宝盈鸿利收益证券投资基金

2014 第二季度报告

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
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,659,261,055.12份
投资目标	为基金投资者谋求稳定的现金红利分配和长期资本增值收益,在投资收益率的波动小于或等于参照基准波动的条件下,争取更高的收益率。
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%。 在债券投资方面,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	风险水平和期望收益水平相对较高。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	10,883,514.65
2.本期利润	43,547,883.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0315
4.期末基金资产净值	1,040,012,829.56
5.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 本报告期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	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
过去三个月	4.69%	0.95%	1.83%	0.72%	2.86%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,只是边际效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。二季度,上证指数沪深300、深圳成指收益率为0.74%、0.88%、2.14%,本基金的收益率为4.69%,好于评价基准。

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4.69%,同期业绩比较基准收益率是1.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,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。总体上,操作策略上可能与二季度略有差异,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	其他资产	5,805,136.21	0.55
8	合计	1,064,141,338.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

5.3 报告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

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(%)
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
10	300084	海默科技	1,000,000	23,810,000.00	2.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	209,677,257.60	20.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	209,677,257.60	20.16

5.5 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债券投资明细

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(%)
1	018001	国开1301	839,360	85,866,528.00	8.26
2	010107	21国债(7)	688,370	69,387,696.00	6.67
3	018002	国开1302	517,920	54,423,033.60	5.23

5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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持有股指期货。
5.9.2 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。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除凯美特气外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。

报告期内本基金所投资的股票凯美特气公告披露,公司因隐瞒全资子公司长岭凯美特遭上游中石化长岭分公司"断气"而停产的事实,被湖南省证监局责令整改。

公司在收到监管函后,在中石化总公司的协调下,迅速与中石化长岭分公司举行了多次谈判,并取得初步结果。6月13日,公司公告:双方对相关内容已初步达成了一致的共识. 目前长岭分公司正在对该协议进行流程审批,待长岭分公司审批完成后,公司将及时公告协议具体事项. 现长岭凯美特处于开车运行前的生产准备状态,待接到长岭分公司向长岭凯美特供气的指令,随时可以投入生产运行。

我们认为,该事项是我国特有的体制内问题,并没有影响公司投资价值。当然公司在公司运营中,确有忽视中小股东知情权的事实。通过这件事情,公司认识到作为上市公众公司与普通公司的区别,提高了认识水平。我们继续看好公司的长期投资价值,因此在公告后未做减持。

5.11.2
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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	317,110.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,115,084.11
5	应收申购款	372,941.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,805,136.21

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	
序号	1,169,189,699.14
报告期期间基金总申购份额	568,618,978.64
减:报告期期间基金总赎回份额	78,547,622.66
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,659,261,055.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	15,863,874.35
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	15,863,874.35
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.96

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈鸿利收益证券投资基金设立的文件。
《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基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。
9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦15层
基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2014年7月18日

宝盈增强收益债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

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:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2014年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈增强收益债券	
基金主代码	213007	
交易代码	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	600,694,047.39份	
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。	
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股(含增发)申购以及二级市场股票投资之间的配置: ①基于对利率、信用等因素的分析,预测固定收益品种的风险和收益; ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断; ③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析,预测新股申购的风险和收益; ④股票市场走势的预测。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	213007	213917
下属两级基金的前端交易代码	213007	-
下属两级基金的后端交易代码	213907	-
报告期末下属两级基金的份额总额	488,400,918.78份	112,293,128.61份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
1.本期已实现收益	12,179,848.30	2,949,917.47
2.本期利润	14,107,483.94	2,972,778.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0293	0.0229
4.期末基金资产净值	572,694,613.43	128,591,148.64
5.期末基金份额净值	1.1726	1.1451

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 本报告期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

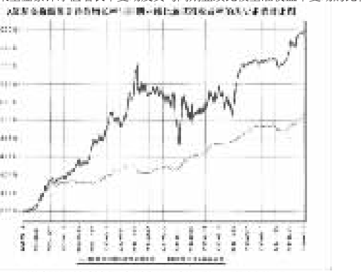
宝盈增强收益债券A/B

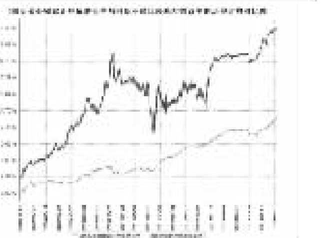
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.61%	0.12%	2.41%	0.04%	0.20%	0.08%

宝盈增强收益债券C

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
过去三个月	2.51%	0.12%	2.41%	0.04%	0.10%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、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。
2、本基金于2008年10月20日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈增强收益债券C"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2008年9月2日	-	11年	陈若劲女士, 香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度末,我们预期经济增速和通胀仍将低位徘徊,政策或将被迫由调结构转回稳增长,但是房地产、产能过剩等问题难有解决良策。货币政策将维持中性,利率市场化进程继续深化,货币市场资金价格将维持在央行正回购价格附近波动,对于债券市场谨慎乐观而对权益市场更加保守。

报告期内,经济基本面和政策面基本符合我们预期,债券市场走势也基本符合我们预期,但收益率下行幅度略超我们预期。具体来看,央行定向降准、再贷款等"微宽松"政策激发市场做多动能,全季度收益率明显下行,尤其是在5月。报告期内,我们在收益率下行过程中逐步降低仓位和久期,配置中短久期高评级信用债替代中长久期利率债。

报告期内,权益市场低位震荡,不管是大盘蓝筹股还是中小盘个股平均涨跌幅均较为有限。我们认为中小盘个股整体估值过高,风险收益比不大,而大盘股的投资机会也尚不明确。因此,本报告期内我们仅少量尝试性参与权益投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

增强收益A/B:本基金在本报告期内净值增长率是2.61%,同期业绩比较基准收益率是2.41%。

增强收益C:本基金在本报告期内净值增长率是2.51%,同期业绩比较基准收益率是2.41%。

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2014年三季度,我们判断随着"微刺激"政策的积累和发挥作用,经济增长和通货膨胀都可能出现阶段性回升,大宗商品价格陆续反弹也有利于巩固"微刺激"的效果,减少通缩风险,政策将转为保增长与调结构并重,预计财税改革、国企改革、利率市场化等方面均将有进一步突破。

我们对债券类资产配置较为谨慎。经济基本面企稳使得央行进一步加大货币政策宽松度的必要性明显下降,季节性资金需求扩张以及IPO数量的增加也将使得三季度资金价格中枢较二季度上移。在上半年已累积可观涨幅的背景之下,三季度债券市场收益率进一步下行动力有限,我们将在控制回撤风险的前提下配置中高评级信用品种以获得稳定的持有收益。

我们对权益类资产配置谨慎乐观,经济的阶段性好转有利于权益市场人气的恢复,随着IPO发行逐步常态化,边际冲击将逐步减弱,部分低估值型品种具备一定配置价值。我们将耐心等待市场机会出现,择机选择基本面良好、符合国家产业政策的优质公司参与投资。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,111,339.36	1.88
	其中:股票	15,111,339.36	1.88
2	固定收益投资	773,650,256.32	96.27
	其中:债券	773,650,256.32	96.27
	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	3,682,521.44	0.46
7	其他资产	11,155,111.35	1.39
8	合计	803,599,228.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
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	15,111,339.36	2.15
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	15,111,339.36	2.15

5.3 报告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

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(%)
1	600030	中信证券	1,318,616	15,111,339.36	2.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	212,582,000.00	30.31
	其中:政策性金融债	151,850,000.00	21.65
4	企业债券	411,038,256.32	58.61
5	企业短期融资券	100,075,000.00	14.27
6	中期票据	49,955,000.00	7.12
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	773,650,256.32	110.32

5.5 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债券投资明细

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(%)
1	1426001	14三井住友债	600,000	60,732,000.00	8.66
2	122289	13日照港	563,400	57,466,800.00	8.19
3	112054	11鄂能债	562,200	56,472,990.00	8.05
4	120490	04南网(2)	553,960	56,393,128.00	8.04
5	140208	14国开08	500,000	50,850,000.00	7.25

5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 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。
5.9.2 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持有国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,380.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,010,583.04
5	应收申购款	102,147.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,155,111.35

5.10.4 报告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可转换债券。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。
5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	463,883,689.29	112,019,235.48
报告期期间基金总申购份额	32,456,712.80	154,439,438.39
减:报告期期间基金总赎回份额	7,939,483.31	154,165,545.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	488,400,918.78	112,293,128.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的文件。
《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金合同》。
《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。
9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦15层
基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2014年7月18日

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2014 第二季度报告

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:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2014年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈中证100指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月8日
报告期末基金份额总额	67,372,412.43份
投资目标	在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.75%,基金总体投资业绩超越中证100指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分采用完全复制法,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术,适当参与金融衍生产品的投资。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的80%,预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金,属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-286,422.38
2.本期利润	491,855.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0072
4.期末基金资产净值	45,713,605.53
5.期末基金份额净值	0.679

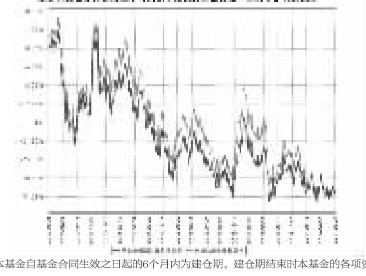
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	1.19%	0.85%	0.76%	0.86%	0.43%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
温胜普	本基金基金经理	2010年2月8日	-	8年	温胜普先生,经济学硕士。2006年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任金融工程部风险管理岗, 现任宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理。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、宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理	2013年8月23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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,只是边际效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高位水平,结构上在复制中证100指数权重的基础上,配置机械设备、农业、环保等行业进行增强型投资。二季度,上证指数收益率为0.74%,中证100指数收益率为0.79%,本基金的收益率为1.19%,好于评价基准。

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1.19%,同期业绩比较基准收益率是0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,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。总体看,以中证100为代表的大盘股,可能迎来较好的相对收益阶段。

我们将严格按照基金合同的规定,被动投资为主,适当辅之以增强型投资,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	43,068,655.13	93.69
	其中:股票	43,068,655.13	93.69
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	2,890,361.81	6.29
7	其他资产	10,130.74	0.02
8	合计	45,969,147.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,131,324.00	4.66
C	制造业	11,204,578.09	24.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,108,685.00	2.43
E	建筑业	1,326,292.00	2.90
F	批发和零售业	360,800.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	874,760.00	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	573,963.00	1.26
J	金融业	18,150,679.40	39.71
K	房地产业	1,505,283.00	3.29
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	201,670.00	0.44
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	268,866.00	0.59
	合计	37,706,900.49	82.49

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	835,200.00	1.83
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,718,354.64	8.13
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	808,200.00	1.77
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	5,361,754.64	11.73

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资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

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(%)
1	601318	中国平安	56,200	2,210,908.00	4.84
2	600036	招商银行	194,000	1,986,560.00	4.35
3	600016	民生银行	308,400	1,915,164.00	4.19
4	601166	兴业银行	138,000	1,384,140.00	3.03
5	600000	浦发银行	135,000	1,221,750.00	2.67
6	600030	中信证券	90,000	1,031,400.00	2.26
7	000002	万 科A	116,400	962,628.00	2.11
8	601398	工商银行	280,000	949,200.00	2.08
9	601288	农业银行	360,000	907,200.00	1.98
10	600837	海通证券	97,000	887,550.00	1.94

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(%)
1	000970	中科三环	100,000	1,188,000.00	2.60
2	002698	博实股份	39,942	995,354.64	2.18
3	002535	林州重机	100,000	838,000.00	1.83
4	002041	登海种业	30,000	835,200.00	1.83
5	002549	凯美特气	60,000	808,200.00	1.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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持有股指期货。
5.9.2 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。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1

报告期内,本基金投资的前十名证券发行主体中除中国平安、招商银行、民生银行外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。

2013年10月14日中国平安公告,其控股子公司平安证券有限责任公司近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2013]48号)。中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元,并处以人民币 5,110 万元的罚款,暂停其保荐业务许可3 个月。2013年10月22日,中国银行间市场交易商协会发布自律处分信息:江苏汇鸿国际集团有限公司在债务融资工具存续期间未合规披露子公司中融信借对外担保信息,民生银行作为主承销商在尽职调查中未将中融信借对外担保情况作为或有事项进行专项了解,亦未辅导企业在募集说明书中披露上述情况,给予主承销商招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。2013年12月10日,中国银行间市场交易商协会发布自律处分信息:林州重机集团股份有限公司在债务融资工具存续期间涉及重大事项信息披露延迟及持有人会议延迟召开等情形,招商银行作为主承销商在后续管理工作中未充分尽职履责,给予主承销商招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

中国平安、招商银行、民生银行为本基金的指数成分股,本基金管理人基本按照上述成分股所占的权重进行相应配置,符合相关法规和基金投资策略的要求。

5.11.2
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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,187.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	588.62
5	应收申购款	4,355.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,130.74

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。
5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	70,755,262.89
报告期期间基金总申购份额	3,524,875.06
减:报告期期间基金总赎回份额	6,907,725.52
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	67,372,412.43

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,870,659.08
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,870,659.08
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	10.20

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈中证100指数增强型证券投资基金设立的文件。
《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同》。
《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。
9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦15层
基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2014年7月18日