

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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 2023 年 8 月 29 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 2023 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	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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	57
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	57
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	131,171,120.43 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	126,281,809.87 份	4,889,310.56 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	王小飞
	联系电话	0755-83276688	021-60637103
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	021-60637228
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	严震	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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023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	
本期已实现收益	2,245,457.75	55,541.62	
本期利润	4,392,252.02	-40,324.79	
加权平均基金份额本期利润	0.0313	-0.0079	
本期加权平均净值利润率	1.88%	-0.49%	
本期基金份额净值增长率	0.31%	0.00%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
	期末可供分配利润	77,451,555.02	2,800,013.82
	期末可供分配基金份额利润	0.6133	0.5727
	期末基金资产净值	203,733,364.89	7,689,324.38

期末基金份额净值	1.613	1.573
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	95.63%	20.33%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

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	2.87%	0.89%	1.87%	0.89%	1.00%	0.00%
过去三个月	-4.05%	0.82%	-5.55%	0.83%	1.50%	-0.01%
过去六个月	0.31%	0.84%	-1.16%	0.85%	1.47%	-0.01%
过去一年	-12.31%	0.99%	-15.48%	1.00%	3.17%	-0.01%
过去三年	8.69%	1.16%	-11.25%	1.17%	19.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	95.63%	1.32%	22.19%	1.33%	73.44%	-0.01%

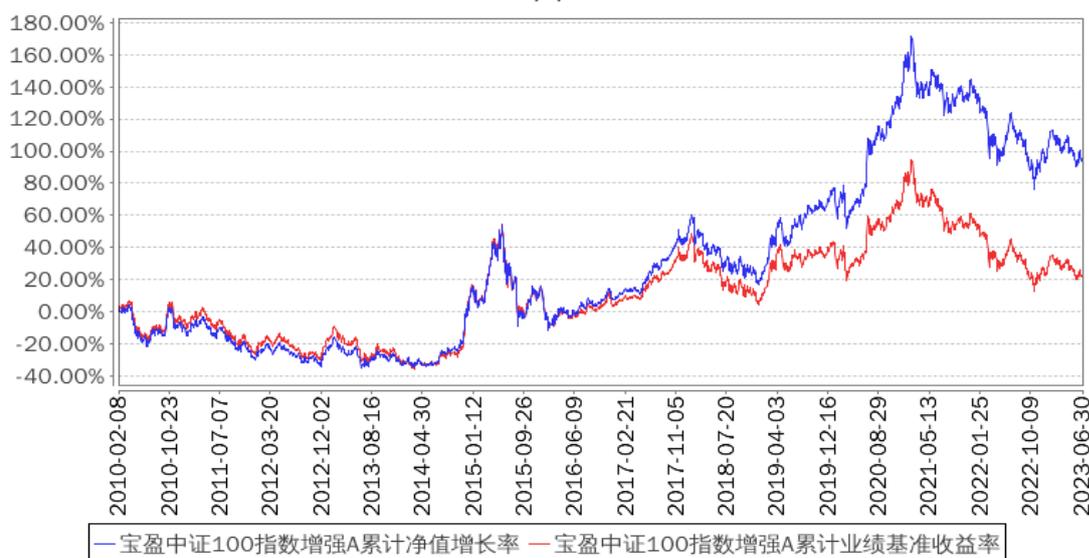
宝盈中证 100 指数增强 C

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	2.88%	0.89%	1.87%	0.89%	1.01%	0.00%
过去三个月	-4.20%	0.82%	-5.55%	0.83%	1.35%	-0.01%
过去六个月	0.00%	0.84%	-1.16%	0.85%	1.16%	-0.01%

过去一年	-12.97%	0.99%	-15.48%	1.00%	2.51%	-0.01%
过去三年	6.12%	1.16%	-11.25%	1.17%	17.37%	-0.01%
自基金合同生效起至今	20.33%	1.15%	-9.27%	1.16%	29.60%	-0.01%

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

宝盈中证100指数增强A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



宝盈中证100指数增强C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



§ 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、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈优质成长混合、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合、宝盈祥和 9 个月定开混合、宝盈安盛中短债债券、宝盈祥琪混合、宝盈新能源产业混合发起式、宝盈国证证券龙头指数发起式、宝盈聚鑫一年定期开放债券发起式、宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式、宝盈半导体产业混合发起式五十九只基金，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、宝盈祥瑞混合型证券投资基金	2017 年 8 月 5 日	-	12 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

	金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金基金经理				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,曾任宝盈策略增长混合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：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；
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 2023 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

今年一季度，随着疫情影响的消退，在稳经济政策提前部署的前提下，国内经济持续恢复，生产和需求双双改善，就业和物价总体保持稳定。内需回升在一定程度上抵消了外需放缓的压力，经济总体呈现出企稳回升态势。二季度经济分歧加剧，信贷、投资、消费、生产数据表现疲弱，海外加息预期反复、人民币汇率贬值明显，沪指跌破 3200 点。今年上半年上证综指走出了倒 V 型走势，5 月上旬之前震荡攀升，于 5 月 9 日达到本轮反弹最高点 3418.95 点，之后震荡回落，6 月底收于 3202.06 点，区间上涨 3.65%。

从成交额来看，一、二季度日均成交额分别在 8782 亿和 10052 亿，连续 2 个季度反弹，交投相对活跃。伴随着美国加息及利率维持在高位，美元相对人民币升值明显，2 月份至 6 月底美元兑人民币汇率持续攀升，上半年累计升值幅度达 4.47%，从北向资金来看，一季度大幅净流入 1859.88 亿元，但二季度以净流出为主，区间累计净流出 26.64 亿元。

从市场走势来看，上半年主要宽基指数之间的分化不算太大，价值、红利类指数表现较好，而创业板、成长类指数表现较弱。主要指数表现如下：上证 50 下跌 5.43%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，中证 1000 上涨 5.1%，创业板指下跌 5.61%，上证综指上涨 3.65%，中证 100 下跌 1.26%。分行业来看是涨跌参半，行业之间分化较大，TMT 领涨，消费地产领跌，涨幅前五的行业分别为：通信（上涨 45.41%）、传媒（上涨 43.43%）、计算机（上涨 32.27%）、家电（上涨 17.42%）和机械（上涨 12.97%）；跌幅前五的行业：消费者服务（下跌 27.92%）、房地产（下跌 14.07%）、综合（下跌 11.77%）、农林牧渔（下跌 9.21%）和建材（下跌 8.98%）。

从大小盘风格来看，上半年大小盘风格分化不太明显，但价值风格继续大幅跑赢成长风格，

从区间表现来看，大盘价值上涨 5.82%，小盘价值上涨 3.42%，中盘价值上涨 2.92%，而对应的成长指数表现偏弱：大盘成长下跌 7.31%，中盘成长下跌 8.32%，小盘成长上涨 0.73%。

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，同时积极参与主板、科创板和创业板的网下新股申购。2023 年上半年本基金 A 份额相对基准超额收益为 1.47%，年化跟踪误差为 0.8%；本基金 C 份额 2023 年上半年单位净值没变，相对基准超额收益 1.16%。我们将继续努力尽责地做好本基金的管理工作，力争为投资者谋取较好的回报。

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 的基金份额净值为 1.613 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.31%；截至本报告期末宝盈中证 100 指数增强 C 的基金份额净值为 1.573 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.00%。同期业绩比较基准收益率为-1.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储在 6 月停止加息后，决策重新回到增长与通胀，市场加息预期缓和，外部流动性拐点或已出现。海外流动性拐点的出现将对人民币汇率及 A 股资金面形成有力支撑。国内来看，本轮 PMI 最低点为 2022 年 12 月的 47.0%，此后 PMI 指数大幅回升；一季度 GDP 增速为 4.5%，相较于 2022 年四季度 GDP 累计增速 3%有明显回升，我们认为，我国经济已于今年 1 月份开始步入复苏期。

当前来看 A 股整体估值处于较低水平，股权风险溢价处于相对高位。从指数估值水平来看，以 2023/7/19 为基准，上证 50 的 PE 为 9.68 倍，沪深 300 的 PE 为 11.66 倍，中证 500 的 PE 为 23.08 倍，中证 800 的 PE 为 12.98 倍，中证 1000 的 PE 为 36.05 倍。从 PE 所处的历史分位数来看，上证 50 位于历史的 25.09%左右，沪深 300 处于历史的 24.68%左右，中证 500 位于历史的 16.43%左右，中证 800 和中证 1000 分别位于历史 28.07%和 31.93%左右，整体来看，估值都处于中性偏低水平。中证 100 指数以最新成份股用整体法测算当前 PE 为 12.88X，位于 2015 年以来的 14.1%分位数水平，整体估值具备明显的优势，赔率处于较高的水平。

展望 2023 年下半年，中国经济或仍将处于复苏期，A 股面临的宏观经济环境与 2013 年颇为相似，然而宏观货币环境相对更加友好，因此我们对下半年 A 股市场并不悲观，A 股市场流动性有望维持宽松水平，当前 A 股市场整体的估值水平不高，拉长窗口期来看，我们认为当前机会多

于风险。

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、流通受限股票等估值参考数据。

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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,085,567.23	8,468,381.33
结算备付金		12,783.57	338,153.52
存出保证金		23,938.31	26,723.25
交易性金融资产	6.4.7.2	205,342,699.53	260,229,618.08
其中：股票投资		198,227,623.09	252,097,141.91
基金投资		-	-
债券投资		7,115,076.44	8,132,476.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,200,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		269,880.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		86,371.28	1,115,052.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		211,821,240.38	272,377,928.43
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 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		-	-
应付清算款		-	2,627,975.39
应付赎回款		122,308.03	118,511.57
应付管理人报酬		130,286.67	178,880.37
应付托管费		26,057.35	35,776.06
应付销售服务费		5,143.95	4,649.69
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	114,755.11	214,180.53
负债合计		398,551.11	3,179,973.61
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	131,171,120.43	167,555,748.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	80,251,568.84	101,642,206.77
净资产合计		211,422,689.27	269,197,954.82
负债和净资产总计		211,821,240.38	272,377,928.43

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.613 元，A 类基金份额 126,281,809.87 份；C 类基金份额净值人民币 1.573 元，C 类基金份额 4,889,310.56 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 131,171,120.43 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 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
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,563,245.20	-14,196,443.35
1. 利息收入		14,708.00	13,493.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,868.22	13,347.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		839.78	145.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,416,645.26	-1,049,709.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	857,990.13	-3,072,300.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	63,826.16	67,113.68
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,494,828.97	1,955,477.65
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,050,927.86	-13,187,150.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	80,964.08	26,923.06
减：二、营业总支出		1,211,317.97	1,101,859.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	906,608.47	814,141.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	181,321.74	162,828.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32,832.86	34,961.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		779.75	98.41
其中：卖出回购金融资产支出		779.75	98.41
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,775.15	89,830.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,351,927.23	-15,298,303.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,351,927.23	-15,298,303.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,351,927.23	-15,298,303.33

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	167,555,748.05	-	101,642,206.77	269,197,954.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	167,555,748.05	-	101,642,206.77	269,197,954.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,384,627.62	-	-21,390,637.93	-57,775,265.55
(一)、综合收益总额	-	-	4,351,927.23	4,351,927.23
(二)、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)	-36,384,627.62	-	-25,742,565.16	-62,127,192.78
其中：1. 基金申	10,240,308.43	-	6,831,942.60	17,072,251.03

购款				
2. 基金赎回款	-46,624,936.05	-	-32,574,507.76	-79,199,443.81
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	131,171,120.43	-	80,251,568.84	211,422,689.27
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	107,106,527.41	-	147,961,196.70	255,067,724.11
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	107,106,527.41	-	147,961,196.70	255,067,724.11

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,486,960.57	-	-21,814,635.46	-26,301,596.03
(一)、综合收益总额	-	-	-15,298,303.33	-15,298,303.33
(二)、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)	-4,486,960.57	-	-6,516,332.13	-11,003,292.70
其中:1.基金申购款	12,290,677.33	-	13,677,087.27	25,967,764.60
2.基金赎回款	-16,777,637.90	-	-20,193,419.40	-36,971,057.30
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基	102,619,566.84	-	126,146,561.24	228,766,128.08

金净值)				
------	--	--	--	--

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>杨凯</u>	<u>张献锦</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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产(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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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
	2023 年 6 月 30 日
活期存款	6,085,567.23
等于：本金	6,085,015.37
加：应计利息	551.86
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,085,567.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	214,795,729.99	-	198,227,623.09	-16,568,106.90	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	7,000,580.00	116,176.44	7,115,076.44	-1,680.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,000,580.00	116,176.44	7,115,076.44	-1,680.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	221,796,309.99	116,176.44	205,342,699.53	-16,569,786.90	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	172.31

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,322.65
其中：交易所市场	25,322.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	114,755.11

6.4.7.10 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,839,079.21	162,839,079.21
本期申购	8,002,715.49	8,002,715.49
本期赎回（以“-”号填列）	-44,559,984.83	-44,559,984.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	126,281,809.87	126,281,809.87

宝盈中证 100 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,716,668.84	4,716,668.84
本期申购	2,237,592.94	2,237,592.94
本期赎回（以“-”号填列）	-2,064,951.22	-2,064,951.22
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,889,310.56	4,889,310.56

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	152,481,770.18	-53,543,469.89	98,938,300.29
本期利润	2,245,457.75	2,146,794.27	4,392,252.02

本期基金份额交易产生的变动数	-34,190,327.10	8,311,329.81	-25,878,997.29
其中：基金申购款	7,495,835.62	-2,110,451.27	5,385,384.35
基金赎回款	-41,686,162.72	10,421,781.08	-31,264,381.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	120,536,900.83	-43,085,345.81	77,451,555.02

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	4,190,818.99	-1,486,912.51	2,703,906.48
本期利润	55,541.62	-95,866.41	-40,324.79
本期基金份额交易产生的变动数	152,846.08	-16,413.95	136,432.13
其中：基金申购款	1,981,193.73	-534,635.48	1,446,558.25
基金赎回款	-1,828,347.65	518,221.53	-1,310,126.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,399,206.69	-1,599,192.87	2,800,013.82

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	12,869.47
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	725.10
其他	273.65
合计	13,868.22

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	857,990.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	857,990.13

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	95,773,563.11
减：卖出股票成本总额	94,690,879.88
减：交易费用	224,693.10
买卖股票差价收入	857,990.13

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	74,676.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,850.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	63,826.16

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,103,400.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,010,850.00
减：应计利息总额	103,400.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-10,850.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,494,828.97
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	2,494,828.97

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,050,927.86
股票投资	2,032,657.86
债券投资	18,270.00
资产支持证券投资	-

基金投资	-
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	2,050,927.86

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	80,846.71
基金转换费收入	117.37
合计	80,964.08

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	515.00
合计	89,775.15

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以及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（“宝盈基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司（“中国外贸信托”）	基金管理人的股东
中铁信托有限责任公司（“中铁信托”）	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司（“中铁宝盈”）	基金管理人的子公司

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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	906,608.47	814,141.77
其中：支付销售机构的客户维护费	212,017.96	243,478.24

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	181,321.74	162,828.38

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	993.16	993.16
中国建设银行	-	-	-
合计	-	993.16	993.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	8,041.46	8,041.46
中国建设银行	-	-	-
合计	-	8,041.46	8,041.46

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日本基金 C 类份额的基金资产净值 0.8% 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：

日基金销售服务费=前一日本基金 C 类份额的基金资产净值×0.8%/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

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	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 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
基金合同生效日（2010 年 2 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/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	2.3400%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 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
基金合同生效日（2010 年 2 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/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	2.9800%	-

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	6,085,567.23	12,869.47	7,385,668.71	12,422.73

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（2023 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	受限期	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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	77	2,150.61	2,543.31	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	284	3,373.92	5,969.68	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	96	1,985.28	2,447.04	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	141	2,168.58	2,096.67	-

001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	44.48	39.48	48	2,135.04	1,895.04	-
300804	广康生 化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	42.45	32.97	197	8,362.65	6,495.09	-
301141	中科磁 业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301170	锡南科 技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	34.00	34.93	166	5,644.00	5,798.38	-
301203	国泰环 保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股 份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	57.88	49.17	136	7,871.68	6,687.12	-
301225	恒勃股 份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	35.66	33.26	244	8,701.04	8,115.44	-
301232	飞沃科 技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	72.50	58.42	107	7,757.50	6,250.94	-
301246	宏源药 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	50.00	30.71	342	17,100.00	10,502.82	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	30.85	23.63	591	18,232.35	13,965.33	-
301261	恒工精 密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	36.90	36.90	139	5,129.10	5,129.10	-
301261	恒工精 密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股流 通受限	36.90	36.90	1,242	45,829.80	45,829.80	-
301262	海看股 份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	30.22	25.50	305	9,217.10	7,777.50	-
301281	科源制 药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	44.18	25.10	237	10,470.66	5,948.70	-
301281	科源制 药	2023 年 5 月 26 日	1-6 个 月(含)	新股流 通受限- 送股	-	25.10	95	-	2,384.50	-
301291	明阳电	2023 年	6 个月	新股流	38.13	31.03	277	10,562.01	8,595.31	-

	气	6月21日		通受限							
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	3,389	67,746.11	67,746.11		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	377	7,536.23	7,536.23		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	243	7,192.80	17,355.06		-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	2,623	13,115.00	23,502.08		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	571	15,302.80	12,744.72		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	347	8,761.75	6,832.43		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	307	9,928.38	9,781.02		-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	186	12,514.08	12,169.98		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	183	5,909.07	9,354.96		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	95	12,455.45	5,057.80		-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	新股流通受限-送股	-	53.24	48	-	2,555.52		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	143	5,585.58	5,628.48		-
301332	德尔玛	2023年	6个月	新股流	14.81	13.73	491	7,271.71	6,741.43		-

		5月9日		通受限							
301337	亚华电子	2023年 5月16日	6个月	新股流 通受限	32.60	30.37	171	5,574.60	5,193.27		-
301345	涛涛车业	2023年 3月10日	6个月	新股流 通受限	73.45	46.64	123	9,034.35	5,736.72		-
301355	南王科技	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	17.55	16.75	372	6,528.60	6,231.00		-
301357	北方长龙	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	50.00	48.39	137	6,850.00	6,629.43		-
301358	湖南裕能	2023年 2月1日	6个月	新股流 通受限	23.77	42.89	355	8,438.35	15,225.95		-
301360	荣旗科技	2023年 4月17日	6个月	新股流 通受限	71.88	92.60	101	7,259.88	9,352.60		-
301373	凌玮科技	2023年 1月20日	6个月	新股流 通受限	33.73	31.85	263	8,870.99	8,376.55		-
301376	致欧科技	2023年 6月14日	6个月	新股流 通受限	24.66	22.51	259	6,386.94	5,830.09		-
301382	蜂助手	2023年 5月9日	6个月	新股流 通受限	23.80	32.84	239	5,688.20	7,848.76		-
301383	天键股份	2023年 5月31日	6个月	新股流 通受限	46.16	35.72	250	11,540.00	8,930.00		-
301386	未来电器	2023年 3月21日	6个月	新股流 通受限	29.99	23.79	309	9,266.91	7,351.11		-
301387	光大同创	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	58.32	45.36	203	11,838.96	9,208.08		-
301397	溯联股份	2023年 6月15日	6个月	新股流 通受限	53.27	40.20	157	8,363.39	6,311.40		-
301399	英特科技	2023年 5月16日	6个月	新股流 通受限	43.99	51.57	193	8,490.07	9,953.01		-
301408	华人健康	2023年 2月22日	6个月	新股流 通受限	16.24	16.95	628	10,198.72	10,644.60		-
301419	阿莱德	2023年	6个月	新股流	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-

		2月2日		通受限							
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	212	5,586.20	6,487.20		-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	433	12,448.75	9,101.66		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	405	8,095.95	6,844.50		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	149	8,591.34	8,591.34		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	1,341	77,322.06	77,322.06		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	1,716	68,262.48	68,262.48		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	191	7,597.98	7,597.98		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	771	5,073.18	5,844.18		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	292	3,025.12	3,457.28		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	236	2,751.76	2,893.36		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	78	2,026.44	1,913.34		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	235	4,183.00	4,204.15		-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特	2023年	6个月	新股流	36.15	38.13	235	8,495.25	8,960.55		-

	气	4月13日		通受限							
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,407	27,943.02	25,410.42		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	429	6,074.64	6,954.09		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	669	8,094.90	8,074.83		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	220	5,192.00	14,227.40		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	238	4,569.60	6,076.14		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	209	5,571.94	6,583.50		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	94	7,050.00	8,531.44		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	2,664	15,158.16	14,412.24		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	870	9,657.00	14,824.80		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	166	5,642.34	4,895.34		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	316	12,636.84	11,600.36		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	322	7,038.92	7,679.70		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	104	15,847.52	14,140.88		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	151	6,594.17	8,010.55		-
688562	航天软	2023年	6个月	新股流	12.68	22.31	447	5,667.96	9,972.57		-

	件	5月15日		通受限							
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	250	7,565.00	6,332.50		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	57	7,170.60	6,727.71		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	236	6,310.64	9,600.48		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	551	6,160.18	8,039.09		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,032	56,760.00	56,760.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	115	6,325.00	6,325.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	624	6,664.32	7,700.16		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	64	8,056.32	5,554.56		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	548	5,074.48	10,187.32		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	168	4,247.04	5,018.16		-

注：1. 根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《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》的有关规定。

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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5. 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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，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人中国建设银行，因而与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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,115,076.44	5,093,679.18
合计	7,115,076.44	5,093,679.18

注：未评级部分为国债、政策性金融债，短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	3,038,796.99
合计	-	3,038,796.99

注：未评级部分为国债、政策性金融债，中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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》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、流通受限制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公司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票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票，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未来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、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	6,085,567.23	-	-	-	6,085,567.23
结算备付金	12,783.57	-	-	-	12,783.57
存出保证金	23,938.31	-	-	-	23,938.31
交易性金融资产	7,115,076.44	-	-	-198,227,623.09	205,342,699.53
应收申购款	-	-	-	86,371.28	86,371.28
应收清算款	-	-	-	269,880.46	269,880.46
资产总计	13,237,365.55	-	-	-198,583,874.83	211,821,240.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	122,308.03	122,308.03
应付管理人报酬	-	-	-	130,286.67	130,286.67
应付托管费	-	-	-	26,057.35	26,057.35
应付销售服务费	-	-	-	5,143.95	5,143.95
其他负债	-	-	-	114,755.11	114,755.11
负债总计	-	-	-	398,551.11	398,551.11
利率敏感度缺口	13,237,365.55	-	-	-198,185,323.72	211,422,689.27
上年度末 2022 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	8,468,381.33	-	-	-	8,468,381.33
结算备付金	338,153.52	-	-	-	338,153.52
存出保证金	26,723.25	-	-	-	26,723.25
交易性金融资产	8,132,476.17	-	-	-252,097,141.91	260,229,618.08
买入返售金融资产	2,200,000.00	-	-	-	2,200,000.00
应收申购款	-	-	-	1,115,052.25	1,115,052.25
资产总计	19,165,734.27	-	-	-253,212,194.16	272,377,928.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	118,511.57	118,511.57
应付管理人报酬	-	-	-	178,880.37	178,880.37
应付托管费	-	-	-	35,776.06	35,776.06
应付清算款	-	-	-	2,627,975.39	2,627,975.39
应付销售服务费	-	-	-	4,649.69	4,649.69
其他负债	-	-	-	214,180.53	214,180.53
负债总计	-	-	-	3,179,973.61	3,179,973.61
利率敏感度缺口	19,165,734.27	-	-	-250,032,220.55	269,197,954.82

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 2023 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 3.37% (2022 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 3.02%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2022 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	198,227,623.09	93.76	252,097,141.91	93.65
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	198,227,623.09	93.76	252,097,141.91	93.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 100 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 中证 100 指数收益率上升 5%	9,509,178.44	12,962,954.31
	2. 中证 100 指数收益率下降 5%	-9,509,178.44	-12,962,954.31

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	197,169,581.97	250,927,350.95
第二层次	7,466,176.54	8,137,117.17
第三层次	706,941.02	1,165,149.96

合计	205,342,699.53	260,229,618.08
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	198,227,623.09	93.58
	其中：股票	198,227,623.09	93.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,115,076.44	3.36
	其中：债券	7,115,076.44	3.36
	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	6,098,350.80	2.88
8	其他各项资产	380,190.05	0.18
9	合计	211,821,240.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,090,218.50	0.99
B	采矿业	11,055,863.00	5.23
C	制造业	121,875,429.31	57.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,568,005.00	3.11
E	建筑业	2,220,461.60	1.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,114,289.00	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,203,300.25	6.72
J	金融业	22,977,705.00	10.87
K	房地产业	4,194,041.00	1.98
L	租赁和商务服务业	3,264,453.72	1.54
M	科学研究和技术服务业	2,942,002.32	1.39
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	1,626,055.90	0.77
R	文化、体育和娱乐业	472,098.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	196,603,922.60	92.99

7.2.2 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	7,998.00	0.00
B	采矿业	13,027.00	0.01
C	制造业	1,187,170.29	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,924.47	0.03
E	建筑业	25,625.37	0.01
F	批发和零售业	30,346.55	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,291.00	0.01

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,174.51	0.04
J	金融业	104,132.72	0.05
K	房地产业	9,025.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,853.09	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	14,572.43	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,918.06	0.01
R	文化、体育和娱乐业	17,642.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,623,700.49	0.77

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	11,500	19,446,500.00	9.20
2	300750	宁德时代	48,380	11,068,860.20	5.24
3	601318	中国平安	198,425	9,206,920.00	4.35
4	600036	招商银行	226,300	7,413,588.00	3.51
5	000333	美的集团	90,550	5,335,206.00	2.52
6	002594	比亚迪	16,500	4,261,455.00	2.02
7	600900	长江电力	179,100	3,950,946.00	1.87
8	600276	恒瑞医药	81,228	3,890,821.20	1.84
9	601899	紫金矿业	301,200	3,424,644.00	1.62
10	300059	东方财富	230,145	3,268,059.00	1.55
11	601012	隆基绿能	111,324	3,191,659.08	1.51
12	601398	工商银行	640,900	3,089,138.00	1.46
13	600309	万华化学	35,100	3,083,184.00	1.46
14	000651	格力电器	81,900	2,990,169.00	1.41
15	002475	立讯精密	91,888	2,981,765.60	1.41
16	000725	京东方 A	697,500	2,852,775.00	1.35
17	002415	海康威视	84,887	2,810,608.57	1.33

18	300760	迈瑞医疗	9,000	2,698,200.00	1.28
19	000063	中兴通讯	58,000	2,641,320.00	1.25
20	603259	药明康德	37,272	2,322,418.32	1.10
21	002230	科大讯飞	33,600	2,283,456.00	1.08
22	601668	中国建筑	386,840	2,220,461.60	1.05
23	600028	中国石化	348,900	2,219,004.00	1.05
24	300274	阳光电源	18,936	2,208,505.68	1.04
25	300124	汇川技术	33,800	2,170,298.00	1.03
26	002714	牧原股份	49,590	2,090,218.50	0.99
27	002352	顺丰控股	44,700	2,015,523.00	0.95
28	601888	中国中免	18,000	1,989,540.00	0.94
29	002129	TCL 中环	59,750	1,983,700.00	0.94
30	000792	盐湖股份	98,600	1,890,162.00	0.89
31	600031	三一重工	110,500	1,837,615.00	0.87
32	601088	中国神华	59,700	1,835,775.00	0.87
33	688981	中芯国际	35,900	1,813,668.00	0.86
34	600438	通威股份	50,500	1,732,655.00	0.82
35	000002	万 科 A	123,400	1,730,068.00	0.82
36	600048	保利发展	130,300	1,697,809.00	0.80
37	600050	中国联通	352,200	1,690,560.00	0.80
38	600406	国电南瑞	73,008	1,686,484.80	0.80
39	600690	海尔智家	70,200	1,648,296.00	0.78
40	300015	爱尔眼科	87,658	1,626,055.90	0.77
41	688111	金山办公	3,400	1,605,548.00	0.76
42	600089	特变电工	71,800	1,600,422.00	0.76
43	601728	中国电信	281,805	1,586,562.15	0.75
44	600436	片仔癀	5,500	1,574,980.00	0.74
45	601857	中国石油	208,600	1,558,242.00	0.74
46	600941	中国移动	16,700	1,558,110.00	0.74
47	002371	北方华创	4,800	1,524,720.00	0.72
48	603501	韦尔股份	15,155	1,485,796.20	0.70
49	601766	中国中车	223,200	1,450,800.00	0.69
50	600905	三峡能源	259,700	1,394,589.00	0.66
51	300014	亿纬锂能	22,500	1,361,250.00	0.64
52	601225	陕西煤业	72,800	1,324,232.00	0.63
53	000938	紫光股份	41,500	1,321,775.00	0.63
54	002466	天齐锂业	18,900	1,321,299.00	0.62
55	000338	潍柴动力	104,200	1,298,332.00	0.61
56	603986	兆易创新	12,100	1,285,625.00	0.61
57	002027	分众传媒	187,212	1,274,913.72	0.60
58	002460	赣锋锂业	20,680	1,260,652.80	0.60
59	600570	恒生电子	28,050	1,242,334.50	0.59
60	601985	中国核电	173,400	1,222,470.00	0.58

61	002049	紫光国微	12,500	1,165,625.00	0.55
62	000100	TCL 科技	281,350	1,108,519.00	0.52
63	600111	北方稀土	46,100	1,105,478.00	0.52
64	601919	中远海控	116,890	1,098,766.00	0.52
65	600585	海螺水泥	45,300	1,075,422.00	0.51
66	603799	华友钴业	23,210	1,065,571.10	0.50
67	600893	航发动力	24,600	1,039,596.00	0.49
68	002271	东方雨虹	37,000	1,008,620.00	0.48
69	300122	智飞生物	22,500	994,500.00	0.47
70	002555	三七互娱	28,000	976,640.00	0.46
71	002812	恩捷股份	9,800	944,230.00	0.45
72	600019	宝钢股份	163,400	918,308.00	0.43
73	002709	天赐材料	21,200	873,228.00	0.41
74	688599	天合光能	20,000	852,200.00	0.40
75	601600	中国铝业	154,300	847,107.00	0.40
76	600426	华鲁恒升	27,400	839,262.00	0.40
77	000661	长春高新	5,900	804,170.00	0.38
78	002410	广联达	24,520	796,654.80	0.38
79	300142	沃森生物	29,600	782,920.00	0.37
80	002241	歌尔股份	44,100	782,775.00	0.37
81	600745	闻泰科技	15,900	777,510.00	0.37
82	600588	用友网络	37,900	776,950.00	0.37
83	001979	招商蛇口	58,800	766,164.00	0.36
84	600010	包钢股份	419,000	750,010.00	0.35
85	300450	先导智能	20,100	727,017.00	0.34
86	603993	洛阳钼业	130,200	693,966.00	0.33
87	002493	荣盛石化	55,900	650,676.00	0.31
88	600176	中国巨石	44,100	624,456.00	0.30
89	300347	泰格医药	9,600	619,584.00	0.29
90	000301	东方盛虹	48,000	567,360.00	0.27
91	600346	恒力石化	38,700	554,571.00	0.26
92	600989	宝丰能源	40,400	509,444.00	0.24
93	300661	圣邦股份	5,980	491,137.40	0.23
94	300413	芒果超媒	13,800	472,098.00	0.22
95	002648	卫星化学	31,078	464,926.88	0.22
96	603260	合盛硅业	6,600	462,132.00	0.22
97	002601	龙佰集团	26,500	437,250.00	0.21
98	300628	亿联网络	9,380	328,956.60	0.16
99	000708	中信特钢	18,900	299,376.00	0.14

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301486	致尚科技	1,490	85,913.40	0.04

2	301488	豪恩汽电	1,907	75,860.46	0.04
3	301292	海科新源	3,766	75,282.34	0.04
4	688603	天承科技	1,147	63,085.00	0.03
5	301261	恒工精密	1,381	50,958.90	0.02
6	000538	云南白药	800	41,984.00	0.02
7	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
8	688249	晶合集成	1,407	25,410.42	0.01
9	301301	川宁生物	2,623	23,502.08	0.01
10	688063	派能科技	100	19,825.00	0.01
11	600809	山西汾酒	100	18,507.00	0.01
12	300433	蓝思科技	1,500	17,640.00	0.01
13	301293	三博脑科	243	17,355.06	0.01
14	000001	平安银行	1,500	16,845.00	0.01
15	002459	晶澳科技	400	16,680.00	0.01
16	601319	中国人保	2,800	16,352.00	0.01
17	603613	国联股份	435	16,064.55	0.01
18	600606	绿地控股	5,670	15,592.50	0.01
19	301358	湖南裕能	355	15,225.95	0.01
20	688472	阿特斯	870	14,824.80	0.01
21	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
22	688469	中芯集成	2,664	14,412.24	0.01
23	688361	中科飞测	220	14,227.40	0.01
24	688531	日联科技	104	14,140.88	0.01
25	601006	大秦铁路	1,900	14,117.00	0.01
26	301260	格力博	591	13,965.33	0.01
27	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
28	301303	真兰仪表	571	12,744.72	0.01
29	301310	鑫宏业	186	12,169.98	0.01
30	688100	威胜信息	400	11,924.00	0.01
31	688484	南芯科技	316	11,600.36	0.01
32	603688	石英股份	100	11,384.00	0.01
33	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.01
34	301408	华人健康	628	10,644.60	0.01
35	301246	宏源药业	342	10,502.82	0.00
36	688629	华丰科技	548	10,187.32	0.00
37	601958	金钼股份	900	10,035.00	0.00
38	688562	航天软件	447	9,972.57	0.00
39	301399	英特科技	193	9,953.01	0.00
40	600104	上汽集团	700	9,919.00	0.00
41	301307	美利信	307	9,781.02	0.00
42	688582	芯动联科	236	9,600.48	0.00
43	600803	新奥股份	500	9,490.00	0.00
44	301315	威士顿	183	9,354.96	0.00

45	301360	荣旗科技	101	9,352.60	0.00
46	002385	大北农	1,400	9,240.00	0.00
47	301387	光大同创	203	9,208.08	0.00
48	601288	农业银行	2,600	9,178.00	0.00
49	301429	森泰股份	433	9,101.66	0.00
50	600016	民生银行	2,400	9,000.00	0.00
51	688146	中船特气	235	8,960.55	0.00
52	301383	天键股份	250	8,930.00	0.00
53	000776	广发证券	600	8,826.00	0.00
54	002739	万达电影	700	8,778.00	0.00
55	600143	金发科技	1,000	8,730.00	0.00
56	301291	明阳电气	277	8,595.31	0.00
57	688458	美芯晟	94	8,531.44	0.00
58	003816	中国广核	2,700	8,397.00	0.00
59	601211	国泰君安	600	8,394.00	0.00
60	301373	凌玮科技	263	8,376.55	0.00
61	301281	科源制药	332	8,333.20	0.00
62	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
63	301225	恒勃股份	244	8,115.44	0.00
64	688352	颀中科技	669	8,074.83	0.00
65	688593	新相微	551	8,039.09	0.00
66	688543	国科军工	151	8,010.55	0.00
67	600598	北大荒	600	7,998.00	0.00
68	301382	蜂助手	239	7,848.76	0.00
69	301262	海看股份	305	7,777.50	0.00
70	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
71	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
72	688620	安凯微	624	7,700.16	0.00
73	688523	航天环宇	322	7,679.70	0.00
74	301322	绿通科技	143	7,613.32	0.00
75	301386	未来电器	309	7,351.11	0.00
76	601992	金隅集团	3,300	7,194.00	0.00
77	300316	晶盛机电	100	7,090.00	0.00
78	688334	西高院	429	6,954.09	0.00
79	301439	泓淋电力	405	6,844.50	0.00
80	301305	朗坤环境	347	6,832.43	0.00
81	600000	浦发银行	933	6,754.92	0.00
82	301332	德尔玛	491	6,741.43	0.00
83	688581	安杰思	57	6,727.71	0.00
84	301210	金杨股份	136	6,687.12	0.00
85	002841	视源股份	100	6,684.00	0.00
86	301357	北方长龙	137	6,629.43	0.00
87	688433	华曙高科	209	6,583.50	0.00

88	300804	广康生化	197	6,495.09	0.00
89	301428	世纪恒通	212	6,487.20	0.00
90	688570	天玛智控	250	6,332.50	0.00
91	301397	溯联股份	157	6,311.40	0.00
92	600760	中航沈飞	140	6,300.00	0.00
93	301232	飞沃科技	107	6,250.94	0.00
94	301355	南王科技	372	6,231.00	0.00
95	300144	宋城演艺	500	6,200.00	0.00
96	600115	中国东航	1,300	6,188.00	0.00
97	600845	宝信软件	120	6,097.20	0.00
98	688429	时创能源	238	6,076.14	0.00
99	600460	士兰微	200	6,054.00	0.00
100	002050	三花智控	200	6,052.00	0.00
101	300676	华大基因	100	5,999.00	0.00
102	001287	中电港	284	5,969.68	0.00
103	601658	邮储银行	1,200	5,868.00	0.00
104	601061	中信金属	771	5,844.18	0.00
105	301376	致欧科技	259	5,830.09	0.00
106	301170	锡南科技	166	5,798.38	0.00
107	600008	首创环保	2,000	5,760.00	0.00
108	601377	兴业证券	940	5,752.80	0.00
109	301345	涛涛车业	123	5,736.72	0.00
110	301323	新莱福	143	5,628.48	0.00
111	688623	双元科技	64	5,554.56	0.00
112	002945	华林证券	400	5,472.00	0.00
113	301337	亚华电子	171	5,193.27	0.00
114	002541	鸿路钢构	180	5,185.80	0.00
115	600392	盛和资源	400	5,148.00	0.00
116	000807	云铝股份	400	5,092.00	0.00
117	002624	完美世界	300	5,067.00	0.00
118	601138	工业富联	200	5,040.00	0.00
119	688631	莱斯信息	168	5,018.16	0.00
120	601216	君正集团	1,200	4,920.00	0.00
121	000895	双汇发展	200	4,898.00	0.00
122	688479	友车科技	166	4,895.34	0.00
123	601618	中国中冶	1,200	4,764.00	0.00
124	300604	长川科技	100	4,749.00	0.00
125	002517	恺英网络	300	4,722.00	0.00
126	600926	杭州银行	400	4,700.00	0.00
127	300390	天华新能	130	4,654.00	0.00
128	601155	新城控股	300	4,323.00	0.00
129	603135	中重科技	235	4,204.15	0.00
130	002463	沪电股份	200	4,188.00	0.00

131	300136	信维通信	200	4,016.00	0.00
132	000403	派林生物	200	3,992.00	0.00
133	600038	中直股份	100	3,982.00	0.00
134	300677	英科医疗	180	3,960.00	0.00
135	002236	大华股份	200	3,950.00	0.00
136	300012	华测检测	200	3,900.00	0.00
137	002036	联创电子	400	3,884.00	0.00
138	600795	国电电力	1,000	3,830.00	0.00
139	601065	江盐集团	292	3,457.28	0.00
140	600885	宏发股份	100	3,185.00	0.00
141	601000	唐山港	900	3,177.00	0.00
142	300595	欧普康视	100	3,019.00	0.00
143	600188	兖矿能源	100	2,992.00	0.00
144	002146	荣盛发展	1,900	2,926.00	0.00
145	601133	柏诚股份	236	2,893.36	0.00
146	600887	伊利股份	100	2,832.00	0.00
147	600837	海通证券	300	2,766.00	0.00
148	601688	华泰证券	200	2,754.00	0.00
149	600373	中文传媒	200	2,664.00	0.00
150	300244	迪安诊断	100	2,563.00	0.00
151	001282	三联锻造	77	2,543.31	0.00
152	001328	登康口腔	96	2,447.04	0.00
153	600299	安迪苏	300	2,391.00	0.00
154	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
155	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
156	002001	新和成	144	2,217.60	0.00
157	001360	南矿集团	141	2,096.67	0.00
158	600655	豫园股份	300	2,058.00	0.00
159	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
160	603077	和邦生物	800	1,944.00	0.00
161	603125	常青科技	78	1,913.34	0.00
162	001367	海森药业	48	1,895.04	0.00
163	000519	中兵红箭	100	1,809.00	0.00
164	600029	南方航空	300	1,809.00	0.00
165	600873	梅花生物	200	1,786.00	0.00
166	000656	金科股份	1,600	1,776.00	0.00
167	600884	杉杉股份	100	1,514.00	0.00
168	600919	江苏银行	200	1,470.00	0.00
169	600959	江苏有线	200	676.00	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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	688111	金山办公	1,634,111.00	0.61
2	001979	招商蛇口	1,061,956.00	0.39
3	601012	隆基绿能	914,878.00	0.34
4	600028	中国石化	867,292.00	0.32
5	300750	宁德时代	848,169.00	0.32
6	688599	天合光能	746,040.00	0.28
7	600519	贵州茅台	685,498.00	0.25
8	600941	中国移动	679,762.00	0.25
9	603259	药明康德	608,704.00	0.23
10	600050	中国联通	579,202.00	0.22
11	600905	三峡能源	563,989.00	0.21
12	601899	紫金矿业	542,547.00	0.20
13	000333	美的集团	482,790.00	0.18
14	300760	迈瑞医疗	480,933.00	0.18
15	601857	中国石油	452,090.00	0.17
16	002812	恩捷股份	451,287.00	0.17
17	603501	韦尔股份	425,632.00	0.16
18	002475	立讯精密	411,871.00	0.15
19	600438	通威股份	401,966.00	0.15
20	002466	天齐锂业	401,507.00	0.15

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	600519	贵州茅台	6,797,595.00	2.53
2	300750	宁德时代	3,906,891.00	1.45
3	601318	中国平安	3,142,144.00	1.17
4	600036	招商银行	2,720,005.00	1.01
5	601012	隆基绿能	2,344,014.00	0.87
6	600900	长江电力	1,938,802.00	0.72
7	000333	美的集团	1,875,124.50	0.70
8	603259	药明康德	1,572,684.38	0.58
9	002594	比亚迪	1,517,464.00	0.56
10	300059	东方财富	1,462,645.00	0.54
11	300760	迈瑞医疗	1,219,349.00	0.45
12	600276	恒瑞医药	1,204,951.00	0.45
13	600050	中国联通	1,186,131.00	0.44
14	600309	万华化学	1,184,233.00	0.44
15	601888	中国中免	1,166,176.00	0.43

16	000651	格力电器	1,162,691.00	0.43
17	002475	立讯精密	1,162,507.00	0.43
18	002415	海康威视	1,145,736.00	0.43
19	601899	紫金矿业	1,064,945.00	0.40
20	000725	京东方 A	1,049,218.00	0.39

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	38,788,703.20
卖出股票收入（成交）总额	95,773,563.11

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	7,115,076.44	3.37
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	7,115,076.44	3.37

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	019688	22 国债 23	40,000	4,044,770.41	1.91
2	019638	20 国债 09	30,000	3,070,306.03	1.45

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 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 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	23,938.31
2	应收清算款	269,880.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	86,371.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	380,190.05

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	301486	致尚科技	85,913.40	0.04	新股流通受限
2	301488	豪恩汽电	75,860.46	0.04	新股流通受限
3	301292	海科新源	75,282.34	0.04	新股流通受限
4	688603	天承科技	63,085.00	0.03	新股流通受限
5	301261	恒工精密	50,958.90	0.02	新股流通受限

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	11,761	10,737.34	47,896,555.42	37.93	78,385,254.45	62.07
宝盈中证 100 指数增强 C	2,233	2,189.57	1,056,980.94	21.62	3,832,329.62	78.38
合计	13,994	9,373.38	48,953,536.36	37.32	82,217,584.07	62.68

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	20,083.16	0.0159
	宝盈中证 100 指数增强 C	2,471.05	0.0505
	合计	22,554.21	0.0172

注：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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	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	162,839,079.21	4,716,668.84
本报告期基金总申购份额	8,002,715.49	2,237,592.94
减：本报告期基金总赎回份额	44,559,984.83	2,064,951.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,281,809.87	4,889,310.56

§ 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，本基金管理人重大人事变动情况如下：

宝盈基金管理有限公司股东中铁信托有限责任公司、中国对外经济贸易信托有限公司以股东直接作出决定的方式通过宝盈基金管理有限公司独立董事变更事项，同意王汀汀辞去宝盈基金管理有限公司独立董事职务，何茵担任宝盈基金管理有限公司独立董事职务。

2、报告期内，本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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金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	2	72,181,185.37	56.99	66,498.23	56.99	-
华泰证券	1	54,477,115.55	43.01	50,190.40	43.01	-

注：1、本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：

- (1) 经营行为规范，财务状况良好，内控制度健全，在业内有良好的信誉。
- (2) 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

需要。

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的信息服务；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(4) 本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，并与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、本基金本报告期交易单元变更情况：

(1) 本报告期内未新租交易单元。

(2) 本报告期内未退租交易单元。

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	3,989,080.00	100.00	12,860,000.00	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宝盈中证100指数增强型证券投资基金修改基金合同的公告	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	2023-06-21
2	宝盈中证100指数增强型证券投资基金(宝盈中证100指数增强A份额)基金产品资料概要(更新)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
3	宝盈中证100指数增强型证券投资基金(宝盈中证100指数增强C份额)基金产品资料概要(更新)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
4	宝盈中证100指数增强型证券投资基金更新招募说明书	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
5	宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
6	宝盈中证100指数增强型证券投资基	本基金管理人网站, 中	2023-04-21

	金 2023 年第 1 季度报告	国证监会基金电子披露网站	
7	宝盈基金管理有限公司旗下 59 只基金 2023 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	2023-04-21
8	宝盈基金管理有限公司关于新增中欧财富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	2023-04-21
9	宝盈基金管理有限公司关于增加海通证券股份有限公司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	2023-04-13
10	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2022 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	2023-03-30
11	宝盈基金管理有限公司旗下 56 只基金 2022 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	2023-03-30
12	宝盈基金管理有限公司关于增加新华信通为旗下部分基金代销机构的公告	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	2023-03-14
13	宝盈基金管理有限公司关于新增华夏财富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	2023-03-03
14	宝盈基金管理有限公司关于增加济安财富(北京)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	2023-02-28
15	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司销售旗下部分基金的公告	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	2023-02-20
16	关于增加民商基金销售(上海)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	2023-02-16
17	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基	本基金管理人网站, 中	2023-01-20

	金 2022 年第 4 季度报告	国证监会基金电子披露网站	
18	宝盈基金管理有限公司旗下 57 只基金 2022 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	2023-01-20

§ 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

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。

《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

2023 年 8 月 30 日