

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：2017 年 1 月 21 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 2017 年 1 月 20 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 2016 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	76,010,760.38 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（2016 年 10 月 1 日 — 2016 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-113,753.13
2. 本期利润	1,903,463.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0271
4. 期末基金资产净值	81,901,829.27
5. 期末基金份额净值	1.078

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。

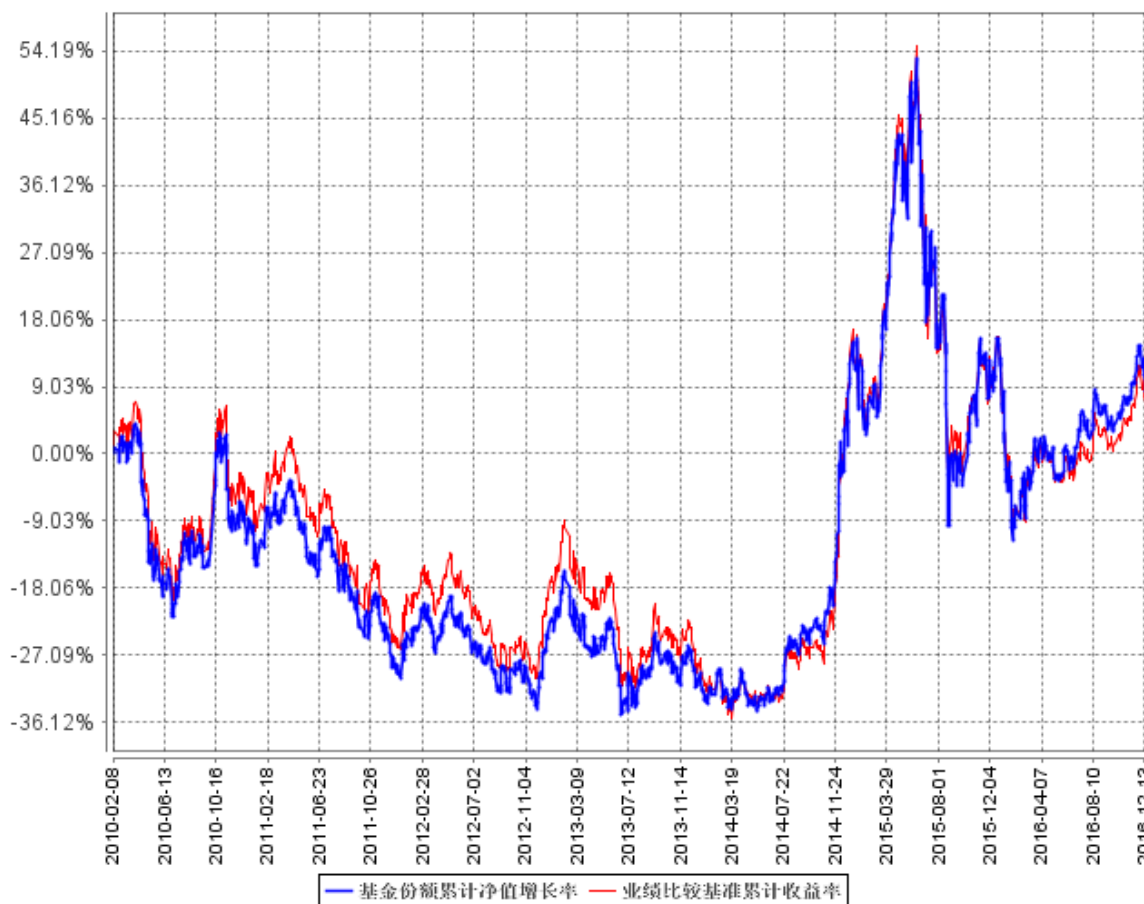
3.2 基金净值表现

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	3.55%	0.65%	2.88%	0.69%	0.67%	-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		
郭骁	本基金基金经理	2015 年 8 月 27 日	-	4 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，2016 年 4 季度全国制造业 PMI 持续小幅上升至 51.40，制造业景气度持续回升。2016 年 11 月，CPI 同比小幅上升至 2.3%，PPI 同比继续回升至 3.3%，PPI 同比增速历经五年再次超越 CPI 同比增速。总体来看，在供给侧行政化改革和市场化出清的共同作用下，经济周期经历了从去库存转向补库存的阶段，经济短期企稳。证券市场上，2016 年 10-11 月市场在低估值蓝筹股的带动下，出现了小幅反弹，12 月整体有所回落。上证综指、中小板指、创业板指的收益率分别为 3.29%、-4.59%、-8.74%，各个板块股价表现有所分化。

报告期内，本基金以比较基准作为参考，股票仓位整体维持在较高位水平。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，在一二级市场上运用套利策略，进行增强投资。本基金 2016 年 4 季度的净值增长率为 3.55%，与基准相比的超额收益率为 0.67%。

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 3.55%，同期业绩比较基准收益率是 2.88%。

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	76,003,141.34	91.41
	其中：股票	76,003,141.34	91.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,630,000.00	4.37
	其中：债券	3,630,000.00	4.37
	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	-	-
	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	1,529,699.16	1.84
8	其他资产	1,985,934.34	2.39
9	合计	83,148,774.84	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境内股票投资组合

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	2,117,111.00	2.58
C	制造业	17,854,838.75	21.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,369,231.00	2.89
E	建筑业	3,840,905.00	4.69
F	批发和零售业	496,930.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	1,375,941.00	1.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,102,608.00	2.57
J	金融业	34,311,752.58	41.89
K	房地产业	3,533,102.00	4.31
L	租赁和商务服务业	101,317.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	269,660.00	0.33
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	297,385.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	68,670,781.33	83.85

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	294,674.00	0.36
B	采掘业	13,703.00	0.02
C	制造业	5,168,614.04	6.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.02
F	批发和零售业	888,076.96	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	2,364.67	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	639,679.11	0.78
J	金融业	10,896.00	0.01
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	298,760.00	0.36
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	7,332,360.01	8.95

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	126,390	4,477,997.70	5.47
2	601166	兴业银行	155,600	2,511,384.00	3.07
3	600016	民生银行	275,800	2,504,264.00	3.06
4	600036	招商银行	120,300	2,117,280.00	2.59
5	600519	贵州茅台	5,820	1,944,753.00	2.37
6	601328	交通银行	320,300	1,848,131.00	2.26
7	600030	中信证券	110,500	1,774,630.00	2.17
8	600000	浦发银行	100,910	1,635,751.10	2.00

9	000002	万 科 A	79,500	1,633,725.00	1.99
10	601668	中国建筑	179,300	1,588,598.00	1.94

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	300513	恒泰实达	6,200	591,232.00	0.72
2	002496	辉丰股份	115,000	569,250.00	0.70
3	002501	利源精制	26,000	319,020.00	0.39
4	002080	中材科技	18,000	315,360.00	0.39
5	002521	齐峰新材	29,000	311,750.00	0.38

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	3,630,000.00	4.43
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（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,630,000.00	4.43

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	019533	16 国债 05	36,300	3,630,000.00	4.43

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。

5.11.2 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	14,699.39
2	应收证券清算款	1,800,911.50
3	应收股利	-
4	应收利息	70,568.62
5	应收申购款	99,754.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,985,934.34

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**

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。

5.11.5.2 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

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	300513	恒泰实达	591,232.00	0.72	重大事项

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	67,993,210.34
报告期期间基金总申购份额	17,941,628.19
减：报告期期间基金总赎回份额	9,924,078.15
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	76,010,760.38

§ 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
2017 年 1 月 21 日