

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
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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责任。
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2013年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (宝盈增强收益债券), 基金代码 (213007), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2008年5月15日), 报告期末基金份额总额 (771,440,857.03份), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 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), 下属证券投资基金的基金简称 (宝盈增强收益债券A/B/C), 下属证券投资基金的交易代码 (213007/213907/213907), 报告期末下属证券投资基金的份额总额 (649,679,590.98份 / 121,770,266.05份)

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日), 宝盈增强收益债券A/B, 宝盈增强收益债券C. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 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 for 过去三个月 and 过去三个月.

基金经理

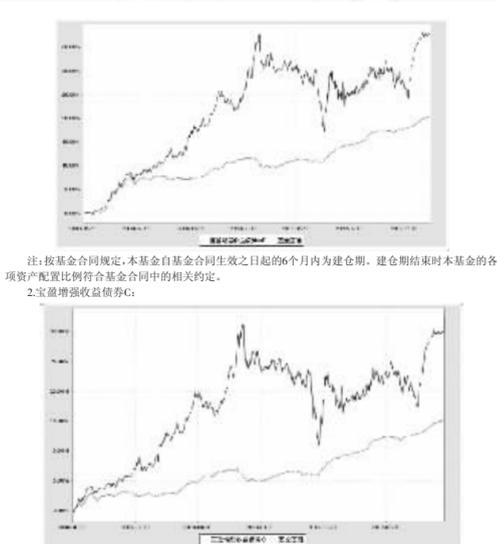
Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Row for 陈若劭.

管理人报告

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
4.3 公平交易专项说明
4.4 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》对本基金在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,本基金在报告期内的同向交易价差均在

宝盈增强收益债券型证券投资基金 2013 第一季度报告



注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期末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。

注:① 本基金于2008年10月20日起增加收取销售服务费的A类收费模式,其对应的基金份额简称“宝盈增强收益债券C”。
②按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期末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。

投资组合报告

4.1 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.基金投资, 3.固定收益投资, 4.金融衍生品投资, 5.买入返售金融资产, 6.银行存款和结算备付金合计, 7.其他各项资产, 8.合计.

4.2 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.国家债券, 2.央行票据, 3.金融债券, 4.企业债券, 5.企业短期融资券, 6.中期票据, 7.其他, 8.合计.

4.3 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A.农林牧渔业, B.采矿业, C.制造业, 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, 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, J.金融业, 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, 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, 合计.

4.4 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.001989 中国重工, 2.000566 海南航空, 3.601318 中国平安, 4.600162 晋江控股, 5.600030 中信证券, 6.601628 中国人寿, 7.000800 一汽轿车, 8.600694 大成股份, 9.002230 科大讯飞, 10.600050 中国联通, 合计.

4.5 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.010308 03国债(8), 2.010107 21国债(7), 3.010501 05国债(1), 合计.

4.6 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Rows include 1.600694 大成股份, 合计.

4.7 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 209,910.82.

4.8 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.9 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Rows include 王茹远.

4.10 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Rows include 1.600694 大成股份, 合计.

4.11 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.12 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.13 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.14 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.15 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.16 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.17 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.18 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.19 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.20 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.21 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.22 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.23 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.24 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.25 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.26 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.27 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.28 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.29 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.30 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

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
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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责任。
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2013年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (宝盈核心优势灵活配置), 基金代码 (213006), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2009年3月17日), 报告期末基金份额总额 (835,264,463.10份), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 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), 下属证券投资基金的基金简称 (宝盈核心优势灵活配置A/B/C), 下属证券投资基金的交易代码 (213006/213906/213906), 报告期末下属证券投资基金的份额总额 (649,679,590.98份 / 121,770,266.05份)

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日), 宝盈核心优势灵活配置A/B, 宝盈核心优势灵活配置C. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 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 for 过去三个月 and 过去三个月.

基金经理

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Rows include 王茹远.

管理人报告

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
4.3 公平交易专项说明
4.4 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》对本基金在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,本基金在报告期内的同向交易价差均在

投资组合报告

4.1 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.基金投资, 3.固定收益投资, 4.金融衍生品投资, 5.买入返售金融资产, 6.银行存款和结算备付金合计, 7.其他各项资产, 8.合计.

4.2 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.国家债券, 2.央行票据, 3.金融债券, 4.企业债券, 5.企业短期融资券, 6.中期票据, 7.其他, 8.合计.

4.3 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A.农林牧渔业, B.采矿业, C.制造业, 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, 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, J.金融业, 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, 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, 合计.

4.4 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.001989 中国重工, 2.000566 海南航空, 3.601318 中国平安, 4.600162 晋江控股, 5.600030 中信证券, 6.601628 中国人寿, 7.000800 一汽轿车, 8.600694 大成股份, 9.002230 科大讯飞, 10.600050 中国联通, 合计.

4.5 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.010308 03国债(8), 2.010107 21国债(7), 3.010501 05国债(1), 合计.

4.6 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Rows include 1.600694 大成股份, 合计.

4.7 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 209,910.82.

4.8 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.9 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.10 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.11 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.12 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.13 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.14 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.15 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.16 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.17 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.18 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.19 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.20 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.21 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

4.22 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 金额(元). Row: 1.存出保证金 169,644.97.

4.23 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1.存出保证金 169,644.97, 2.应收证券清算款 36,379,665.67, 3.应收股利, 4.应收利息 1,047,834.33, 5.应收申购款, 6.其他应收款, 7.待摊费用, 8.其他, 9.合计 77,380,395.25.

4.24 基金投资组合情况

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.110015 石化转债, 2.010308 03国债(8), 合计.

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
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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责任。
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2013年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (宝盈增强收益债券), 基金代码 (213007), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2008年5月15日), 报告期末基金份额总额 (771,440,857.03份), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 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), 下属证券投资基金的基金简称 (宝盈增强收益债券A/B/C), 下属证券投资基金的交易代码 (213007/213907/213907), 报告期末下属证券投资基金的份额总额 (649,679,590.98份 / 121,770,266.05份)

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日), 宝盈增强收益债券A/B, 宝盈增强收益债券C. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 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 for 过去三个月 and 过去三个月.

基金经理

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Rows include 陈若劭.

管理人