括房地产、交通运输、纺织服装等。风格上,创业板指数优于代表大盘蓝筹的上证50、中证100。报告期,本基金的股票仓位基本维持在中等水平。上半年,上证指数、沪深300、深圳成指收益率为-3.2%、-7.08%、-9.59%,本基金的收益率为14.97%,大幅好于评价基准。

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0.6268元。本报告期内本基金的份额净值收益率为14.97%,业绩比较基准收益率为-0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,经济层面,依然难有超预期的表现,关注国家保增长的政策力度及相关板块的阶段性机会。需要重视的是传统投资品可能酝酿一波投资机会,一方面,市场关注度较低,股价的跌幅足够深;另一方面,基本面也很难更差,很多行业都存在一定程度的供给收缩;在国企改革的大背景下,也越来越多公司重视资本市场的表现。流动性方面,重点关注资金利率的回落过程及回落速度,同时也关注全球资金的流向,尤其是会否重新较大幅度地流入中国。在中小板、创业板快速反弹之后,业绩不达预期、主题概念类的公司,调整仍不可避免,而且也留意到部分市值低、动力较足的公司,涨幅惊人;与此同时,前期跌幅较大的蓝筹股、新兴蓝筹股投资价值慢慢凸显,尤其是传统蓝筹股,将是未来的重要关注领域之一;经济层面的微刺激,效果可能逐步显现出来,其中比较关注的房地产,政策层面的边际改善已经开始,可能带来传统优质蓝筹股的估值提升。总体上,操作策略上可能与上半年略有差异,优质蓝筹股的配置比例可能提高,尤其又是市场关注度极低的行业。

我们将严格按照基金合同的规定,继续努力尽责地做好本基金的管理工作,尽力为投资者谋取较好的回报。

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估值方法、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,特定客户资产管理部、金融工程部、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历。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、特定客户资产管理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;金融工程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。

§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

在托管宝盈鸿利收益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》相关法律法规的规定以及《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》、《宝盈鸿利收益证券投资基金托管协议》的约定,对本基金基金管理人—宝盈基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014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宝盈鸿利收益证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,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宝盈鸿利收益证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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:宝盈鸿利收益证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	79,593,475.78	36,620,036.83
结算备付金	1,992,311.30	1,425,487.48
存出保证金	317,110.50	266,816.19
交易性金融资产	976,750,415.29	371,613,658.36
其中:股票投资	767,073,157.69	290,914,799.26
基金投资	-	-
债券投资	209,677,257.60	80,698,859.10
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	-	-
应收利息	5,115,084.11	1,663,921.00
应收股利	-	-
应收申购款	372,941.60	209,551.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,064,141,338.58	411,799,471.69
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	-	-
应付证券清算款	18,999,575.82	10,222,259.19
应付赎回款	2,452,749.42	375,299.84
应付管理人报酬	1,166,857.40	501,257.07
应付托管费	194,476.23	83,542.83
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,132,470.33	637,898.64
应交税费	720.00	720.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,659.82	160,070.65
负债合计	24,128,509.02	11,981,048.22
所有者权益:		
实收基金	1,215,339,545.93	537,190,508.09
未分配利润	-175,326,716.37	-137,372,084.62
所有者权益合计	1,040,012,829.56	399,818,423.47
负债和所有者权益总计	1,064,141,338.58	411,799,471.69

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.6268元,基金份额总额1,659,261,055.12份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈鸿利收益证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	80,177,351.14	141,858.29
1.利息收入	3,172,479.88	1,693,396.97
其中:存款利息收入	242,590.34	132,856.67
债券利息收入	2,929,889.54	1,560,540.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	62,793,171.90	25,684,010.70
其中:股票投资收益	59,932,206.08	23,844,422.55
基金投资收益	-	-
债券投资收益	176,686.30	-
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	2,684,279.52	1,839,588.15
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	14,186,964.29	-27,239,688.76
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	24,735.07	4,139.38
减:二、费用	9,460,492.15	5,368,148.39
1.管理人报酬	5,006,688.73	3,133,459.17
2.托管费	834,448.14	522,243.24
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,380,411.30	1,522,063.96
5.利息支出	48,217.86	-
其中:卖出回购金融资产支出	48,217.86	-
6.其他费用	190,726.12	190,382.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	70,716,858.99	-5,226,290.10
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	70,716,858.99	-5,226,290.10

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈鸿利收益证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	537,190,508.09	-137,372,084.62	399,818,423.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	70,716,858.99	70,716,858.99
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)	678,149,037.84	-108,671,490.74	569,477,547.10
其中:1.基金申购款	767,444,369.20	-124,233,790.33	643,210,578.87
2.基金赎回款	-89,295,331.36	15,562,299.59	-73,733,031.77
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)	1,215,339,545.93	-175,326,716.37	1,040,012,829.56
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	605,753,185.17	-199,758,886.09	405,994,299.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,226,290.10	-5,226,290.10
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)	-32,081,920.91	8,986,708.37	-23,095,212.54
其中:1.基金申购款	7,906,906.82	-2,263,168.85	5,643,737.97
2.基金赎回款	-39,988,827.73	11,249,877.22	-28,738,950.51
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)	573,671,264.26	-195,998,467.82	377,672,796.44

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:

_____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈鸿利收益证券投资基金(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”)证监基金字[2002]第53号《关于同意宝盈鸿利收益证券投资基金设立的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《宝盈鸿利收益证券投资基金基金契约》(后更名为《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》)发起,并于2002年10月8日募集成立。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1,446,415,713.90元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第117号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《宝盈鸿利收益证券投资基金招募说明书》和《关于宝盈鸿利收益证券投资基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2008年3月5日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:1.365256582,并于2008年3月5日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈鸿利收益开放式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,包括国内依法公开发行上市的股票,债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合为:债券投资占基金净值的比例不低于20%,股票投资占基金净值的比例不高于75%,其余为现金资产。本基金的业绩比较基准为:中信综合指数X80%+上证国债指数X20%(国内A股统一指数推出后则变更为国内A股统一指数X80%+国债指数X20%)。

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》、《宝盈鸿利收益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2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,出发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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。

6.4.8 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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,006,688.73	3,133,459.17
其中:支付销售机构的客户维护费	646,368.79	582,017.14

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	834,448.14	522,243.24

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

本基金本报告期内以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。

6.4.8.4 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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
基金合同生效日(2002年10月8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	15,863,874.35	-
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	15,863,874.35	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9600%	-

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国农业银行股份有限公司	79,593,475.78	210,115.30	6,679,439.96	123,417.08

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

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2014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
603328	依顿电子	2014年6月23日	2014年7月1日	新股流通受限	15.31	15.31	11,296	172,941.76	172,941.76	-
603369	今世缘	2014年6月25日	2014年7月3日	新股流通受限	16.93	16.93	7,656	129,616.08	129,616.08	-
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	4,484	54,704.80	54,704.80	-

注: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。

6.4.9.2 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
000009	中国宝安	2014年5月28日	重大事项	10.21	2014年8月15日	9.33	2,200,000	24,051,113.22	22,462,000.00	-
002554	惠博普	2014年6月30日	临时停牌	10.76	2014年7月1日	11.84	999,920	12,713,500.83	10,759,139.20	-

注:本基金截至2014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。

6.4.9.3 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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	767,073,157.69	72.08
	其中:股票	767,073,157.69	72.08
2	固定收益投资	209,677,257.60	19.70
	其中:债券	209,677,257.60	19.70
	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	81,585,787.08	7.67
7	其他各项资产	5,805,136.21	0.55
8	合计	1,064,141,338.58	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	12,904,680.81	1.24
B	采矿业	105,956,479.54	10.19
C	制造业	432,845,567.93	41.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,745,281.18	1.90
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	79,381,778.80	7.63
J	金融业	25,074,307.93	2.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	68,703,061.50	6.61
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	22,462,000.00	2.16
	合计	767,073,157.69	73.76

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	5,100,450	68,703,061.50	6.61
2	002698	博实股份	2,279,143	56,796,243.56	5.46
3	000681	远东股份	2,380,000	49,956,200.00	4.80
4	300157	恒泰艾普	3,666,511	47,444,652.34	4.56
5	600967	北方创业	3,400,000	42,670,000.00	4.10
6	002023	海特高新	1,425,480	27,226,668.00	2.62
7	300301	长方照明	1,973,657	26,348,320.95	2.53
8	601166	兴业银行	2,499,931	25,074,307.93	2.41
9	002207	准油股份	1,894,200	23,942,688.00	2.30