

# 宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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。本中期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 2020 年 8 月 28 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	20
<b>§ 7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 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	
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	167,396,947.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C
下属分级基金的交易代码:	213010	007580
报告期末下属分级基金的份额总额	165,828,492.18 份	1,568,455.77 份

### 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	张磊
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	021-60637111
传真	0755-83515599	021-60635778
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	马永红	田国立
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金中期报告备置地点	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

基金级别	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,239,118.72	1,052,748.24
本期利润	6,684,386.06	-252,219.22
加权平均基金份额本期利润	0.0599	-0.0338
本期加权平均净值利润率	3.55%	-2.03%
本期基金份额净值增长率	3.99%	3.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	92,634,698.98	855,171.32
期末可供分配基金份额利润	0.5586	0.5452
期末基金资产净值	298,475,549.44	2,802,343.35
期末基金份额净值	1.800	1.787
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	80.00%	13.39%

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

宝盈中证 100 指数增强 A

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	7.46%	0.90%	5.86%	0.88%	1.60%	0.02%
过去三个月	13.42%	0.83%	10.17%	0.82%	3.25%	0.01%
过去六个月	3.99%	1.39%	-2.62%	1.40%	6.61%	-0.01%
过去一年	17.26%	1.14%	2.23%	1.13%	15.03%	0.01%
过去三年	44.12%	1.20%	15.78%	1.20%	28.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	80.00%	1.36%	37.68%	1.38%	42.32%	-0.02%

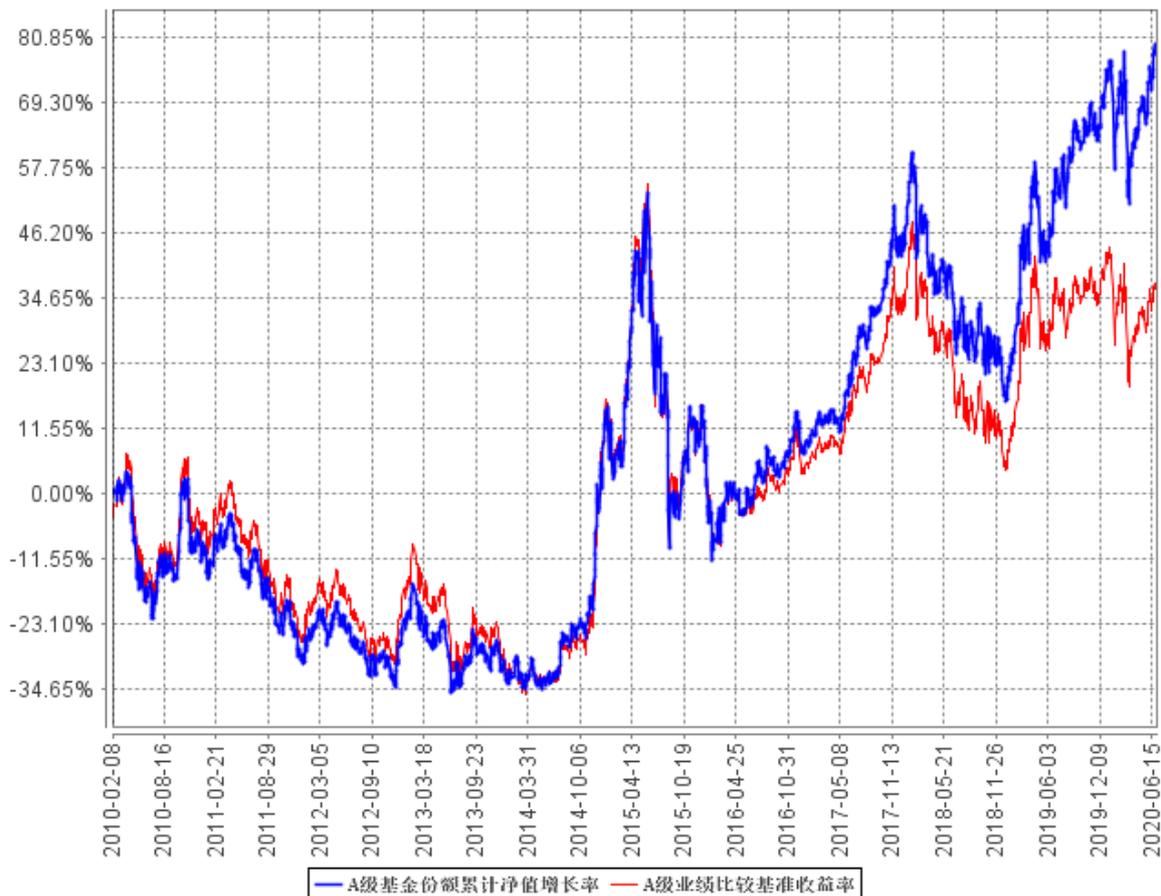
宝盈中证 100 指数增强 C

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	7.39%	0.89%	5.86%	0.88%	1.53%	0.01%
过去三个月	13.17%	0.83%	10.17%	0.82%	3.00%	0.01%
过去六个月	3.53%	1.40%	-2.62%	1.40%	6.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	13.39%	1.13%	2.23%	1.13%	11.16%	0.00%

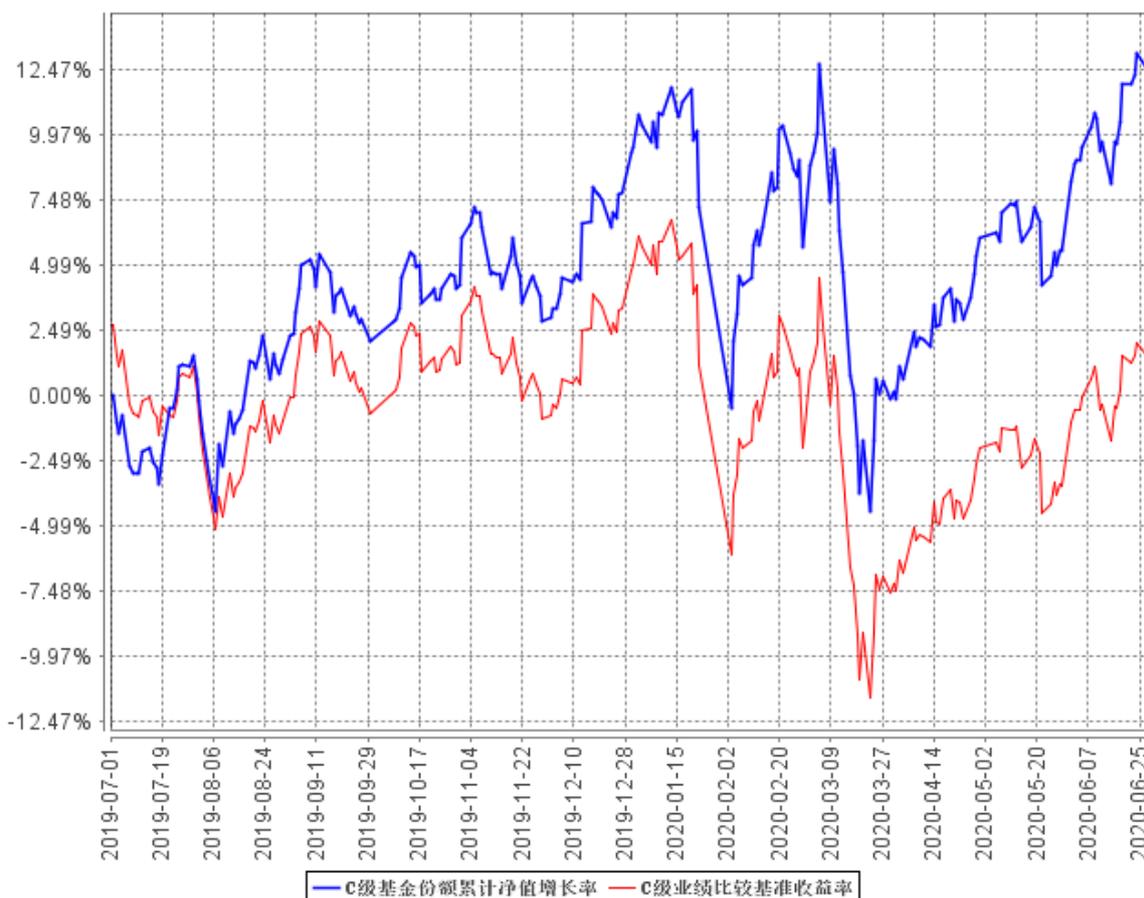
注：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈中证 100 指数增强 C”。

### 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

A级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



C级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：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈中证 100 指数增强 C”。

## § 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。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、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、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混

合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈盈顺纯债债券、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈辉纯债三十九只基金，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		
蔡丹	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理	2017年8月5日	-	10年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011年9月至2017年7月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017年7月加入宝盈基金管理有限公司。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
刘李杰	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理；量化投资部总经理	2019年3月30日	2020年4月25日	12年	刘李杰先生，美国约翰霍普金斯大学电子与计算机工程博士、华中科技大学通信与信息系统硕士、加拿大多伦多大学数理金融硕士。2008年1月至2008年7月在美国Bayview金融公司担任量化分析师；2009年1月至2011年3月在加拿大帝国商业银行担任高级量化分析师；2011年3月至2012年6月担任加拿大退休金计划投资委员会高级投资分析师、投资经理；2012年6月至2013年8月担任齐鲁证券执行董事；2013年9月至2017年8月担任长

					城证券股份有限公司资产管理部董事总经理。2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司量化投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

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 2020 年 6 月 30 日。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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 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

今年上半年，国内外经济和资本市场受新冠疫情影响较大。春节期间，新冠肺炎持续发酵，节后首日市场跳空大跌，之后在国内疫情趋向继续好转、央行降息、再融资新规落地、流动性充

裕等因素综合影响下，市场开启了一波强势反弹。3 月份随着海外疫情的持续发酵，全球资本市场大幅波动，美股数次熔断。为应对疫情加速蔓延的态势，各国疫情管控措施也在持续升级，全球央行和政府部门继续采取大幅度的财政和货币宽松政策应对。

3 月下旬 A 股阶段性探底后，4 月上旬海外疫情出现积极变化，国内稳步推进复工，风险偏好改善，外加流动性充裕，开启了一波反弹行情，5 月底至 6 月底，全球经济修复预期升温，风险偏好进一步抬升，市场延续趋势上行，上证综指 6 月底收盘于 2984.67 点，距离 3000 点仅有一步之遥。近期来看，全球疫情随着复工开始出现加速现象，美国多州考虑放慢甚至撤销经济重启计划，截至 2020 年 7 月 22 日全球累计确诊病例超过 1500 万，美国和巴西确诊量分别达到 410 万和 223 万，有 22 个国家累计确诊量超过 10 万，当前美国、巴西、印度、南非等国的每日新增还处于较高水平，还没有缓和态势。国内疫情整体控制较好，但近期北京和新疆也出现了集中性疫情，国内防控也无法松懈。

从市场走势来看，今年上半年指数之间分化还是较大，主要指数表现如下：创业板指上涨 35.6%，中小板指上涨 20.85%，中证 1000 上涨 13.52%，中证 500 上涨 11.33%，中证 800 上涨 3.94%，沪深 300 上涨 1.64%，中证 100 和上证 50 分别下跌 2.83%和 3.95%。中小创表现较好，而大盘蓝筹走势较弱。分行业来看，申万 28 个一级行业中有 17 个行业录得上涨，涨幅前五的行业分别是：医药生物（上涨 40.28%）、休闲服务（上涨 30.07%）、电子（上涨 24.49%）、食品饮料（上涨 23.28%）和计算机（上涨 21.75%）；跌幅前五的行业：采掘（下跌 18.62%）、银行（下跌 13.97%）、非银金融（下跌 11.7%）、交通运输（下跌 10.14%）和钢铁（下跌 10.05%）。消费和 TMT 表现较好，而周期板块表现较弱。

从大小盘风格来看，本季度小盘相对大盘还是相对占优，中小创大幅跑赢上证 50，从价值成长风格来看，2019 年以来成长风格持续占优，今年上半年成长风格相对价值风格的优势还在持续拉大。

从北上资金来看，今年上半年的流动是一波三折，2 月中旬之前以净流入为主，但 2 月下旬至 3 月中旬出现了持续性的净流出，之后到 6 月底又出现了趋势性的流入，上半年累计净流入 1181.51 亿元。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子，构建多维度、多策略的选股体系。本基金通过对成份股内部有效因子的挖掘，在实现主要风险因子中性的基础上，严格控制与基准指数的偏离度，通过增强策略来增强产品收益。此外，本基金还积极参与主板、中小板、创业板和科创板的网下新股申购，通过打新来提供稳定的增强收益。

报告期内，本基金在复制中证 100 指数成份股的基础上，配置了部分增强策略，同时积极参与科创板网下新股申购。2020 年上半年本基金 A 份额单位净值上涨 3.99%，C 类份额单位净值上涨 3.53%，A 类份额相对基准超额收益为 6.61%，年化跟踪误差为 1.46%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈中证 100 指数增强 A 基金份额净值为 1.800 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.99%，同期业绩比较基准收益率为-2.62%；

截至本报告期末宝盈中证 100 指数增强 C 基金份额净值为 1.787 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.53%，同期业绩比较基准收益率为-2.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济来看，受疫情影响，一季度全球主要国家经济增速均断崖式下跌。国内疫情得到有效控制后，积极推进了复工复产。从最近统计局公布的 6 月经济数据来看，多项数据超预期：2020 年二季度 GDP 同比增长 3.2%，预期增长 2.4%，前值下降 6.8%。6 月规模以上工业增加值同比增长 4.8%，预期增长 4.8%，前值增长 4.4%。6 月社会消费品零售总额同比下降 1.8%，预期增长 0.5%，前值下降 2.8%。二季度经济数据超预期，主要源于出口端大超预期，房地产、基建强劲反弹。

政策面上，前段时间人行货币政策委员会季度例会认为国内复工复产取得重大阶段性成果，各类经济指标出现边际改善，表明货币政策加码宽松必要性或有所降低，意味着货币政策最宽松时期已经过去，未来货币政策宽松力度将会有所弱化。6 月社融、信贷增速趋缓，下半年扩容空间或相对有限。

从指数估值水平来看，以 2020/6/30 为基准，上证 50 的 PE 为 10.11 倍，中证 100 的为 11.09 倍，沪深 300 的 PE 为 12.69 倍，中证 500 的 PE 为 28.27 倍，中小板的 PE 为 34.68 倍，创业板的 PE 为 67.34 倍。从 PE 所处的历史分位数来看，中小板和创业板分别位于历史的 72%和 88%左右，上证 50 和沪深 300 分别位于 46%和 49%左右，而中证 100 位于历史的 45%左右，几个大盘蓝筹指数的整体估值水平还处于历史中值以下。

从指数段位来看，主要宽基指数都处于 18 年底以来的周线级别上涨通道里，最近的一段日线级别上涨始于今年 3 月下旬，这一波反弹力度较大，大部分宽基指数这一波日线级别反弹幅度已经超过 30%。

展望下半年，全球经济大概率会逐渐复苏，整体维持相对宽松格局。从外围来看，美欧贸易摩擦升级加剧经济悲观预期，全球疫情的反复放缓海外需求的改善进程，对国内基本面造成负面影响，中美关系的反复又会阶段性地影响风险偏好，整体来看，短期内风险偏好大幅提升难度较大，而国内经济在恢复到疫情前水平之前，国内政策也不会明显收紧，市场近期或以震荡走势为

主。

在国内经济政策预期改善的背景下，权益资产具备配置价值。从外资来看，进入 2020 年以后，A 股在国际指数扩容进程暂缓，预计今年外资整体净流入规模或有所下降，但考虑到低利率环境和目前 A 股估值优势，境外资金仍有动力继续流入 A 股，外资在 A 股走势以及市场风格影响力还将进一步提升，他们对高质量、高盈利能力、成长能力和流动性等风格的偏好会对市场产生持续性的影响。因此，盈利、成长、质量、流动性等因子都将为产品投资策略所持续关注重点。

我们将严格按照基金合同的规定，在严格控制与基准指数偏离的基础上，依托我们的多维度选股策略体系，控制主要风险因子，运用数量化选股模型，构建增强部分投资组合，以增强产品业绩。我们将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

本基金管理人按照企业会计准则、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。基金托管人根据法律法规要求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委员会，由公司投研、运营的分管（协管）领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 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 托管人对本中期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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	56,327,658.32	7,180,047.84
结算备付金		39,464.05	189,323.98
存出保证金		27,195.61	32,226.13
交易性金融资产	6.4.7.2	291,705,876.92	242,152,961.37
其中：股票投资		282,701,376.92	234,347,081.37
基金投资		-	-
债券投资		9,004,500.00	7,805,880.00
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	100,240.82	162,190.04
应收股利		-	-
应收申购款		621,414.52	765,426.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		348,821,850.24	250,482,175.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付证券清算款		44,387,166.98	-
应付赎回款		2,543,560.16	1,288,272.34
应付管理人报酬		120,287.99	167,653.80
应付托管费		24,057.59	33,530.76
应付销售服务费		3,021.90	8,964.93
应付交易费用	6.4.7.7	150,218.00	121,305.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	315,644.83	283,370.65
负债合计		47,543,957.45	1,903,097.48
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	167,396,947.95	143,601,994.02
未分配利润	6.4.7.10	133,880,944.84	104,977,084.00
所有者权益合计		301,277,892.79	248,579,078.02
负债和所有者权益总计		348,821,850.24	250,482,175.50

注:报告截止日 2020 年 6 月 30 日,宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.800 元,基金份额总额 165,828,492.18 份;宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.787 元,基金份额总额 1,568,455.77 份。宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金份额总额合计为 167,396,947.95 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:2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019
-----	-----	-----------------------	---------------------------------

		2020 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		7,847,403.16	58,935,303.51
1. 利息收入		103,052.19	127,205.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,972.24	16,726.66
债券利息收入		69,079.95	110,478.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,498,667.39	5,373,700.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,127,155.65	2,631,883.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,889.40	4,800.00
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	2,379,401.14	2,737,016.45
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,859,700.12	53,350,813.37
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	105,383.70	83,585.09
<b>减：二、费用</b>		1,415,236.32	1,229,227.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	758,766.81	814,760.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,753.40	162,952.15
3. 销售服务费		49,099.89	-
4. 交易费用	6.4.7.19	362,082.49	163,946.83
5. 利息支出		1,940.76	625.51
其中：卖出回购金融资产支出		1,940.76	625.51
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	91,592.97	86,942.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,432,166.84	57,706,075.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,432,166.84	57,706,075.52

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	143,601,994.02	104,977,084.00	248,579,078.02
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	6,432,166.84	6,432,166.84
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)	23,794,953.93	22,471,694.00	46,266,647.93
其中：1. 基金申购款	113,569,437.96	83,915,959.09	197,485,397.05
2. 基金赎回款	-89,774,484.03	-61,444,265.09	-151,218,749.12
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)	167,396,947.95	133,880,944.84	301,277,892.79
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	172,796,790.34	31,387,040.68	204,183,831.02
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	57,706,075.52	57,706,075.52
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)	-19,001,160.99	-6,885,991.14	-25,887,152.13
其中：1. 基金申购款	39,158,601.82	17,729,935.52	56,888,537.34
2. 基金赎回款	-58,159,762.81	-24,615,926.66	-82,775,689.47
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）	153,795,629.35	82,207,125.06	236,002,754.41

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：

_____ 杨凯 _____	_____ 张献锦 _____	_____ 何瑜 _____
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。

根据基金管理人宝盈基金管理有限公司 2019 年 6 月 28 日《宝盈基金管理有限公司关于宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同部分条款的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2019 年 7 月 1 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为宝盈中证 100 指数增强 A(原基金份额自动转入宝盈中证 100 指数增强 A);在投资者申购时不收取申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为宝盈中证 100 指数增强 C。宝盈中证 100 指数增强 A 和宝盈中证 100 指数增强 C 分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明

确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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，应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。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，暂免征收个人所得税。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	56,327,658.32
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	56,327,658.32

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	262,674,023.08	282,701,376.92	20,027,353.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,047,300.00	9,004,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	9,047,300.00	9,004,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	271,721,323.08	291,705,876.92	19,984,553.84

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,231.37
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	17.80
应收债券利息	95,979.45
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.20

合计	100,240.82
----	------------

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	150,218.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	150,218.00

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付赎回费	6,137.23
应付证券出借违约金	-
预提费用	309,507.60
合计	315,644.83

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	135,693,902.30	135,693,902.30
本期申购	105,435,501.53	105,435,501.53
本期赎回（以“-”号填列）	-75,300,911.65	-75,300,911.65
本期末	165,828,492.18	165,828,492.18

金额单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,908,091.72	7,908,091.72
本期申购	8,133,936.43	8,133,936.43
本期赎回（以“-”号填列）	-14,473,572.38	-14,473,572.38
本期末	1,568,455.77	1,568,455.77

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,626,998.92	44,612,019.13	99,239,018.05
本期利润	18,239,118.72	-11,554,732.66	6,684,386.06
本期基金份额交易产生的变动数	19,768,581.34	6,955,071.81	26,723,653.15
其中：基金申购款	55,552,203.52	23,090,752.32	78,642,955.84
基金赎回款	-35,783,622.18	-16,135,680.51	-51,919,302.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,634,698.98	40,012,358.28	132,647,057.26

单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,137,867.52	2,600,198.43	5,738,065.95
本期利润	1,052,748.24	-1,304,967.46	-252,219.22
本期基金份额交易产生的变动数	-3,335,444.44	-916,514.71	-4,251,959.15
其中：基金申购款	3,735,288.25	1,537,715.00	5,273,003.25
基金赎回款	-7,070,732.69	-2,454,229.71	-9,524,962.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	855,171.32	378,716.26	1,233,887.58

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,167.47
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	524.55
其他	280.22
合计	33,972.24

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	99,359,793.10
减：卖出股票成本总额	81,232,637.45
买卖股票差价收入	18,127,155.65

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,065,973.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,808,689.40
减：应收利息总额	265,173.16
买卖债券差价收入	-7,889.40

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,379,401.14
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,379,401.14

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-12,859,700.12
——股票投资	-12,808,209.52
——债券投资	-51,490.60
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-12,859,700.12

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	89,647.71
基金转换费收入	15,735.99
合计	105,383.70

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	362,082.49
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	362,082.49

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,085.37
合计	91,592.97

#### 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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须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(以下简称“宝盈基金公司”)	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、基金销售机构

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

无。

##### 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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	758,766.81	814,760.80
其中：支付销售机构的客户维护费	223,941.15	242,761.31

注：支付基金管理人宝盈基金公司的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：

日管理人报酬 = 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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	151,753.40	162,952.15

注：支付基金托管人中国建设银行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

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C	合计
宝盈基金公司	-	31,388.10	31,388.10
中国建设银行	-	-	-
合计	-	31,388.10	31,388.10

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日宝盈中证 100 指数增强 C 的基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日宝盈中证 100 指数增强 C 的基金资产净值 × 0.80%/ 当年天数。

2、本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈中证 100 指数增强 C”，无上年度可比期间数据。

#### 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

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C
报告期初持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.78%	-

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人宝盈基金公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

## 6.4.10.5.2 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

无。

## 6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	56,327,658.32	33,167.47	4,782,064.35	15,605.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	11.33	11.33	8,076	91,501.08	91,501.08	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2021 年 1 月 8 日	新股未上市及科创板新股锁定期	16.42	16.42	5,116	84,004.72	84,004.72	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,264	81,911.52	81,911.52	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,149	79,809.50	79,809.50	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688365	光云科技	2020 年 4 月 22 日	2020 年 10 月 29 日	科创板新股锁定期	10.80	43.22	8,249	89,089.20	356,521.78	-
688090	瑞松科技	2020 年 2 月 7 日	2020 年 8 月 17 日	科创板新股锁定期	27.55	59.45	3,013	83,008.15	179,122.85	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上

市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

#### **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**

无。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

### **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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,004,500.00	7,805,880.00
合计	9,004,500.00	7,805,880.00

注：未评级债券为国债。

#### 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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%；本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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 2020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	56,327,658.32	-	-	-	56,327,658.32
结算备付金	39,464.05	-	-	-	39,464.05
存出保证金	27,195.61	-	-	-	27,195.61
交易性金融资产	9,004,500.00	-	-	282,701,376.92	291,705,876.92
应收利息	-	-	-	100,240.82	100,240.82
应收申购款	-	-	-	621,414.52	621,414.52
资产总计	65,398,817.98	-	-	283,423,032.26	348,821,850.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	44,387,166.98	44,387,166.98
应付赎回款	-	-	-	2,543,560.16	2,543,560.16
应付管理人报酬	-	-	-	120,287.99	120,287.99
应付托管费	-	-	-	24,057.59	24,057.59
应付销售服务费	-	-	-	3,021.90	3,021.90

应付交易费用	-	-	-	150,218.00	150,218.00
其他负债	-	-	-	315,644.83	315,644.83
负债总计	-	-	-	47,543,957.45	47,543,957.45
利率敏感度缺口	65,398,817.98	-	-	235,879,074.81	301,277,892.79
上年度末 2019 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	7,180,047.84	-	-	-	7,180,047.84
结算备付金	189,323.98	-	-	-	189,323.98
存出保证金	32,226.13	-	-	-	32,226.13
交易性金融资产	7,805,880.00	-	-	234,347,081.37	242,152,961.37
应收利息	-	-	-	162,190.04	162,190.04
应收申购款	-	-	-	765,426.14	765,426.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,207,477.95	-	-	235,274,697.55	250,482,175.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,288,272.34	1,288,272.34
应付管理人报酬	-	-	-	167,653.80	167,653.80
应付托管费	-	-	-	33,530.76	33,530.76
应付销售服务费	-	-	-	8,964.93	8,964.93
应付交易费用	-	-	-	121,305.00	121,305.00
其他负债	-	-	-	283,370.65	283,370.65
负债总计	-	-	-	1,903,097.48	1,903,097.48
利率敏感度缺口	15,207,477.95	-	-	233,371,600.07	248,579,078.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 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 2.99%（2019 年 12 月 31 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 3.14%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	282,701,376.92	93.83	234,347,081.37	94.27
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	282,701,376.92	93.83	234,347,081.37	94.27

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 100 指数以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(2020 年 6 月 30 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
	中证 100 指数上升 5%	13,807,911.48	11,302,832.55
中证 100 指数下降 5%	-13,807,911.48	-11,302,832.55	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	282,701,376.92	81.04
	其中：股票	282,701,376.92	81.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,004,500.00	2.58
	其中：债券	9,004,500.00	2.58
	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	56,367,122.37	16.16
8	其他各项资产	748,850.95	0.21
9	合计	348,821,850.24	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境内股票投资组合

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	6,451,768.00	2.14
B	采矿业	7,450,621.00	2.47
C	制造业	111,786,459.92	37.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,270,672.00	2.08
E	建筑业	5,689,091.80	1.89
F	批发和零售业	2,044,712.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	6,849,973.00	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,165,009.00	1.05
J	金融业	108,508,401.69	36.02
K	房地产业	11,457,738.00	3.80
L	租赁和商务服务业	5,921,180.84	1.97
M	科学研究和技术服务业	2,382,156.00	0.79
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	549,450.00	0.18
Q	卫生和社会工作	2,532,700.50	0.84
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	281,059,933.75	93.29

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	64,980.00	0.02
C	制造业	945,779.50	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,830.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,486.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	485,796.35	0.16
J	金融业	117,207.00	0.04
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	4,364.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,641,443.17	0.54

### 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	320,025	22,849,785.00	7.58
2	600519	贵州茅台	14,400	21,065,472.00	6.99
3	600036	招商银行	307,700	10,375,644.00	3.44
4	600276	恒瑞医药	109,273	10,085,897.90	3.35
5	000858	五粮液	55,766	9,542,677.92	3.17
6	000333	美的集团	144,350	8,630,686.50	2.86
7	000651	格力电器	140,900	7,970,713.00	2.65
8	600030	中信证券	280,300	6,758,033.00	2.24
9	002475	立讯精密	121,388	6,233,273.80	2.07
10	601166	兴业银行	374,900	5,915,922.00	1.96

11	600887	伊利股份	179,100	5,575,383.00	1.85
12	000002	万科 A	198,500	5,188,790.00	1.72
13	601398	工商银行	1,023,700	5,098,026.00	1.69
14	600900	长江电力	256,700	4,861,898.00	1.61
15	601888	中国中免	27,600	4,251,228.00	1.41
16	601328	交通银行	802,700	4,117,851.00	1.37
17	300059	东方财富	187,431	3,786,106.20	1.26
18	600585	海螺水泥	70,400	3,724,864.00	1.24
19	000725	京东方 A	789,900	3,688,833.00	1.22
20	600000	浦发银行	342,533	3,623,999.14	1.20
21	000001	平安银行	282,820	3,620,096.00	1.20
22	002714	牧原股份	44,050	3,612,100.00	1.20
23	600016	民生银行	621,560	3,524,245.20	1.17
24	603288	海天味业	28,320	3,523,008.00	1.17
25	002415	海康威视	110,987	3,368,455.45	1.12
26	600837	海通证券	262,500	3,302,250.00	1.10
27	000063	中兴通讯	82,000	3,290,660.00	1.09
28	600031	三一重工	174,200	3,267,992.00	1.08
29	601688	华泰证券	171,800	3,229,840.00	1.07
30	600048	保利地产	209,300	3,093,454.00	1.03
31	601668	中国建筑	616,940	2,942,803.80	0.98
32	601288	农业银行	840,400	2,840,552.00	0.94
33	300498	温氏股份	130,260	2,839,668.00	0.94
34	300015	爱尔眼科	58,290	2,532,700.50	0.84
35	601601	中国太保	91,200	2,485,200.00	0.82
36	601229	上海银行	291,485	2,419,325.50	0.80
37	603259	药明康德	24,660	2,382,156.00	0.79
38	002142	宁波银行	90,520	2,377,960.40	0.79
39	600309	万华化学	46,400	2,319,536.00	0.77
40	601211	国泰君安	131,600	2,271,416.00	0.75
41	601988	中国银行	619,000	2,154,120.00	0.71
42	601169	北京银行	434,200	2,127,580.00	0.71
43	002352	顺丰控股	38,100	2,084,070.00	0.69
44	600009	上海机场	28,800	2,075,616.00	0.69
45	600690	海尔智家	114,800	2,031,960.00	0.67
46	601766	中国中车	357,300	1,990,161.00	0.66
47	000568	泸州老窖	21,700	1,977,304.00	0.66
48	002594	比亚迪	26,000	1,866,800.00	0.62
49	600999	招商证券	83,600	1,835,020.00	0.61

50	002304	洋河股份	17,300	1,818,922.00	0.60
51	601899	紫金矿业	408,100	1,795,640.00	0.60
52	600104	上汽集团	102,400	1,739,776.00	0.58
53	002027	分众传媒	299,812	1,669,952.84	0.55
54	601818	光大银行	465,600	1,666,848.00	0.55
55	600919	江苏银行	286,400	1,623,888.00	0.54
56	600028	中国石化	391,200	1,529,592.00	0.51
57	001979	招商蛇口	92,900	1,527,276.00	0.51
58	601628	中国人寿	51,500	1,401,315.00	0.47
59	601088	中国神华	94,400	1,355,584.00	0.45
60	600406	国电南瑞	66,900	1,354,725.00	0.45
61	000538	云南白药	14,335	1,344,766.35	0.45
62	000895	双汇发展	28,600	1,318,174.00	0.44
63	000166	申万宏源	260,045	1,313,227.25	0.44
64	601009	南京银行	178,100	1,305,473.00	0.43
65	600050	中国联通	268,100	1,297,604.00	0.43
66	601186	中国铁建	147,200	1,233,536.00	0.41
67	601006	大秦铁路	170,800	1,202,432.00	0.40
68	600019	宝钢股份	263,400	1,201,104.00	0.40
69	000776	广发证券	84,900	1,198,788.00	0.40
70	601857	中国石油	279,300	1,170,267.00	0.39
71	603160	汇顶科技	5,200	1,159,080.00	0.38
72	600015	华夏银行	176,800	1,082,016.00	0.36
73	601989	中国重工	261,900	1,047,600.00	0.35
74	601336	新华保险	23,600	1,045,008.00	0.35
75	601933	永辉超市	111,400	1,044,932.00	0.35
76	002024	苏宁易购	114,000	999,780.00	0.33
77	600346	恒力石化	65,800	921,200.00	0.31
78	002736	国信证券	81,000	915,300.00	0.30
79	600340	华夏幸福	39,200	896,112.00	0.30
80	601138	工业富联	56,400	854,460.00	0.28
81	601225	陕西煤业	117,400	846,454.00	0.28
82	601669	中国电建	223,800	774,348.00	0.26
83	603993	洛阳钼业	205,200	753,084.00	0.25
84	600606	绿地控股	121,700	752,106.00	0.25
85	601985	中国核电	180,800	739,472.00	0.25
86	601800	中国交建	100,600	738,404.00	0.25
87	601111	中国国航	86,500	571,765.00	0.19
88	601066	中信建投	14,400	567,072.00	0.19

89	601998	中信银行	107,240	552,286.00	0.18
90	002607	中公教育	19,800	549,450.00	0.18
91	601816	京沪高铁	83,000	517,090.00	0.17
92	601360	三六零	28,000	512,680.00	0.17
93	003816	中国广核	164,400	486,624.00	0.16
94	601881	中国银河	36,100	414,067.00	0.14
95	600018	上港集团	95,000	399,000.00	0.13
96	601319	中国人保	57,900	372,876.00	0.12
97	601658	邮储银行	73,800	337,266.00	0.11
98	601238	广汽集团	25,300	227,700.00	0.08
99	600025	华能水电	48,200	182,678.00	0.06

### 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	688365	光云科技	8,249	356,521.78	0.12
2	688090	瑞松科技	3,013	179,122.85	0.06
3	600926	杭州银行	10,800	96,336.00	0.03
4	601012	隆基股份	2,300	93,679.00	0.03
5	688528	秦川物联	8,076	91,501.08	0.03
6	300122	智飞生物	900	90,135.00	0.03
7	688377	迪威尔	5,116	84,004.72	0.03
8	688027	国盾量子	2,264	81,911.52	0.03
9	688600	皖仪科技	5,149	79,809.50	0.03
10	601633	长城汽车	10,300	79,516.00	0.03
11	600570	恒生电子	610	65,697.00	0.02
12	601898	中煤能源	17,100	64,980.00	0.02
13	603087	甘李药业	602	60,380.60	0.02
14	002555	三七互娱	1,100	51,480.00	0.02
15	002179	中航光电	760	31,167.60	0.01
16	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
17	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
18	601377	兴业证券	1,800	12,330.00	0.00
19	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
20	002414	高德红外	340	9,955.20	0.00
21	600010	包钢股份	7,920	8,553.60	0.00
22	600958	东方证券	900	8,541.00	0.00
23	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
24	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00

25	002032	苏泊尔	100	7,100.00	0.00
26	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
27	600115	东方航空	1,300	5,486.00	0.00
28	600011	华能国际	1,200	5,064.00	0.00
29	300251	光线传媒	400	4,364.00	0.00
30	600038	中直股份	100	4,107.00	0.00
31	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

#### 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	10,534,606.00	4.24
2	600519	贵州茅台	8,835,915.45	3.55
3	600036	招商银行	4,740,444.00	1.91
4	600276	恒瑞医药	4,492,736.20	1.81
5	000858	五粮液	4,015,051.20	1.62
6	000333	美的集团	3,818,181.00	1.54
7	000651	格力电器	3,671,655.00	1.48
8	601398	工商银行	3,445,390.00	1.39
9	002714	牧原股份	3,334,946.00	1.34
10	601166	兴业银行	2,974,664.00	1.20
11	600030	中信证券	2,953,483.00	1.19
12	000002	万科 A	2,675,758.00	1.08
13	002475	立讯精密	2,526,254.10	1.02
14	600887	伊利股份	2,394,195.00	0.96
15	600900	长江电力	2,187,881.00	0.88
16	600585	海螺水泥	1,962,730.00	0.79
17	601688	华泰证券	1,906,684.70	0.77
18	601328	交通银行	1,897,517.92	0.76
19	000725	京东方 A	1,834,220.00	0.74
20	600000	浦发银行	1,684,120.05	0.68

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，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	6,763,790.44	2.72
2	600519	贵州茅台	5,107,057.00	2.05
3	688012	中微公司	3,829,281.22	1.54
4	600036	招商银行	2,829,952.00	1.14
5	601166	兴业银行	2,602,396.86	1.05
6	600276	恒瑞医药	2,269,767.88	0.91
7	000651	格力电器	2,265,560.00	0.91
8	000333	美的集团	2,142,012.70	0.86
9	000858	五粮液	2,045,425.64	0.82
10	601288	农业银行	1,561,110.00	0.63
11	600030	中信证券	1,533,357.00	0.62
12	600016	民生银行	1,475,537.00	0.59
13	600887	伊利股份	1,396,454.00	0.56
14	000002	万科 A	1,224,217.69	0.49
15	000001	平安银行	1,187,677.00	0.48
16	601328	交通银行	1,139,087.00	0.46
17	600000	浦发银行	1,086,376.00	0.44
18	600900	长江电力	1,071,015.00	0.43
19	002415	海康威视	1,033,891.00	0.42
20	002475	立讯精密	1,024,088.00	0.41

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，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	142,395,142.52
卖出股票收入（成交）总额	99,359,793.10

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	9,004,500.00	2.99
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	9,004,500.00	2.99

## 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	019627	20 国债 01	90,000	9,004,500.00	2.99

## 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持有股指期货。

### 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持有国债期货。

### 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的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本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除中信证券和兴业银行外未受到公开谴责、处罚。

2020 年 5 月 15 日，中信证券收到中国银行间市场交易商协会 2020 年第 5 次自律处分会议审议决定书，对中信证券股份有限公司予以警告、责令整改处罚，具体内容如下：中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对中信证券予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

中信证券是中证 100 指数前十大成份股，本基金依照成份股权重对中信证券做了配置。同时，本基金认为上述事件是中信证券在经营管理决策体系上的问题，事件本身并不影响公司主营业务的发展，本基金在关注中信证券自身业务发展的同时，也会持续关注公司在公司治理方面的改善，并将公司治理加入到对该公司的长期价值评估中。

2020 年 5 月 15 日，兴业银行收到中国银行间市场交易商协会 2020 年第 5 次自律处分会议审议决定书，对兴业银行予以警告、责令整改处罚，具体内容如下：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对兴业银行予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

兴业银行是中证 100 指数前十大成份股，本基金依照成份股权重对兴业银行做了配置。本基金认为，兴业市场化程度较高，耕耘“商行+投行”，未来混业经营大趋势将使其有估值提升的长逻辑，具有长期投资价值，上述事件本身并不影响公司主营业务的发展，本基金在关注兴业银行自身业务发展的同时，也会持续关注公司在公司治理方面的改善，并将公司治理加入到对该公司的长期价值评估中。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	27,195.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	100,240.82
5	应收申购款	621,414.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	748,850.95

#### 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	688365	光云科技	356,521.78	0.12	科创板新股锁定期
2	688090	瑞松科技	179,122.85	0.06	科创板新股锁定期
3	688528	秦川物联	91,501.08	0.03	新股未上市

#### 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

份额级别	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
宝盈中证 100 指数增强 A	10,773	15,392.97	76,301,665.35	46.01%	89,526,826.83	53.99%
宝盈中证 100 指数增强 C	1,088	1,441.60	-	-	1,568,455.77	100.00%

合计	11,861	14,113.22	76,301,665.35	45.58%	91,095,282.60	54.42%
----	--------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

注：① 本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

② 户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	宝盈中证 100 指数增强 A	23,614.29	0.0142%
	宝盈中证 100 指数增强 C	1,383.18	0.0882%
	合计	24,997.47	0.0149%

分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	份额级别	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	宝盈中证 100 指数增强 A	0~10
	宝盈中证 100 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈中证 100 指数增强 A	0
	宝盈中证 100 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C
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	135,693,902.30	7,908,091.72
本报告期基金总申购份额	105,435,501.53	8,133,936.43
减：本报告期基金总赎回份额	75,300,911.65	14,473,572.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	165,828,492.18	1,568,455.77

## § 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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	172,048,971.41	73.14%	156,751.68	73.13%	-
华泰证券	1	63,191,959.63	26.86%	57,586.41	26.87%	-

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、本基金本报告期末新租和退租交易单元。

### 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	14,059,600.00	100.00%	21,100,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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新增中国人寿保险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	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020年6月24日
2	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020年3月17日
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下七只基金(C类)新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020年6月11日
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020年6月3日
5	宝盈基金管理有限公司关于增加安信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020年4月30日

6	宝盈基金管理有限公司关于增加国元证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 29 日
7	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券华南股份有限公司相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
8	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 (2020 年第 1 次)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
9	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 (2020 年第 1 次)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
10	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 25 日
11	宝盈基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 24 日
12	宝盈基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
13	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
14	宝盈基金管理有限公司旗下 34 只基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 4 月 22 日
15	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2019 年年度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 11 日
16	宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 4 月 11 日
17	宝盈基金管理有限公司关于新增泛华普益基金销售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	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 10 日
18	宝盈基金管理有限公司关于	上海证券报, 证券日报, 证券时	2020 年 3 月 31 日

	新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	
19	宝盈基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 25 日
20	宝盈基金管理有限公司关于新增大连网金基金销售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	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 24 日
21	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 17 日
22	宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 1 月 17 日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 8 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 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

## 12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别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

2020 年 8 月 31 日