

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

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：2015 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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 2015 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
7.8 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贵金属投资明细.....	35
7.9 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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 投资组合报告附注.....	36

§8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	38
§9 开放式基金份额变动	38
§10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 备查文件目录	44
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 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
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
报告期末基金份额总额	268,987,789.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518034	100033

法定代表人	李文众	王洪章
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

§ 3 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	57,444,478.12
本期利润	41,913,852.92
加权平均基金份额本期利润	0.1273
本期加权平均净值利润率	10.41%
本期基金份额净值增长率	16.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	32,057,159.19
期末可供分配基金份额利润	0.1192
期末基金资产净值	350,998,861.00
期末基金份额净值	1.305
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	30.50%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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

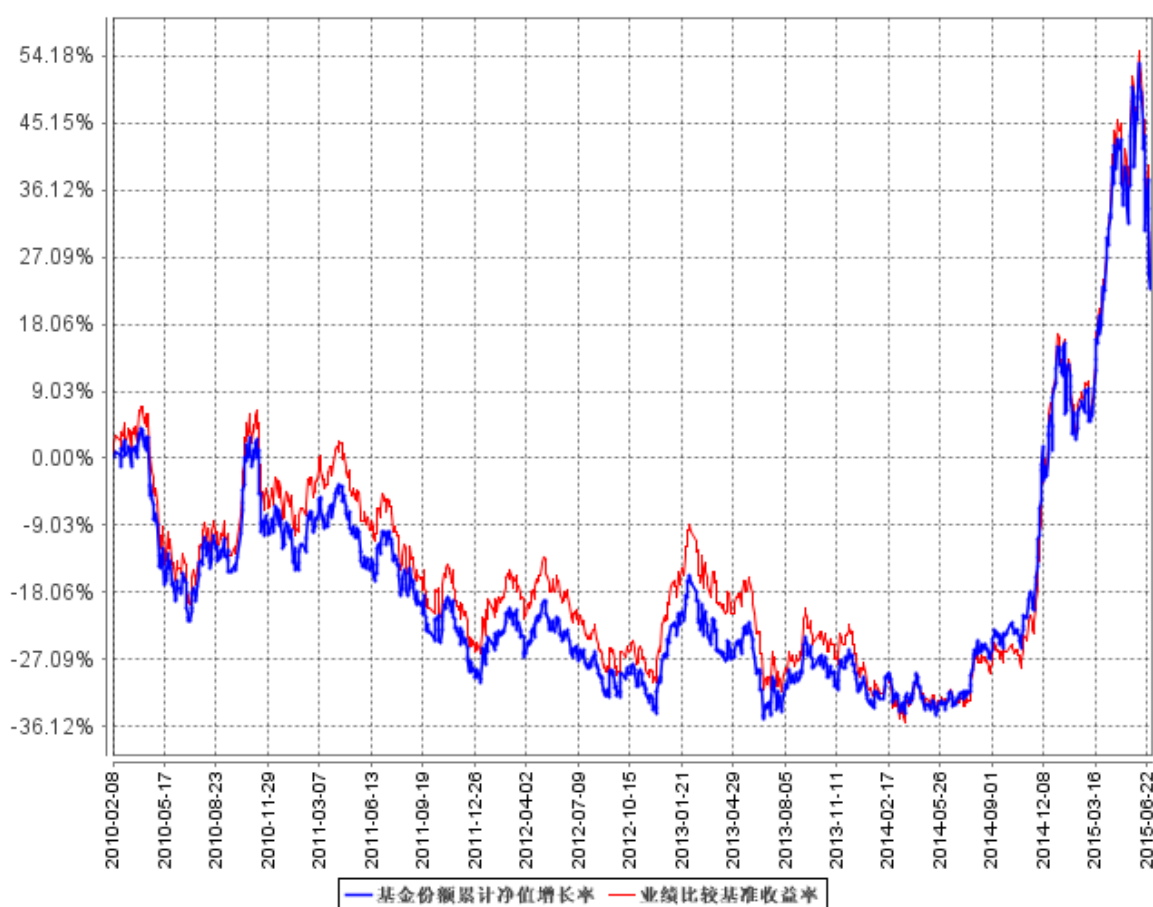
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-6.32%	3.13%	-6.02%	3.22%	-0.30%	-0.09%
过去三个月	7.41%	2.44%	8.04%	2.45%	-0.63%	-0.01%
过去六个月	16.31%	2.22%	16.58%	2.22%	-0.27%	0.00%
过去一年	92.19%	1.81%	95.95%	1.86%	-3.76%	-0.05%
过去三年	75.88%	1.44%	67.01%	1.48%	8.87%	-0.04%
自基金合同生效起至今	30.50%	1.38%	31.83%	1.41%	-1.33%	-0.03%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选股票、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、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合十七只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、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，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识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（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 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	-	9 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。

注：1. 温胜普为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2015 年 6 月 30 日。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2015 年上半年 CPI 同比涨幅稳定在低位运行，而 PPI 同比涨幅则继续处于负值且有扩大的趋势，规模以上工业增加值累计同比增速继续缓慢回落，各类经济数据显示经济增长疲弱。2015 年上半年，央行货币政策从去年的定向操作转向普惠，年内共进行了三次降息，两次降准，有效压低了短期流动性价格，对降低社会融资成本也起到了一定的作用。在宽松的流动性环境下，在市场对国有企业改革、新兴产业崛起的强烈预期作用下，2015 年上半年权益市场出现了大幅上涨。而在 6 月中旬以后，由于市场对前期涨幅过高的担忧、对杠杆资金占比过大的恐慌，导致了市场流动性匮乏，权益市场出现了快速而大幅的回落。

报告期内，除受规模变动影响外，本基金的股票仓位基本维持在高位水平，结构上以复制中证 100 指数权重为主。此外运用小部分仓位进行增强投资，增强投资部分以金融、地产、交通运输等行业为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.305 元。本基金在本报告期内净值增长率是 16.31%，同期业绩比较基准收益率是 16.58%。

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 2015 年下半年，从实体经济领域看，房地产投资企稳，基建投资继续发力，宏观经济将出现底部企稳的迹象。从政策领域看，央行货币政策的宽松趋势不改，未来仍有较大降息、降准空间。全市场利率有望继续下行，这将继续降低企业的融资成本，实体经济流动性有望明显改善。政府继续重视改革转型，扶持新兴产业发展，以期实现经济的高质量增长。

这些宏观和政策因素都有利于权益市场的稳定。但是市场虽经过 6 月中旬到 7 月上旬的大幅调整，仍有不少证券面临估值偏高、流动性偏差的问题，市场的短期走势仍受投资者情绪、杠杆资金的进退、政府救市政策的演变发展等多方面因素的影响，这一过程仍具有较大的不确定性。

综上所述，我们认为 2015 年下半年权益市场将呈现宽幅震荡的走势，业绩增速较高、估值合理的板块值得重点关注，结构上相对看好大金融、国企改革等板块的投资机会，并关注具有真正成长性的新兴产业个股。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,004,157.78	15,064,161.41
结算备付金		201,270.67	160,017.77
存出保证金		285,983.64	11,235.57
交易性金融资产	6.4.7.2	328,237,970.45	294,761,244.40
其中：股票投资		312,242,110.45	284,611,713.40
基金投资		-	-
债券投资		15,995,860.00	10,149,531.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-

应收利息	6.4.7.5	500,422.80	180,590.04
应收股利		-	-
应收申购款		41,066,498.73	77,935,905.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		395,296,304.07	388,113,154.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		16,100,000.00	9,900,000.00
应付证券清算款		12,332,272.55	1,770,297.12
应付赎回款		15,049,523.12	15,986,007.29
应付管理人报酬		199,242.46	147,663.44
应付托管费		39,848.50	29,532.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	336,273.80	246,963.26
应交税费		-	-
应付利息		742.39	397.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	239,540.25	119,874.90
负债合计		44,297,443.07	28,200,735.78
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	268,987,789.62	320,639,832.08
未分配利润	6.4.7.10	82,011,071.38	39,272,586.88
所有者权益合计		350,998,861.00	359,912,418.96
负债和所有者权益总计		395,296,304.07	388,113,154.74

注：本报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.305 元，基金份额总额 268,987,789.62 份。

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		45,435,344.69	-1,556,021.97
1.利息收入		405,158.15	11,663.29

其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,924.71	11,663.29
债券利息收入		318,233.44	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		59,186,492.13	356,383.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	56,402,443.75	-244,517.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	115,961.48	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,668,086.90	600,900.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,530,625.20	-1,929,853.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,374,319.61	5,784.17
减：二、费用		3,521,491.77	418,424.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,484,146.59	176,819.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	296,829.32	35,363.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,506,896.03	22,944.50
5. 利息支出		40,622.14	-
其中：卖出回购金融资产支出		40,622.14	-
6. 其他费用	6.4.7.20	192,997.69	183,296.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,913,852.92	-1,974,446.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,913,852.92	-1,974,446.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	320,639,832.08	39,272,586.88	359,912,418.96
二、本期经营活动产生的基金净	-	41,913,852.92	41,913,852.92

值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-51,652,042.46	824,631.58	-50,827,410.88
其中: 1.基金申购款	865,174,360.01	205,389,338.63	1,070,563,698.64
2.基金赎回款	-916,826,402.47	-204,564,707.05	-1,121,391,109.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	268,987,789.62	82,011,071.38	350,998,861.00
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	72,728,993.37	-21,369,281.91	51,359,711.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,974,446.34	-1,974,446.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-5,356,580.94	1,684,921.35	-3,671,659.59
其中: 1.基金申购款	8,368,510.82	-2,647,549.54	5,720,961.28
2.基金赎回款	-13,725,091.76	4,332,470.89	-9,392,620.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	67,372,412.43	-21,658,806.90	45,713,605.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>汪钦</u>	<u>胡坤</u>	<u>何瑜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1218号《关于核准宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 281,223,192.88 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 029 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝

盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2010 年 2 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 281,241,387.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,194.77 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证 100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金标的指数使用费由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除财务报表附注 6.4.5.2 之外，本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除

外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

自 2015 年 3 月 27 日起, 本公司对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整, 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。2015 年 3 月 27 日, 相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.5%。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	25,004,157.78
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	25,004,157.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	281,136,217.00	312,242,110.45	31,105,893.45
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,074,110.93	15,995,860.00
	银行间市场	-	-
	合计	16,074,110.93	15,995,860.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	297,210,327.93	328,237,970.45	31,027,642.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	1,644.26
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	90.64
应收债券利息	498,078.91
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	480.29
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	128.70
合计	500,422.80

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	336,273.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	336,273.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付赎回费	56,519.95
预提费用	183,020.30
合计	239,540.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	320,639,832.08	320,639,832.08
本期申购	865,174,360.01	865,174,360.01
本期赎回(以“-”号填列)	-916,826,402.47	-916,826,402.47
本期末	268,987,789.62	268,987,789.62

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-29,400,056.42	68,672,643.30	39,272,586.88
本期利润	57,444,478.12	-15,530,625.20	41,913,852.92
本期基金份额交易产生的变动数	4,012,737.49	-3,188,105.91	824,631.58
其中：基金申购款	-34,910,605.12	240,299,943.75	205,389,338.63
基金赎回款	38,923,342.61	-243,488,049.66	-204,564,707.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,057,159.19	49,953,912.19	82,011,071.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	74,522.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,194.02
其他	2,208.26
合计	86,924.71

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	513,358,847.85
减：卖出股票成本总额	456,956,404.10
买卖股票差价收入	56,402,443.75

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,431,184.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,067,111.17
减：应收利息总额	248,111.54
买卖债券差价收入	115,961.48

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,668,086.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,668,086.90

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-15,530,625.20
——股票投资	-15,472,283.27
——债券投资	-58,341.93
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-15,530,625.20

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	692,868.28
转换费	681,451.33
合计	1,374,319.61

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,506,896.03
银行间市场交易费用	-
合计	1,506,896.03

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,767.52
银行间帐户维护费	9,000.00
银行汇划费用	5,477.39
合计	192,997.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,484,146.59	176,819.71
其中：支付销售机构的客户维护费	264,199.55	39,194.13

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	296,829.32	35,363.95

注：支付基金托管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，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间市场交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2010 年 2 月 8 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	6,870,659.08	6,870,659.08
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	6,870,659.08	-
期末持有的基金份额	-	6,870,659.08
期末持有的基金份额	-	10.2000%

占基金总份额比例		
----------	--	--

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度可比报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	25,004,157.78	74,522.43	2,890,361.81	11,390.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600900	长江电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项	14.35	-	-	180,400	1,903,954.25	2,588,740.00	-
600886	国投电力	2015 年 6 月 24 日	重大事项	14.87	-	-	124,800	1,462,346.11	1,855,776.00	-
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大事项	36.43	-	-	50,000	1,214,787.25	1,821,500.00	-
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大事项	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	93,900	986,395.95	1,442,304.00	-
002353	杰瑞股份	2015 年 5 月	重大事项	44.35	-	-	17,700	608,662.51	784,995.00	-

		27 日								
601633	长城汽车	2015 年 6 月 19 日	重大事项	42.76	2015 年 7 月 13 日	38.50	14,000	592,308.58	598,640.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌
的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基金的主要投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 16,100,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,004,157.78	-	-	-	25,004,157.78
结算备付金	201,270.67	-	-	-	201,270.67
存出保证金	285,983.64	-	-	-	285,983.64
交易性金融资产	15,995,860.00	-	-	312,242,110.45	328,237,970.45
应收利息	-	-	-	500,422.80	500,422.80
应收申购款	945,549.49	-	-	40,120,949.24	41,066,498.73
资产总计	42,432,821.58	-	-	352,863,482.49	395,296,304.07
负债					
卖出回购金融资产款	16,100,000.00	-	-	-	16,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	12,332,272.55	12,332,272.55
应付赎回款	-	-	-	15,049,523.12	15,049,523.12
应付管理人报酬	-	-	-	199,242.46	199,242.46
应付托管费	-	-	-	39,848.50	39,848.50
应付交易费用	-	-	-	336,273.80	336,273.80
应付利息	-	-	-	742.39	742.39
其他负债	-	-	-	239,540.25	239,540.25
负债总计	16,100,000.00	-	-	28,197,443.07	44,297,443.07
利率敏感度缺口	26,332,821.58	-	-	324,666,039.42	350,998,861.00

上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,064,161.41	-	-	-	15,064,161.41
结算备付金	160,017.77	-	-	-	160,017.77
存出保证金	11,235.57	-	-	-	11,235.57
交易性金融资产	10,149,531.00	-	-	284,611,713.40	294,761,244.40
应收利息	-	-	-	180,590.04	180,590.04
应收申购款	35,000.00	-	-	77,900,905.55	77,935,905.55
资产总计	25,419,945.75	-	-	362,693,208.99	388,113,154.74
负债					
卖出回购金融资产款	9,900,000.00	-	-	-	9,900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,770,297.12	1,770,297.12
应付赎回款	-	-	-	15,986,007.29	15,986,007.29
应付管理人报酬	-	-	-	147,663.44	147,663.44
应付托管费	-	-	-	29,532.67	29,532.67
应付交易费用	-	-	-	246,963.26	246,963.26
应付利息	-	-	-	397.10	397.10
其他负债	-	-	-	119,874.90	119,874.90
负债总计	9,900,000.00	-	-	18,300,735.78	28,200,735.78
利率敏感度缺口	15,519,945.75	-	-	344,392,473.21	359,912,418.96

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.56%(2014 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金将不低于 80% 的基金资产投资于中证 100 指数成份股和备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	312,242,110.45	88.96	284,611,713.40	79.08
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	312,242,110.45	88.96	284,611,713.40	79.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 100 指数外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 中证 100 指数上升 5%	16,161,086.00	16,425,637.00
2. 中证 100 指数下降 5%	-16,161,086.00	-16,425,637.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	312,242,110.45	78.99
	其中：股票	312,242,110.45	78.99
2	固定收益投资	15,995,860.00	4.05
	其中：债券	15,995,860.00	4.05
	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	25,205,428.45	6.38
7	其他各项资产	41,852,905.17	10.59
8	合计	395,296,304.07	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	13,463,440.00	3.84
C	制造业	79,404,700.40	22.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,513,542.00	3.00
E	建筑业	17,650,707.00	5.03
F	批发和零售业	2,663,730.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	6,854,202.00	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,799,954.00	1.65
J	金融业	158,298,968.05	45.10
K	房地产业	13,097,042.00	3.73
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	1,856,140.00	0.53
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	309,602,425.45	88.21

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	采掘业	-	-
C	制造业	818,185.00	0.23
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	1,821,500.00	0.52
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	2,639,685.00	0.75

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	261,095	21,394,124.30	6.10
2	601166	兴业银行	1,002,600	17,294,850.00	4.93
3	600016	民生银行	1,291,600	12,838,504.00	3.66
4	600030	中信证券	443,800	11,942,658.00	3.40
5	600036	招商银行	630,100	11,795,472.00	3.36
6	601668	中国建筑	1,004,000	8,343,240.00	2.38
7	601766	中国中车	442,500	8,124,300.00	2.31

8	601601	中国太保	266,600	8,045,988.00	2.29
9	600837	海通证券	325,400	7,093,720.00	2.02
10	600000	浦发银行	411,400	6,977,344.00	1.99
11	601328	交通银行	771,700	6,358,808.00	1.81
12	601988	中国银行	1,288,300	6,299,787.00	1.79
13	000651	格力电器	94,500	6,038,550.00	1.72
14	600048	保利地产	498,200	5,689,444.00	1.62
15	000002	万科 A	381,400	5,537,928.00	1.58
16	601398	工商银行	1,012,400	5,345,472.00	1.52
17	601989	中国重工	361,000	5,342,800.00	1.52
18	601186	中国铁建	319,800	4,998,474.00	1.42
19	600887	伊利股份	241,000	4,554,900.00	1.30
20	601169	北京银行	332,200	4,424,904.00	1.26
21	600519	贵州茅台	16,800	4,328,520.00	1.23
22	601818	光大银行	782,700	4,195,272.00	1.20
23	601288	农业银行	1,040,800	3,861,368.00	1.10
24	000001	平安银行	252,000	3,664,080.00	1.04
25	601006	大秦铁路	234,000	3,285,360.00	0.94
26	000333	美的集团	82,900	3,090,512.00	0.88
27	601688	华泰证券	128,800	2,979,144.00	0.85
28	600028	中国石化	413,400	2,918,604.00	0.83
29	000166	申万宏源	175,267	2,848,088.75	0.81
30	600104	上汽集团	121,600	2,748,160.00	0.78
31	600999	招商证券	102,500	2,712,150.00	0.77
32	600795	国电电力	386,200	2,691,814.00	0.77
33	002024	苏宁云商	174,100	2,663,730.00	0.76
34	000776	广发证券	116,400	2,636,460.00	0.75
35	600900	长江电力	180,400	2,588,740.00	0.74
36	600015	华夏银行	163,600	2,488,356.00	0.71
37	600050	中国联通	333,300	2,443,089.00	0.70
38	000858	五粮液	74,500	2,361,650.00	0.67
39	600011	华能国际	165,200	2,317,756.00	0.66
40	601336	新华保险	37,400	2,283,644.00	0.65
41	600637	百视通	51,600	2,171,328.00	0.62
42	601857	中国石油	191,100	2,165,163.00	0.62
43	002415	海康威视	47,950	2,148,160.00	0.61
44	600518	康美药业	121,000	2,145,330.00	0.61
45	000725	京东方 A	400,300	2,077,557.00	0.59
46	601628	中国人寿	65,400	2,048,328.00	0.58

47	600705	中航资本	88,000	2,037,200.00	0.58
48	600010	包钢股份	384,400	1,995,036.00	0.57
49	601901	方正证券	161,800	1,923,802.00	0.55
50	600276	恒瑞医药	43,190	1,923,682.60	0.55
51	601899	紫金矿业	372,800	1,908,736.00	0.54
52	600383	金地集团	147,800	1,869,670.00	0.53
53	000069	华侨城 A	143,000	1,856,140.00	0.53
54	600886	国投电力	124,800	1,855,776.00	0.53
55	000625	长安汽车	87,700	1,854,855.00	0.53
56	000063	中兴通讯	77,300	1,840,513.00	0.52
57	601669	中国电建	162,300	1,840,482.00	0.52
58	000538	云南白药	20,400	1,759,908.00	0.50
59	600703	三安光电	56,000	1,752,800.00	0.50
60	601727	上海电气	116,200	1,734,866.00	0.49
61	600019	宝钢股份	194,400	1,699,056.00	0.48
62	600690	青岛海尔	56,000	1,698,480.00	0.48
63	600585	海螺水泥	78,600	1,685,970.00	0.48
64	601600	中国铝业	176,300	1,644,879.00	0.47
65	601088	中国神华	77,700	1,620,045.00	0.46
66	600111	北方稀土	85,700	1,554,598.00	0.44
67	600031	三一重工	149,900	1,452,531.00	0.41
68	601788	光大证券	53,700	1,447,215.00	0.41
69	600583	海油工程	86,800	1,446,088.00	0.41
70	601111	中国国航	93,900	1,442,304.00	0.41
71	601618	中国中冶	195,700	1,414,911.00	0.40
72	600150	中国船舶	27,000	1,390,500.00	0.40
73	601018	宁波港	150,900	1,333,956.00	0.38
74	600196	复星医药	45,000	1,302,300.00	0.37
75	600256	广汇能源	124,300	1,292,720.00	0.37
76	002304	洋河股份	17,680	1,226,284.80	0.35
77	600893	中航动力	23,000	1,222,450.00	0.35
78	002736	国信证券	48,300	1,211,847.00	0.35
79	600406	国电南瑞	57,300	1,185,537.00	0.34
80	600535	天士力	23,800	1,184,288.00	0.34
81	600958	东方证券	41,300	1,182,006.00	0.34
82	002241	歌尔声学	30,000	1,077,000.00	0.31
83	600023	浙能电力	106,800	1,059,456.00	0.30
84	601800	中国交建	60,000	1,053,600.00	0.30
85	600309	万华化学	42,400	1,025,232.00	0.29

86	002594	比亚迪	18,400	1,016,232.00	0.29
87	601998	中信银行	125,600	968,376.00	0.28
88	600398	海澜之家	52,900	959,077.00	0.27
89	000895	双汇发展	38,900	829,737.00	0.24
90	601898	中煤能源	72,100	823,382.00	0.23
91	600018	上港集团	100,200	792,582.00	0.23
92	600372	中航电子	20,700	723,051.00	0.21
93	002252	上海莱士	10,800	706,752.00	0.20
94	601808	中海油服	23,200	648,208.00	0.18
95	601225	陕西煤业	78,300	640,494.00	0.18
96	601633	长城汽车	14,000	598,640.00	0.17
97	603288	海天味业	10,500	335,370.00	0.10
98	600485	信威集团	5,700	250,173.00	0.07

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000024	招商地产	50,000	1,821,500.00	0.52
2	002353	杰瑞股份	17,700	784,995.00	0.22
3	300473	德尔股份	500	33,190.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	31,127,561.02	8.65
2	600016	民生银行	25,703,683.39	7.14
3	601166	兴业银行	24,448,991.37	6.79
4	600030	中信证券	23,734,767.00	6.59
5	600036	招商银行	17,182,711.24	4.77
6	600000	浦发银行	16,576,221.00	4.61
7	601601	中国太保	15,879,022.56	4.41
8	000002	万科 A	15,337,662.83	4.26
9	601668	中国建筑	13,099,865.99	3.64
10	600837	海通证券	11,695,858.00	3.25
11	601628	中国人寿	11,183,890.18	3.11

12	601988	中国银行	10,454,729.86	2.90
13	000776	广发证券	10,009,786.56	2.78
14	601766	中国中车	9,565,151.47	2.66
15	601398	工商银行	9,255,130.00	2.57
16	000001	平安银行	9,065,330.35	2.52
17	600048	保利地产	8,881,455.14	2.47
18	000651	格力电器	8,575,501.84	2.38
19	601818	光大银行	8,241,446.00	2.29
20	601328	交通银行	7,456,977.00	2.07

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	32,463,676.29	9.02
2	600016	民生银行	26,771,849.69	7.44
3	600036	招商银行	21,016,171.40	5.84
4	600030	中信证券	19,639,658.00	5.46
5	600000	浦发银行	18,381,772.26	5.11
6	000002	万科A	17,555,784.09	4.88
7	601166	兴业银行	15,500,305.70	4.31
8	601601	中国太保	13,216,411.94	3.67
9	600837	海通证券	12,731,448.00	3.54
10	601628	中国人寿	12,145,323.00	3.37
11	601668	中国建筑	11,871,163.00	3.30
12	000651	格力电器	10,920,331.32	3.03
13	000001	平安银行	10,805,864.99	3.00
14	000776	广发证券	9,848,955.74	2.74
15	601818	光大银行	8,871,287.00	2.46
16	601398	工商银行	8,308,139.00	2.31
17	600048	保利地产	8,076,438.32	2.24
18	601288	农业银行	7,982,742.00	2.22
19	600015	华夏银行	7,432,945.85	2.07
20	601988	中国银行	7,215,197.00	2.00

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	500,059,084.42
卖出股票收入（成交）总额	513,358,847.85

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,003,200.00	2.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,992,660.00	2.28
	其中：政策性金融债	7,992,660.00	2.28
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	15,995,860.00	4.56

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019414	14 国债 14	80,000	8,003,200.00	2.28
2	018001	国开 1301	78,000	7,992,660.00	2.28

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券发行主体中除中国平安、中信证券、海通证券外报告期内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。

2014 年 12 月 8 日，中国证监会发布《中国证监会行政处罚决定书》（〔2014〕103 号），因海联讯科技股份有限公司（以下简称海联讯）上市项目，对平安证券给予警告，没收其在海联讯科技股份有限公司发行上市项目中的保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2,867 万元，并处以 440 万元罚款。平安证券为中国平安控股子公司。

2015 年 1 月 18 日，中信证券公告：“因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为 6 个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。”

2015 年 1 月 19 日，海通证券公告：“因存在违规为到期融资融券合约展期问题，受到暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。”

中国平安、中信证券、海通证券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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	285,983.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	500,422.80
5	应收申购款	41,066,498.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,852,905.17

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000024	招商地产	1,821,500.00	0.52	重大事项
2	002353	杰瑞股份	784,995.00	0.22	重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,017	38,333.73	119,944,517.43	44.59%	149,043,272.19	55.41%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	111,045.72	0.0413%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门 负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 2 月 8 日) 基金份额总额	281,241,387.65
本报告期期初基金份额总额	320,639,832.08
本报告期基金总申购份额	865,174,360.01
减:本报告期基金总赎回份额	916,826,402.47
本报告期末基金份额总额	268,987,789.62

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2015 年 3 月 21 日，本基金管理人发布关于董事长（法定代表人）变更的公告，李文众先生任宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人），李文众先生基金行业任职资格核准文号为：证监许可（2015）409 号。李建生女士退休，不再担任董事长（法定代表人）职务。截止至报告期末，基金管理人已完成办理法定代表人工商变更登记等相关手续。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	817,633,592.29	81.73%	724,203.50	81.75%	-
华泰证券	1	182,774,539.98	18.27%	161,651.71	18.25%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	35,875,884.10	100.00%	401,300,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。

- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单独指股票交易佣金。

3、本基金与本基金管理公司管理的宝盈增强收益债券型证券投资基金共用交易单元，本报告期末租用和退租证券公司交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 8 日
2	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 21 日
3	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 28 日
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
5	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
7	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 3 日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加	中国证券报 证券时报	2015 年 3 月 6 日

	光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报 证券日报	
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 10 日
10	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 17 日
11	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 19 日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
13	宝盈基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 21 日
14	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 3 月 24 日
15	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 24 日
16	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 25 日
17	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 28 日
18	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 2 日
19	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 3 日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 4 日
21	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 8 日
22	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 9 日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 14 日

24	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 16 日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 18 日
26	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 22 日
27	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 23 日
28	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 24 日
29	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 25 日
30	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 8 日
31	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 12 日
32	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 13 日
33	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 15 日
34	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 19 日
35	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 20 日
36	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 21 日
37	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 22 日
38	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 22 日

39	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 26 日
40	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 27 日
41	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 1 日
42	盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 3 日
43	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 11 日
44	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 12 日
45	宝盈基金管理有限公司关于子公司中铁宝盈资产管理有限公司办公地址变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
46	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
47	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 19 日
48	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 20 日
49	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 24 日
50	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 26 日
51	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 27 日
52	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
53	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 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

11.3 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
2015 年 8 月 27 日