鸿阳证券投资基金

【2013】第四季度报告

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1月22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1月21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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈鸿阳封闭
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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
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。
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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	16,551,914.51
2.本期利润	22,615,729.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0113
4.期末基金资产净值	1,623,104,919.14
5.期末基金份额净值	0.8116

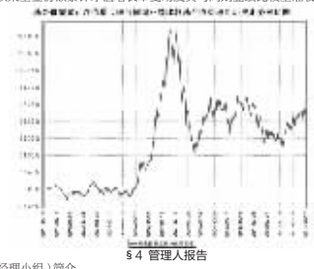
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.42%	2.95%	-	-	-	-

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



§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		
杨凯	本基金基金经理兼副总经理	2013年2月5日	-	9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。

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

本基金总体认为证券市场四季度在风格上相对比较平衡,故在投资运作整体以逆向操作为主,在大盘股反弹过程中适当减持了金融、汽车、公用事业等个股,清仓了部分持有较少的品种。增持了机械、计算机、医药、建筑等行业个股,这些个股主要是基于至下而上个股选择的思路,同时考虑了行业景气的思考,如博实股份、东方国信、千红制药等。本基金四季度收益1.42%,高于HS300收益率-3.28%。

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1.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们仍然认为“在一个转型期的经济周期,我们更多是看到经济的窄幅波动甚至温和下行,直到新经济增长点的出现”。目前利率市场化不断推进,市场资金整体偏紧,融资成本抬升,而央行仍然保持紧平衡的调控格局。同时在调整经济结构的背景下,投资依赖型行业发展面临较大的困难。我们认为2014年整体市场机会不大,但结构性行情存在,就更长的投资周期而言,随着房地产投资价值的减弱,我们认为权益类资产面临更好的投资机会。

我们仍然会坚持精选个股的投资策略,寻找景气的细分行业,并寻找真正获益的优质公司。一个公司的成长,无非是所在行业的持续增长或者市场份额的提升,以及规模化带来的成本优势。选择一个好标的,更多是在做行业研究,选择那些未来3-5年有可能持续增长的行业,投资其中的龙头公司,或者在一个稳定增长的行业中,选出那些有可能份额持续提升的公司。

从具体的行业和标的来看,强周期行业仍然很难有较大的投资机会,基于景气行业的投资、改革预期等投资机会仍然层出不穷。包括环保、工业自动化、软件、通信、智能电网、汽车、LED、食品饮料、互联网等公司;主题投资机会中国企改革、军工等。

我们认为优秀基金经理的主要素质包括,高尚的品德、良好的专业素养和勤奋进取的精神。我们将一贯努力,勤勉尽责,力争为持有人创造良好的收益。

§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	1,240,134,911.59	75.86
	其中:股票	1,240,134,911.59	75.86
2	固定收益投资	326,320,163.10	19.96
	其中:债券	326,320,163.10	19.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	64,682,735.71	3.96
6	其他资产	3,642,057.44	0.22
7	合计	1,634,779,867.84	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	659,366,824.18	40.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	61,829,825.00	3.81
F	批发和零售业	89,124,425.81	5.49
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	207,294,547.68	12.77
J	金融业	43,275,485.00	2.67
K	房地产业	26,750,167.50	1.65
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	107,836,236.42	6.64
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	44,657,400.00	2.75
S	综合	-	-
	合计	1,240,134,911.59	76.41

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	6,975,177	107,836,236.42	6.64
2	002230	科大讯飞	1,503,023	71,919,650.55	4.43
3	002698	博实股份	2,189,661	64,704,482.55	3.99
4	300166	东方国信	2,201,977	59,871,754.63	3.69
5	002550	千红制药	1,604,579	56,673,730.28	3.49
6	600978	宜华木业	8,162,252	46,769,703.96	2.88
7	002589	瑞康医药	891,010	45,156,386.80	2.78
8	600880	博瑞传播	2,630,000	44,657,400.00	2.75
9	600418	江淮汽车	4,995,697	43,612,434.81	2.69
10	600703	三安光电	1,702,569	42,206,685.51	2.60

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	227,485,163.10	14.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,835,000.00	6.09
	其中:政策性金融债	98,835,000.00	6.09
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	326,320,163.10	20.10

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	010303	03国债(3)	1,669,390	150,044,773.20	9.24
2	090205	09国开05	700,000	69,335,000.00	4.27
3	019302	13国债02	505,240	50,539,157.20	3.11
4	110212	11国开12	200,000	19,620,000.00	1.21
5	010107	21国债(7)	133,610	13,006,933.50	0.80

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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投资股指期货。

5.8.2 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。

5.9 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投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	401,120.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,240,937.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,642,057.44

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处于转股期的可转换债券。

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 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	5,000,000.00
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	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.25

6.2 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。

§7 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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳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。

8.2 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

8.3 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1月22日

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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1月22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1月21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2013年10月1日起至12月31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	72,728,993.37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。采用利率期限、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x95%+活期存款利率(税后)x5%
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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,174,526.87
2.本期利润	-758,382.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0104
4.期末基金资产净值	51,359,711.46
5.期末基金份额净值	0.706

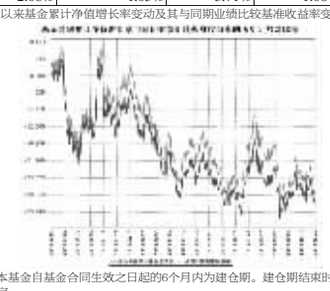
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.08%	1.05%	-3.71%	1.08%	1.63%	-0.03%

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	-	7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	2013年8月23日	-	6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,总体稳中有余,弹性不足,调结构越来越得到市场共识,投资增速的下行趋势也没有太多的分歧,关注点仍主要在改革的落实和长期经济合理增速。流动性方面,12月下旬再现资金高度紧张状况,在房地产和基建对资金需求依然旺盛的情况下,货币政策难言放松,总体的流动性环境并未发生重大改变。整个四季度依然呈现出结构性机会:低估值、行业并无趋势性风险的家电、汽车表现较为突出;热门板块如传媒等在获利丰厚的背景下,回调明显;十八届三中全会表态深化改革后,国防军工、农林牧渔主题表现抢眼。风格上,创业板、中小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、环保、电子、医药等行业进行增强型投资。整个四季度看,上证指数收益率为-2.70%,中证100指数收益率为-3.92%,本基金四季度的收益率为-2.08%,好于同期业绩比较基准。

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-2.08%,同期业绩比较基准收益率是-3.71%。

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,总体上怀有积极的心态,但并不盲目乐观。积极的心态,主要来自于十八届三中全会后,部分领域的改革将由主题预期转向政策的落实,其中必定诞生部分投资机会;其次,经济的调结构势在必行,环保、安全(国防安全、信息安全、社会安全等)、能源结构调整(油服装备尤其是非常规能源)、劳动力结构调整(工业自动化)、互联网等都将是长期投资关注的重点;最后,对部分无趋势性行业风险(亦即非趋势性下行或政策不明)、估值和业绩匹配较佳的个股,也将是重点关注的领域。不可盲目乐观的原因,主要是目前的创业板估值相比业绩增速,短期难有更大的吸引力,同时还面临IPO开闸后的供应量增加,再加上对流动性并不乐观的预期,希望能有合理的调整后,市场将会更加健康。从大的经济背景来看,长期仍将主要精力关注在中小板、创业板等经济调结构受益个股,只是出现整个板块普涨的频率将降低,越来越考验投资人员的选股能力。

预计一季度市场将呈现弱势震荡走势,重点挖掘IPO开闸后的优质个股,同时关注有高送配预期、年报业绩超预期及一季度高增长的公司。

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	47,922,141.61	92.83
	其中:股票	47,922,141.61	92.83
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,652,251.54	7.08
6	其他资产	47,161.39	0.09
7	合计	51,621,554.54	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	2,866,631.00	5.58
C	制造业	12,050,708.61	23.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,151,422.00	2.24
E	建筑业	1,506,652.00	2.93
F	批发和零售业	487,620.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	1,021,000.00	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	610,186.00	1.19
J	金融业	19,590,908.00	38.14
K	房地产业	1,576,306.00	3.07
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	247,510.00	0.48
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	351,348.00	0.68
	合计	41,460,291.61	80.73

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	-	-
B	采矿业	577,850.00	1.13
C	制造业	3,164,500.00	6.16
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	1,541,500.00	3.00
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	559,600.00	1.09
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	618,400.00	1.20
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	6,461,850.00	12.58

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	58,500	2,441,205.00	4.75
2	600036	招商银行	202,000	2,199,780.00	4.28
3	600016	民生银行	276,000	2,130,720.00	4.15
4	601166	兴业银行	140,000	1,419,600.00	2.76
5	600000	浦发银行	137,000	1,291,910.00	2.52
6	600030	中信证券	88,500	1,128,375.00	2.20
7	600837	海通证券	99,300	1,124,076.00	2.19
8	601398	工商银行	299,650	1,072,747.00	2.09
9	000651	格力电器	29,500	963,470.00	1.88
10	000002	万 科A	118,400	950,752.00	1.85

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	002535	林州重机	220,000	1,562,000.00	3.04
2	002698	博实股份	30,000	886,500.00	1.73
3	600713	南京医药	150,000	792,000.00	1.54
4	600998	九州通	50,000	749,500.00	1.46
5	002635	安洁科技	20,000	716,000.00	1.39

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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投资股指期货。

5.8.2 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。

5.9 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投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形:

报告期内,本基金投资的前十名证券发行主体中招商银行、民生银行、林州重机在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,中国平安控股子公司平安证券有限责任公司受到中国证监会行政处罚。其他前十名证券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。

中国平安2013年5月21日公告,其控股子公司平安证券有限责任公司因万福生科发行上市项目受到中国证监会行政处罚,没收项目收入2555万元,罚款5110万元,暂停其保荐机构资格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佳对外担保信息,民生银行作为主承销商在尽职调查中未将中融信佳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,给予主承销商民生银行诫勉谈话处分,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,给予林州重机通报批评处分,并处责令改正;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。林州重机被通报批评事项占公司的资产比例较低,且属方式不合规并非本质问题;总体看,该事项并不影响公司的投资价值,传统煤机业务提供了价值基础,新兴的服务、金融业务带来了估值提升。

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	13,362.77
2	应收证券清算款	21,776.15
3	应收股利	-
4	应收利息	801.38
5	应收申购款	11,221.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,161.39

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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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。

5.10.5.2 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	76,512,631.69
报告期期间基金总申购份额	17,014,398.57
减:报告期期间基金总赎回份额	20,798,036.89
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	72,728,993.37

§7 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1月22日

宝盈资源优选股票型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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1月22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1月21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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈资源优选股票
基金主代码	213008
交易代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月15日
报告期末基金份额总额	334,637,067.26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,处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值,相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型,优选各个行业中具有资源优势的上市公司,建立股票池。在严格控制投资风险的前提下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	本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投