

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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

7.1 资产负债表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 资产, 负债, 所有者权益.

7.1.1 基金份额持有人数量及持股集中度
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 基金份额持有人数量, 前十名持有人持有基金份额.

7.1.2 基金份额持有人数量及持股集中度
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 基金份额持有人数量, 前十名持有人持有基金份额.

7.2 基金业绩比较基准
宝盈中证100指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 中证100指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

7.3 基金管理人及基金托管人
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

7.4 基金投资策略
本基金为增强型指数基金,对指数成份股采用完全复制,跟踪中证100指数的中短期波动,并在此基础上进行适度超额收益追求。

Table with columns: 项目, 2015年, 2014年, 2013年. Rows include 1.1 期初基金份额, 1.2 本期申购, 1.3 期末基金份额.

Table with columns: 阶段, 基金份额增长率, 业绩比较基准增长率, 超额收益. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.



注:本基金业绩比较基准为:中证100指数×80%+上证国债指数×20%。
2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 1. 基金份额持有人数量, 2. 基金份额持有人集中度.

7.1 基金基本情况
基金名称:宝盈中证100指数增强型证券投资基金
基金代码:000002

7.2 基金业绩比较基准
宝盈中证100指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 中证100指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

7.3 基金管理人及基金托管人
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

7.4 基金投资策略
本基金为增强型指数基金,对指数成份股采用完全复制,跟踪中证100指数的中短期波动,并在此基础上进行适度超额收益追求。

7.5 基金费用
基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提。
基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提。

7.6 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或红利再投资。
7.7 基金资产净值
截至2015年12月31日,本基金资产净值为人民币1,169,736,928.99元。

7.8 基金投资组合
7.8.1 期末投资组合行业分布
7.8.2 期末投资组合品种分布

7.9 基金管理人及基金托管人
7.9.1 基金管理人
7.9.2 基金托管人

7.10 基金投资策略
7.10.1 资产配置策略
7.10.2 股票投资策略

7.1.1 基金份额持有人数量及持股集中度
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 基金份额持有人数量, 前十名持有人持有基金份额.

7.1.2 基金份额持有人数量及持股集中度
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 基金份额持有人数量, 前十名持有人持有基金份额.

7.2 基金业绩比较基准
宝盈中证100指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 中证100指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

7.3 基金管理人及基金托管人
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

7.4 基金投资策略
本基金为增强型指数基金,对指数成份股采用完全复制,跟踪中证100指数的中短期波动,并在此基础上进行适度超额收益追求。

7.5 基金费用
基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提。
基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提。

7.6 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或红利再投资。
7.7 基金资产净值
截至2015年12月31日,本基金资产净值为人民币1,169,736,928.99元。

7.8 基金投资组合
7.8.1 期末投资组合行业分布
7.8.2 期末投资组合品种分布

7.9 基金管理人及基金托管人
7.9.1 基金管理人
7.9.2 基金托管人

7.10 基金投资策略
7.10.1 资产配置策略
7.10.2 股票投资策略

7.11 基金业绩比较基准
宝盈中证100指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 中证100指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

7.12 基金管理人及基金托管人
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

7.13 基金投资策略
本基金为增强型指数基金,对指数成份股采用完全复制,跟踪中证100指数的中短期波动,并在此基础上进行适度超额收益追求。

7.14 基金费用
基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提。
基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提。

7.1.1 基金份额持有人数量及持股集中度
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 基金份额持有人数量, 前十名持有人持有基金份额.

7.1.2 基金份额持有人数量及持股集中度
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度末. Rows include 基金份额持有人数量, 前十名持有人持有基金份额.

7.2 基金业绩比较基准
宝盈中证100指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 中证100指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

7.3 基金管理人及基金托管人
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

7.4 基金投资策略
本基金为增强型指数基金,对指数成份股采用完全复制,跟踪中证100指数的中短期波动,并在此基础上进行适度超额收益追求。

7.5 基金费用
基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提。
基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提。

7.6 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或红利再投资。
7.7 基金资产净值
截至2015年12月31日,本基金资产净值为人民币1,169,736,928.99元。

7.8 基金投资组合
7.8.1 期末投资组合行业分布
7.8.2 期末投资组合品种分布

7.9 基金管理人及基金托管人
7.9.1 基金管理人
7.9.2 基金托管人

7.10 基金投资策略
7.10.1 资产配置策略
7.10.2 股票投资策略

7.11 基金业绩比较基准
宝盈中证100指数增强型证券投资基金业绩比较基准: 中证100指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

7.12 基金管理人及基金托管人
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

7.13 基金投资策略
本基金为增强型指数基金,对指数成份股采用完全复制,跟踪中证100指数的中短期波动,并在此基础上进行适度超额收益追求。

7.14 基金费用
基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提。
基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提。

7.15 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或红利再投资。
7.16 基金资产净值
截至2015年12月31日,本基金资产净值为人民币1,169,736,928.99元。

7.17 基金投资组合
7.17.1 期末投资组合行业分布
7.17.2 期末投资组合品种分布

1.2.2 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期资产占比, 占期末资产净值比例.

1.2.3 期末投资组合品种分布
单位:人民币元

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

1.3 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例.

1.4 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

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

1.5 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例.

1.6 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例.

1.7 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例.

1.8 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例.

1.9 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例.

1.10 期末投资组合行业分布
单位:人民币元

5.6 审计报告
5.7 年度财务报表

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日计提并每月支付。

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日计提并每月支付。

注:本基金管理人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日计提并每月支付。