鸿阳证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 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:2017 年 3 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 2017 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告,基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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年 12 月 18 日

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	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	150,691,602.81	413,018,895.10	333,913,120.19
本期利润	-472,776,063.89	776,151,198.60	467,960,965.61
加权平均基金份额本期利润	-0.2364	0.3881	0.2340
本期基金份额净值增长率	-16.07%	37.12%	28.82%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0007	0.1133	-0.0932
期末基金资产净值	2,018,441,019.46	2,867,217,083.35	2,091,065,884.75
期末基金份额净值	1.0092	1.4336	1.0455

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。

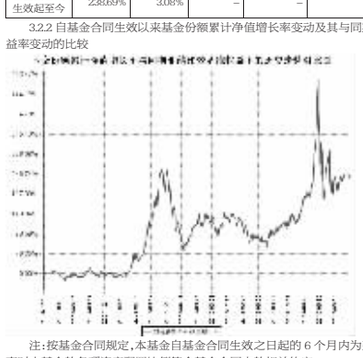
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

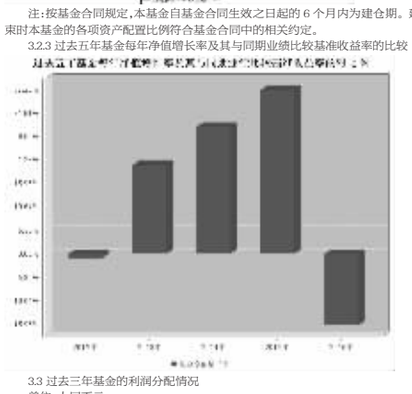
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.26%	0.72%	-	-	-	-
过去六个月	1.26%	1.18%	-	-	-	-
过去一年	-16.07%	3.55%	-	-	-	-
过去三年	48.26%	4.27%	-	-	-	-
过去五年	76.46%	3.64%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	238.69%	3.08%	-	-	-	-

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.8800	376,000,000.00	-	376,000,000.00	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	1.8800	376,000,000.00	-	376,000,000.00	

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
段鹏程	本基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理;研究部总监	2016 年 8 月 20 日	-	12年	段鹏程先生,厦门大学生物学硕士。曾就职于厦门国际信托投资有限公司和天同证券。2004 年 5 月至 2007 年 3 月任职于宝盈基金管理有限公司,担任行业研究员。2007 年 3 月至 2008 年 3 月任职于诺安基金管理有限公司,曾任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理(2007 年 6 月 16 日至 2008 年 1 月 10 日),专户部总监。2008 年 4 月起任职于宝盈基金管理有限公司,历任特定客户资产管理部投资经理,特定客户资产管理部副总监、总监,研究部核心研究员、副总监,现任宝盈基金管理有限公司研究部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
杨凯	本基金基金经理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、副总经理	2013 年 2 月 5 日	2016 年 8 月 20 日	12年	杨凯先生,中山大学岭南学院工商管理硕士。2003 年 7 月至今在宝盈基金管理有限公司工作,先后担任产品设计师、市场部总监,特定客户资产管理部投资经理、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。
李进	本基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈互联网沪港深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	2016 年 10 月 15 日	6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,“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期;

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 12 月 31 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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合,尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,形成《公平交易分析报告》,并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,公司要求相关投资组合经理提供决策依据,并留存记录备查,但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析,并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 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。

4.3.3 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 年度,A 股市场开年第一个月快速、深幅下跌,此后全年呈现为逐步震荡筑底、企稳盘升的态势。报告期内,上证指数下跌 12.31%,沪深 300 下跌 11.28%、中小板指数下跌 22.89%、创业板指数下跌 27.71%。本基金在报告期内获得收益为 -16.07%,优于中小板指数和创业板指数,但负于上证指数和沪深 300 指数同期表现。

本基金为成长价值复合型(即平衡型)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。本基金投资的成长型上市公司具有以下主要特点:公司处于市场导入后期或高速成长前期,主营业务前景良好,主营业务收入、主营业务利润在过去、现在以及可以预见的将来可以保持较高的增长速度,公司盈利也相应增长,股本扩张能力较强。本基金投资的价值型上市公司应具有以下主要特点:公司利润稳定且处于较高水平,经营性现金流充足,公司的市盈率或市净率与同行业平均的水平相比,处于偏低的水平;或公司具备某些领域的独特优势,如资源垄断、政策性垄断等,其实际价值未被市场充分认识或被市场低估。

结合我国经济的宏观基本面,考虑到以“国企改革”为代表的系列改革措施的深化实施,认为 2017 年 A 股市场将震荡走强,整体机会大于 2016 年。

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。现阶段,倾向于保持均衡配置的策略,相对看好大消费、军工、医药、PPP 以及受益于国企改革、经济转型等主题的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是 -16.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当下我国已是全球第二大经济体,全球经济再平衡、人口老龄化到来、劳动力成本持续上升等众多因素都在驱使我国宏观经济的潜在增长率下台阶、都在驱使我们进行产业升级和经济增长模型的调整。我国经济的“新常态”将会持续一个时期,这是事物发展的客观规律,因此我们无需对这一阶段的经济增速过度担忧。相反,经过这一阶段的调整与基础夯实之后,我们相信国家的经济将进入新的健康、持续增长期。

就 2017 年而言,经济将呈现前高后低的格局,房地产与制造业投资预计先稳后下,基建继续稳定较高增速平,CPI 中枢上移,通胀压力较大。货币政策保持中性稳健,无风险利率底部震荡。

特朗普在基建、减税、贸易等领域政策有望提振美国增长与通胀,美元进入更快节奏的加息通道。中国面临更大的战略伸展空间和更多的贸易摩擦问题。欧元区国家的政治风险在时间和区域分布上都更广泛,持续的事件冲击不断。

在资产泡沫转移的过程中估值合理的权益类资产将成为首选,港股和 A 股均具有较佳的配置价值。

A 股市场分子端企业盈利向好,分母端改革提升风险偏好,2017 年 A 股有走强的基本面,但由于宏观经济仍处调整阶段,并不支持“系统性牛市”的到来。周期类企业未来两个季度仍受益于低基数效应,工业价格指数上扬带来的利润改善,创业板公司并购活跃,外延式增长可持续。供给侧改革进入新阶段,国企改革以点带面,产权保护促进民间投资,上改激活农业现代化生产,释放城市经济新动能,改革提升风险偏好。业绩成为 2016 年及未来行业投资最主要线索,股灾之后市场风险偏好显著降低,资金集中于估值低、成长稳定的行业,对于景气度高的行业也要关注。

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,由权益投资部、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。权益投资部、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

本基金收益分配原则:基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%;基金收益分配采取现金方式,每年至少分配一次,分配在基金公布中期报告后三个月或会计年度结束后的四个月内完成;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;基金投资当年亏损,则不进行收益分配;每一基金单位享有同等分配权。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,报告期内本基金共进行了 2 次收益分配:

1、本基金管理人已于 2016 年 4 月 22 日发布公告,以 2015 年 12 月 31 日可供分配利润为基准,每 10 份基金份额派发红利 1.10 元,共计派发现金收益 220,000,000.00 元,占可供分配利润的 97.07%,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

2、本基金管理人已于 2016 年 12 月 23 日发布公告,以 2016 年 12 月 20 日可供分配利润为基准,每 10 份基金份额派发红利 0.78 元,共计派发现金收益 156,000,000.00 元,占可供分配利润的 96.80%,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

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,本基金托管人一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《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一宝盈基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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,基本遵守了《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 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20388 号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:鸿阳证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	11,980,813.02	80,976,418.49
结算备付金	4,466,464.53	3,131,307.31
存出保证金	536,922.87	1,759,082.12
交易性金融资产	1,745,643,582.27	2,840,302,871.81
其中:股票投资	503,552,507.57	2,256,371,945.11
基金投资	-	-
债券投资	1,242,091,074.70	583,930,926.70
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	240,070,500.11	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	20,292,949.36	5,638,080.96
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,022,991,232.16	2,931,807,760.69
负债和所有者权益	**本期末 2016年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	59,042,009.63
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,776,865.94	3,495,054.34
应付托管费	462,810.99	582,509.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,060,535.77	1,271,104.29
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	250,000.00	200,000.00
负债合计	4,550,212.70	64,590,677.34
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	18,441,019.46	867,217,083.35
所有者权益合计	2,018,441,019.46	2,867,217,083.35
负债和所有者权益总计	2,022,991,232.16	2,931,807,760.69

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0092 元,基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体:鸿阳证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-427,233,911.92	837,387,276.45
1.利息收入	21,586,544.48	20,527,746.98
其中:存款利息收入	680,725.71	649,815.43
债券利息收入	19,312,194.16	19,799,956.54
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,593,624.61	77,975.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	174,647,210.30	453,727,225.97
其中:股票投资收益	165,121,445.47	418,123,197.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,077,801.19	26,755,747.88
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	4,447,963.64	8,848,280.36
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-623,467,666.70	363,132,303.50
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	45,542,151.97	61,236,077.85
1. 管理人报酬	33,114,838.88	39,961,192.00
2. 托管费	5,519,139.79	6,660,198.62
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,222,827.39	9,569,136.17
5. 利息支出	-	4,535,230.79
其中:卖出回购金融资产支出	-	4,535,230.79
6. 其他费用	1,685,345.91	510,320.27
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-472,776,063.89	776,151,198.60
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-472,776,063.89	776,151,198.60

7.3 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:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	867,217,083.35	2,867,217,083.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-472,776,063.89	-472,776,063.89
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)	-	-376,000,000.00	-376,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	18,441,019.46	2,018,441,019.46
项目	**上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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)	-	776,151,198.60	776,151,198.60
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	867,217,083.35	2,867,217,083.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 李文众 _____ _____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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,股票的股息、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,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。

7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司(以下简称“宝盈基金公司”)	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)	基金托管人
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
重庆国际信托股份有限公司	基金发起人
天津信托有限责任公司	基金发起人
山东省国际信托股份有限公司	基金发起人
华泰联合证券有限责任公司	基金发起人
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,114,838.88	39,961,192.00
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 1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,519,139.79	6,660,198.62

注:支付基金托管人中国农业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。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 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 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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%

7.4.5.4.2 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 2016年 12 月 31 日		上年度末 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	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
华泰联合证券有限责任公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
重庆国际信托股份有限公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
天津信托有限责任公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%
山东省国际信托股份有限公司	3,000,000.00	0.15%	3,000,000.00	0.15%

7.4.5.5 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 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	11,980,813.02	634,703.87	80,976,418.49	366,103.66

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。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量(单位:份)	总金额
华泰联合证券	600936	广西广电	新股网下中签	17,150	82,320.00
华泰联合证券	600919	江苏银行	新股网下中签	78,962	495,091.74
华泰联合证券	603528	多伦科技	新股网下中签	3,112	29,408.40

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.6 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.6.2 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
603986	兆易创新	2016年 9 月 19 日	重大事项	177.97	2017年 3 月 13 日	195.77	1,133	26,353