

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告

2015 年 12 月 31 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

报告送出日期：2016 年 1 月 20 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 2016 年 1 月 19 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 2015 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	71,169,736.92 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（2015 年 10 月 1 日 — 2015 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-1,997,650.33
2. 本期利润	14,279,304.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1662
4. 期末基金资产净值	79,770,378.93
5. 期末基金份额净值	1.121

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。

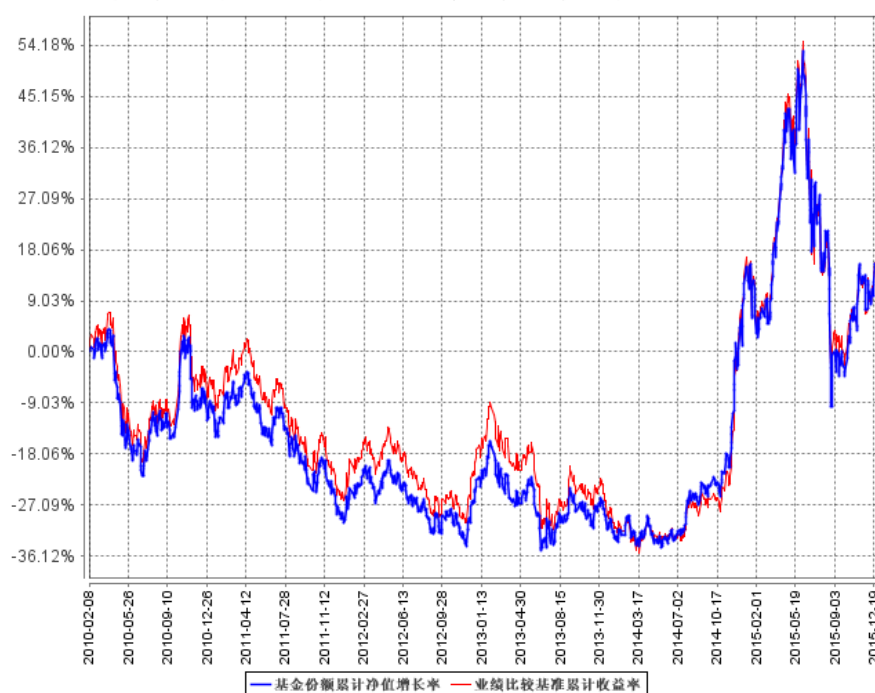
3.2 基金净值表现

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	16.29%	1.55%	13.56%	1.51%	2.73%	0.04%

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

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		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015 年 7 月 10 日	-	10 年	盖俊龙先生，经济学硕士。2005 年 8 月至 2011 年 5 月，在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011 年 6 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
郭骁	本基金基金经理	2015 年 8 月 27 日	-	3 年	郭骁先生，经济学硕士。2012 年 7 月起加入宝盈基金管理有限公司任金融工程部研究员，负责数量化选股、衍生品投资等量化策略研究。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合规守信情况的说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，由于我国经济增长模式的转变和经济结构的转型，由于劳动力增速的趋势性下行，经济增速降档成为新常态，预计 2015 年全年我国 GDP 同比增速为 6.9%。2015 年四季度 CPI 同比涨幅继续处于低位水平小幅震荡，而 PPI 同比涨幅则继续处于负值，采购经理指数 PMI 徘徊在 50 的荣枯线以下，各项数据显示经济增长仍然疲弱。四季度以来，证券市场在前期两次股灾的大幅下跌之后出现了较大幅度的反弹，市场情绪逐步回归理性，其中市值较小、前期跌幅较大的板块反弹幅度更大。

报告期内，本基金的股票仓位维持在较高位水平。结构上而言，以复制中证 100 指数权重为主，此外在新兴成长行业中精选个股，进行增强投资。中证 100 指数在 12 月进行了最近一次成分股调整，东方财富、乐视网等新兴产业中的成长型龙头企业纳入指数成分股，预示着在经济结构转型、产业升级背景下，中证 100 指数的代表性也自然地与时俱进。本基金四季度的净值增长率是 16.29%，整体表现略好于业绩比较基准。

4.5 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 16.29%，同期业绩比较基准收益率是 13.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	73,534,442.13	78.81
	其中：股票	73,534,442.13	78.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,009,000.00	5.37

	其中：债券	5,009,000.00	5.37
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,000,000.00	10.72
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,065,947.16	3.29
8	其他资产	1,697,039.70	1.82
9	合计	93,306,428.99	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	2,260,042.00	2.83
C	制造业	19,166,298.70	24.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,864,419.00	3.59
E	建筑业	3,461,666.00	4.34
F	批发和零售业	724,955.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	1,929,823.00	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,365,759.00	2.97
J	金融业	36,490,042.43	45.74
K	房地产业	3,671,142.00	4.60
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	393,360.00	0.49
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	180,000.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	73,507,507.13	92.15

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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	18,685.00	0.02
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	8,250.00	0.01
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	-	-
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	26,935.00	0.03

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	131,190	4,722,840.00	5.92
2	600016	民生银行	358,300	3,454,012.00	4.33
3	601166	兴业银行	161,900	2,763,633.00	3.46
4	000002	万科A	100,200	2,447,886.00	3.07
5	600036	招商银行	125,100	2,250,549.00	2.82
6	600000	浦发银行	113,000	2,064,510.00	2.59
7	600030	中信证券	95,500	1,847,925.00	2.32
8	601328	交通银行	285,800	1,840,552.00	2.31
9	601398	工商银行	366,900	1,680,402.00	2.11
10	600837	海通证券	98,363	1,556,102.66	1.95

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	002781	奇信股份	500	18,685.00	0.02
2	002777	久远银海	500	8,250.00	0.01

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	5,009,000.00	6.28
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,009,000.00	6.28

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	019515	15 国债 15	50,000	5,009,000.00	6.28

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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信证券、海通证券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。

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。”

2015 年 8 月 24 日，海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（津证调查字[2015011]号）。因海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对海通证券进行立案调查。2015 年 9 月 10 日，海通证券股份有限公司因涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书（处罚字[2015]73 号），对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

中信证券、海通证券为本基金的指数成分股，本基金管理人主要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	193,441.30
2	应收证券清算款	1,429,038.50
3	应收股利	-
4	应收利息	58,878.31
5	应收申购款	15,681.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,697,039.70

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	2,447,886.00	3.07	重大资产重组

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	94,269,788.59
报告期期间基金总申购份额	31,399,637.83
减：报告期期间基金总赎回份额	54,499,689.50
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	71,169,736.92

§ 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

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
2016 年 1 月 20 日