

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  
送出日期:2014年8月28日

9.1 重要提示

1.1 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、完整性、及时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。

基金管理人:中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月27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。

基金管理人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半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

9.2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈中证100指数增强型证券投资基金
基金代码	213010
交易账户	213010
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日 2010年2月18日

基金资产总值 67,372,412.43元

基金合同存续期 不定期

## 2.2 基金产品说明

在基金合同规定的范围内,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理,精选具有稳定收益的主动管理的,力争取收益净值的净增长率为每年不低于7.5%。基金在合同期内通过投资于中证100指数的股票,按成比例地实现中证100指数的基准回报和指数化投资组合,并根据股票的指数成份及其权重的变动进行相应的调整。本基金的主动投资部分实行指数化投资策略,并根据股票的指数成份及其权重的变动,按一定的比例进行调整,以期获得与中证100指数的股票的收益。

本基金在合同期内通过投资于中证100指数的股票及成份股的比例不低于基金资产的90%,预期风险收益高于货币基金、债券基金和货币市

场基金,属于较高风险收益特征的证券投资基金。

## 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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人 姓氏: 邓青

联系电话: 0755-82766888 010-67595096

电子邮箱: zhongguo@byfunds.com

客户服务电话: 400-8888-300 010-67595096

传真: 0755-83515599 010-66275853

## 2.4 信息披露方式

基金年度报告应当在基金管理人网站上公告: www.bfunds.com

基金年度报告应当在基金托管人网站上公告: 基金托管人:中国建设银行

## 2.5 主要财务指标和基金净值表现

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 报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)

基金期初总资产 -44,592.99

基金期初总负债 -1,974,446.34

加权平均基金份额净值 0.0282

本期基金净值增长率 -3.82%

3.1.2 数额和百分比

报告期(2014年6月30日)

股票投资比例 0.3215

债券投资比例 45,713,605.53

货币市场基金投资比例 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.所列基金净值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 (%) 份额净值 增长 率 (%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.19% 0.74% -0.21% 0.73% 1.40% 0.01%

过去二个月 -3.82% 0.97% -7.11% 0.99% 3.29% -0.02%

过去一年 2.11% 1.12% -4.17% 1.15% 6.28% -0.03%

过去三年 -23.19% 1.19% -27.74% 1.23% 4.55% -0.04%

基金份额净值 -32.10% 1.26% -32.60% 1.28% 0.50% -0.02%

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的比较

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

62. 利润表

会计主体:宝盈中证100指数增强型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

3.2.3 本期利润

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

3.2.4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其基金经理的经验

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8月18日成立,注册资本为人民币1亿元,法定代表人为陈永华,公司住所为深圳市深南大道3012号中国建设银行大厦15层,办公地址为深圳市深南大道3012号中国建设银行大厦15层。本公司目前管理基金规模:宝盈红利收益混合、宝盈沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈增强收益债券、宝盈货币投资基金、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、宝盈祥瑞养老混合十一只基金,公司恪守价值投资的投资理念,并逐渐形成股票、债券和货币基金的投资风格。公司汇聚了一批从事宏观经济、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,公司的基金管理具有丰富的证券市场投资经验,以自己的专业知识和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助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

陈永华 基金经理 2010年2月8日 -

注:1.温胜晋为前任基金经理,其“任职日期”按基金合同同生效日填写;

2.张仁非为前任基金经理,其“任职日期”按指派本公司决定确定的聘任日期;

3.证券业协会的含义从行业自律组织的从业人员资格管理办法的相关规定,证券从业人员的任职日期以证券业协会的从业人员资格管理办法的有关规定为准。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信的说明

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,为基金持有人谋取最大利益。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违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金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指导意见》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、同向交易差价、反向交易差价等专项分析。报告结果显示,本基金在报告期内同向交易差价率均在合理范围内,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违规行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发现有异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的经营业绩的说明

4.4.1 基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,经济层面,依然面临一些不利的因素,关注国家保增长的政策预期,中央高层也频频表态稳经济。

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。

重要经济指标如GDP、CPI、PPI等指标表现不佳,中长期看,经济增速将有下降可能,“新常态”

中,房地产市场的走势比较关键,目前房地产建设仍是投资的主要手段,但很难独领风骚。

经济方面,经济形势依然严峻,但政策预期较好,对经济稳增长有支撑作用,对经济稳增长有支撑作用。

经济方面,经济形势依然严峻,但政策预期较好,对经济稳增长有支撑作用。

经济方面,经济形势依然严峻,但政策预期较好,对经济稳增长