

# 宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈中证 100 指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 8 日
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	69,225,644.96 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在基金合同规定的范围内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 100 指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构

	建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术，适当参与金融衍生产品的投资。
业绩比较基准	中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-2,895,622.08
本期利润	-8,192,351.95
加权平均基金份额本期利润	-0.1156
本期基金份额净值增长率	-10.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0078
期末基金资产净值	69,766,441.38
期末基金份额净值	1.008

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

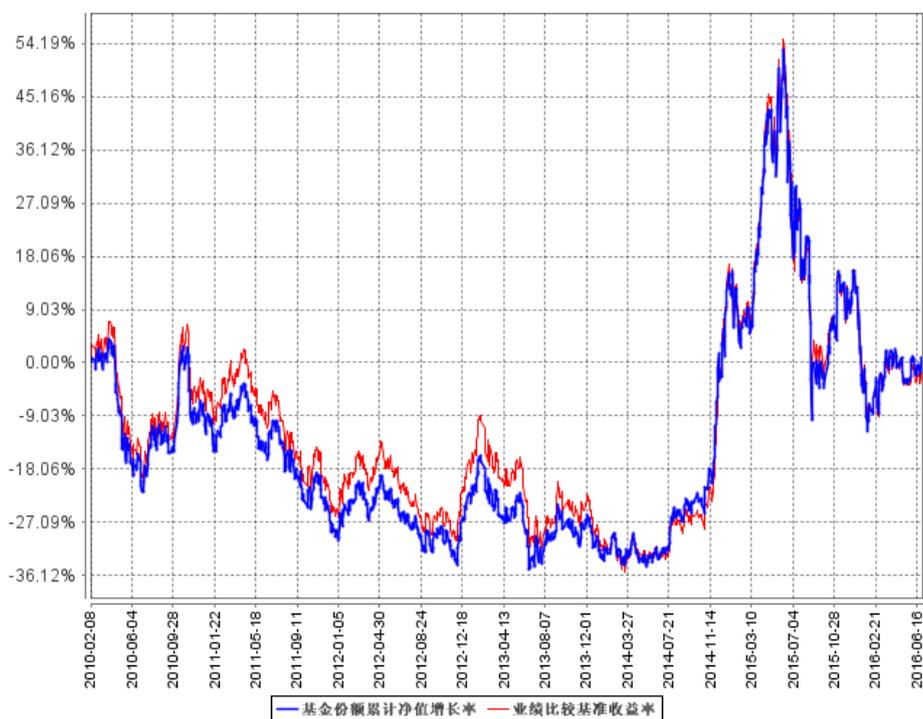
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.30%	0.88%	-0.82%	0.78%	1.12%	0.10%
过去三个月	0.00%	0.90%	-1.50%	0.80%	1.50%	0.10%
过去六个月	-10.08%	1.67%	-11.98%	1.54%	1.90%	0.13%
过去一年	-22.76%	2.08%	-25.31%	2.06%	2.55%	0.02%
过去三年	51.58%	1.72%	40.26%	1.74%	11.32%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.80%	1.51%	-1.54%	1.53%	2.34%	-0.02%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、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、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合、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二十二只基金，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		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015 年 7 月 10 日	-	11 年	盖俊龙先生，经济学硕士。2005 年 8 月至 2011 年 5 月，在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011 年 6 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
郭骁	本基金基金经理	2015 年 8 月 27 日	-	4 年	郭骁先生，经济学硕士。2012 年 7 月起加入宝盈基金管理有限公司任金融工程部研究员，负责数量化选股、衍生品投资等量化策略研究。中国国籍，证券投资基金

					从业人员资格。
--	--	--	--	--	---------

注：1、本基金基金经理均非首任基金经理，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 2016 年 6 月 30 日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2016 年上半年，在稳增长政策的推动下，国内经济逐渐企稳。上半年 GDP 同比增速保持在 6.7%，CPI 同比增速保持在 2%左右。其中，房地产投资与基础建设投资增速出现改善，对经济稳定有较大的支撑作用。回顾资本市场，2016 年伊始，在美元加息预期和全球经济疲弱的背景下，国内外股票价格指数、大宗商品、汇率等的价格均出现了大幅波动。同时，年初 A 股经历了两次向下熔断，1 月份出现了较大幅度的下跌。随后的几个月中，在经济基本面数据和各项稳增长政策的支持下，市场情绪逐渐企稳，市场指数整体窄幅震荡、波动率降低，主题性、结构化的行情逐渐展开，新能源汽车、电子等多个板块表现较好。

报告期内，本基金以比较基准作为参考，股票仓位整体维持在较高位水平。结构上而言，以复制中证 100 指数权重为主，此外在新兴成长行业中精选个股，在一二级市场上运用套利策略，进行增强投资。本基金 2016 年上半年的净值增长率是-10.08%，与基准相比的超额收益为 1.90%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.008 元。本基金在本报告期内净值增长率是-10.08%，同期业绩比较基准收益率是-11.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，由于受到房地产投资增速的转折回落、民间投资增速急剧下滑的影响，固定资产投资增速预期仍会有较大的回落压力，因此经济仍面临较大的下行压力，预计将在一个较长的时间内处于低位增速的运行阶段。同时，在全球量化宽松、资产收益率持续下行的背景下，货币政策的空间将会受限、作用将会边际递减，预期央行仍将维持稳健的货币政策，不会有大幅的调整。证券市场上，预期市场情绪逐渐企稳，投资者的风险偏好逐渐回升，证券市场将持续维持结构性机会的行情。其中，我们看好两个方向，一类是具有稳定盈利、高股息率的蓝筹类公司，另一类是具有扎实的业绩增长、能够成长为新兴行业领导者的成长性公司。

我们将严格按照基金合同的规定，被动投资为主，控制跟踪误差。适当辅之以增强型投资，精选业绩稳定、具有估值优势的蓝筹股票和具有真正成长性的新兴产业股票，以增强组合业绩。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

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

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型

及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	4,121,500.44	3,008,237.88
结算备付金	12,043.70	57,709.28
存出保证金	23,174.68	193,441.30
交易性金融资产	63,194,129.15	78,543,442.13
其中：股票投资	63,194,129.15	73,534,442.13
基金投资	-	-
债券投资	-	5,009,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	10,000,000.00
应收证券清算款	4,040,960.56	1,429,038.50
应收利息	862.49	58,878.31
应收股利	-	-
应收申购款	5,246.48	15,681.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	71,397,917.50	93,306,428.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	915,775.72	2,778,654.86
应付赎回款	321,566.89	10,428,502.80
应付管理人报酬	42,773.11	57,626.51
应付托管费	8,554.61	11,525.31
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	58,527.11	65,880.74
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	284,278.68	193,859.84
负债合计	1,631,476.12	13,536,050.06
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	69,225,644.96	71,169,736.92
未分配利润	540,796.42	8,600,642.01
所有者权益合计	69,766,441.38	79,770,378.93
负债和所有者权益总计	71,397,917.50	93,306,428.99

注：本报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.008 元，基金份额总额 69,225,644.96 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-7,561,605.13	45,435,344.69
1. 利息收入	25,060.85	405,158.15
其中：存款利息收入	21,203.82	86,924.71
债券利息收入	1,643.83	318,233.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,213.20	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,315,547.60	59,186,492.13
其中：股票投资收益	-2,895,559.39	56,402,443.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,500.00	115,961.48
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	577,511.79	2,668,086.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,296,729.87	-15,530,625.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	25,611.49	1,374,319.61
<b>减：二、费用</b>	630,746.82	3,521,491.77
1. 管理人报酬	259,167.68	1,484,146.59
2. 托管费	51,833.53	296,829.32
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	135,412.62	1,506,896.03

5. 利息支出	-	40,622.14
其中：卖出回购金融资产支出	-	40,622.14
6. 其他费用	184,332.99	192,997.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-8,192,351.95</b>	<b>41,913,852.92</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-8,192,351.95</b>	<b>41,913,852.92</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	71,169,736.92	8,600,642.01	79,770,378.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,192,351.95	-8,192,351.95
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）	-1,944,091.96	132,506.36	-1,811,585.60
其中：1. 基金申购款	20,226,129.12	-228,717.19	19,997,411.93
2. 基金赎回款	-22,170,221.08	361,223.55	-21,808,997.53
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）	69,225,644.96	540,796.42	69,766,441.38
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	320,639,832.08	39,272,586.88	359,912,418.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,913,852.92	41,913,852.92

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-51,652,042.46	824,631.58	-50,827,410.88
其中：1. 基金申购款	865,174,360.01	205,389,338.63	1,070,563,698.64
2. 基金赎回款	-916,826,402.47	-204,564,707.05	-1,121,391,109.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	268,987,789.62	82,011,071.38	350,998,861.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1218 号《关于核准宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 281,223,192.88 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 029 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2010 年 2 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 281,241,387.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,194.77 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

100 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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 本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	259,167.68	1,484,146.59
其中：支付销售机构的客户维护费	82,500.85	264,199.55

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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,833.53	296,829.32

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的费率计提，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

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间市场交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2010 年 2 月 8 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	6,870,659.08
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	6,870,659.08
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

#### 6.4.8.5 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

**6.4.8.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	4,121,500.44	20,072.01	25,004,157.78	74,522.43

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

**6.4.8.8 其他关联交易事项的说明**

本基金无其他关联交易事项的说明。

**6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	100,200	1,374,930.97	1,823,640.00	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项停牌	19.22	-	-	51,300	1,197,138.96	985,986.00	-
600019	宝钢股份	2016 年 6 月 27 日	重大资产重组	4.90	-	-	52,200	367,919.05	255,780.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	63,194,129.15	88.51
	其中：股票	63,194,129.15	88.51
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,133,544.14	5.79
7	其他各项资产	4,070,244.21	5.70
8	合计	71,397,917.50	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,816,914.00	2.60
C	制造业	14,435,717.38	20.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,357,086.00	3.38
E	建筑业	2,246,318.00	3.22
F	批发和零售业	537,570.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	1,202,268.00	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,932,647.64	2.77
J	金融业	29,525,617.73	42.32
K	房地产业	3,138,011.00	4.50
L	租赁和商务服务业	105,664.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	244,480.00	0.35
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	399,500.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	57,941,793.75	83.05

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,252,335.40	7.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,252,335.40	7.53

### 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前十名股票投资明细

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	115,190	3,690,687.60	5.29
2	600016	民生银行	291,200	2,600,416.00	3.73
3	601166	兴业银行	140,600	2,142,744.00	3.07
4	600036	招商银行	109,900	1,923,250.00	2.76
5	000002	万科A	100,200	1,823,640.00	2.61
6	601328	交通银行	289,500	1,629,885.00	2.34
7	600000	浦发银行	104,060	1,620,214.20	2.32
8	600519	贵州茅台	5,320	1,553,014.40	2.23

9	600030	中信证券	83,700	1,358,451.00	1.95
10	601398	工商银行	303,800	1,348,872.00	1.93

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司<http://www.byfunds.com>网站的半年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

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	002350	北京科锐	149,977	3,029,535.40	4.34
2	300403	地尔汉宇	40,000	2,222,800.00	3.19

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司<http://www.byfunds.com>网站的半年度报告正文。

## 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	002546	新联电子	6,280,260.00	7.87
2	600579	天华院	6,065,846.00	7.60
3	300403	地尔汉宇	4,986,311.40	6.25
4	300342	天银机电	4,756,216.00	5.96
5	002350	北京科锐	4,750,975.00	5.96
6	002341	新纶科技	1,333,358.00	1.67
7	300458	全志科技	1,264,588.00	1.59
8	601318	中国平安	787,875.00	0.99
9	600016	民生银行	608,437.00	0.76
10	300104	乐视网	534,723.45	0.67
11	601166	兴业银行	533,969.00	0.67
12	601328	交通银行	516,969.00	0.65
13	601377	兴业证券	423,739.61	0.53
14	600000	浦发银行	410,612.00	0.51
15	600036	招商银行	374,048.00	0.47
16	001979	招商蛇口	352,699.00	0.44
17	002673	西部证券	347,733.00	0.44

18	600958	东方证券	320,625.00	0.40
19	600900	长江电力	320,040.00	0.40
20	600030	中信证券	307,630.00	0.39

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	002546	新联电子	6,929,447.11	8.69
2	600579	天华院	5,964,441.00	7.48
3	300342	天银机电	4,169,871.40	5.23
4	300403	地尔汉宇	2,773,511.00	3.48
5	002350	北京科锐	2,005,000.00	2.51
6	300458	全志科技	1,862,350.20	2.33
7	601318	中国平安	1,344,223.11	1.69
8	600016	民生银行	1,237,164.00	1.55
9	002341	新纶科技	1,183,000.00	1.48
10	601166	兴业银行	896,760.00	1.12
11	600000	浦发银行	740,856.01	0.93
12	600036	招商银行	654,315.00	0.82
13	601398	工商银行	541,446.00	0.68
14	600030	中信证券	523,566.00	0.66
15	601328	交通银行	518,979.00	0.65
16	601288	农业银行	466,640.00	0.58
17	600837	海通证券	453,880.00	0.57
18	600519	贵州茅台	424,771.00	0.53
19	601186	中国铁建	398,150.00	0.50
20	601169	北京银行	394,079.00	0.49

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	43,613,029.37
卖出股票收入（成交）总额	45,896,705.29

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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资产支持证券。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,174.68
2	应收证券清算款	4,040,960.56
3	应收股利	-
4	应收利息	862.49
5	应收申购款	5,246.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,070,244.21

### 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

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	000002	万科A	1,823,640.00	2.61	重大资产重组

#### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,028	13,768.03	-	-	69,225,644.96	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	71,901.76	0.1039%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 2 月 8 日) 基金份额总额	281,241,387.65
本报告期期初基金份额总额	71,169,736.92
本报告期基金总申购份额	20,226,129.12
减:本报告期基金总赎回份额	22,170,221.08
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	69,225,644.96

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2016 年 4 月 27 日经宝盈基金管理有限公司第四届第二十一次董事会临时会议通讯表决，同意储诚忠辞去宝盈基金管理有限公司副总经理职务。

2、报告期内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收到中国证券监督管理委员会《关于对宝盈基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停办理公募基金产品注册申请 3 个月，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，针对性的制定、实施整改措施，并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

除上述情况外，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	
华泰证券	1	48,467,436.64	54.15%	44,168.30	54.15%	-
长江证券	1	41,042,298.02	45.85%	37,402.06	45.85%	-

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

要，并能为本基金提供全面的信息服务。

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

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

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

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

#### 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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	5,010,000.00	100.00%	4,000,000.00	100.00%	-	-

宝盈基金管理有限公司  
2016年8月25日