

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 宝盈中证 100 指数增强 |
| 基金主代码 | 213010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 2 月 8 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 112,447,511.35 份 |
| 投资目标 | 在基金合同规定的范围内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不得超过 7.75%、基金总体投资业绩超越中证 100 指数的表现。 |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术，适当参与金融衍生产品的投资。 |
| 业绩比较基准 | 中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。 |

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 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 | 98,181,663.39 份 | 14,265,847.96 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 宝盈中证 100 指数增强 A | 宝盈中证 100 指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益 | 11,163,551.25 | 893,348.11 |
| 2. 本期利润 | -11,614,970.26 | -701,679.93 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1187 | -0.0808 |
| 4. 期末基金资产净值 | 229,541,415.34 | 32,780,545.76 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.338 | 2.298 |

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

宝盈中证 100 指数增强 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|---------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -4.84% | 1.23% | -8.67% | 1.26% | 3.83% | -0.03% |
| 过去六个月 | -1.68% | 1.11% | -8.87% | 1.13% | 7.19% | -0.02% |
| 过去一年 | 12.40% | 1.19% | 2.16% | 1.20% | 10.24% | -0.01% |
| 过去三年 | 74.61% | 1.28% | 28.70% | 1.29% | 45.91% | -0.01% |
| 过去五年 | 124.59% | 1.14% | 52.85% | 1.15% | 71.74% | -0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 133.80% | 1.35% | 54.52% | 1.36% | 79.28% | -0.01% |

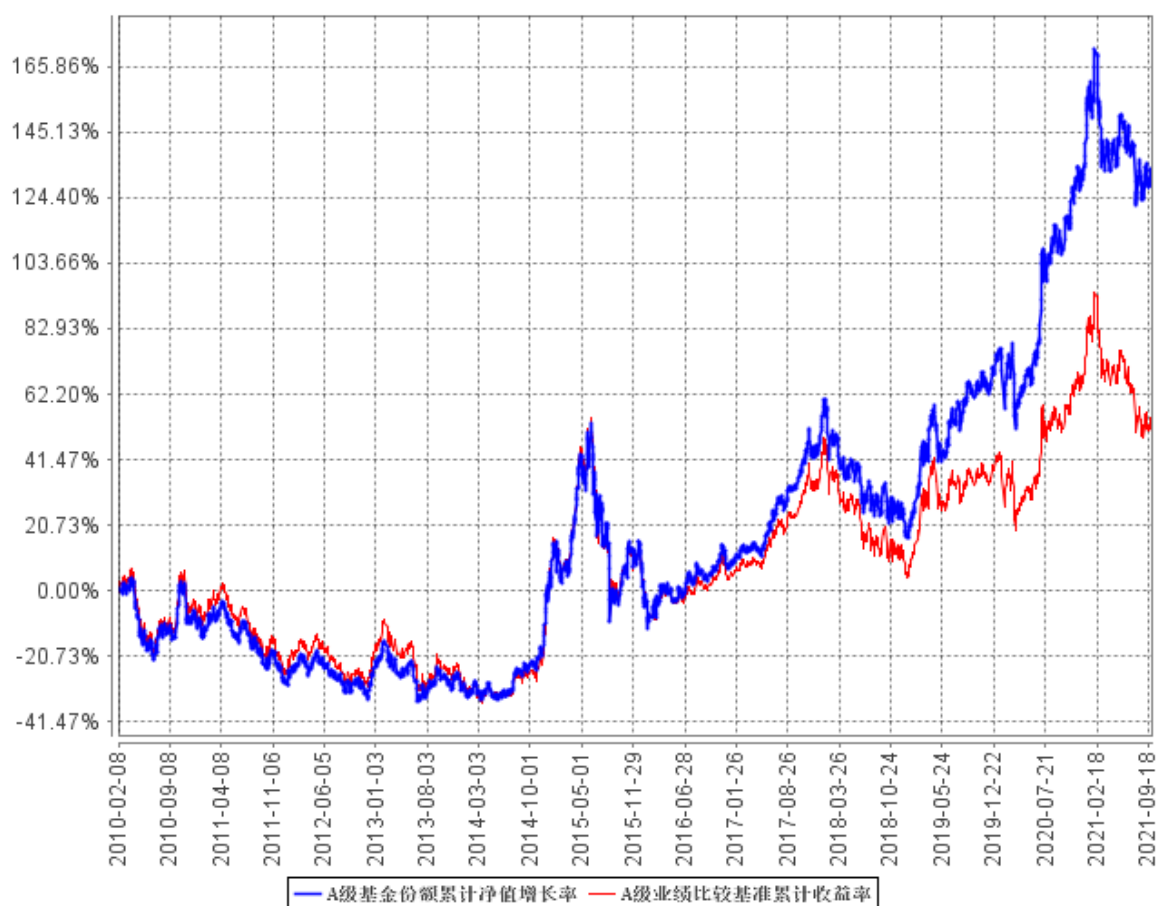
宝盈中证 100 指数增强 C

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基准收 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|-------|-------|---------|-----|-----|
|----|------|-------|-------|---------|-----|-----|

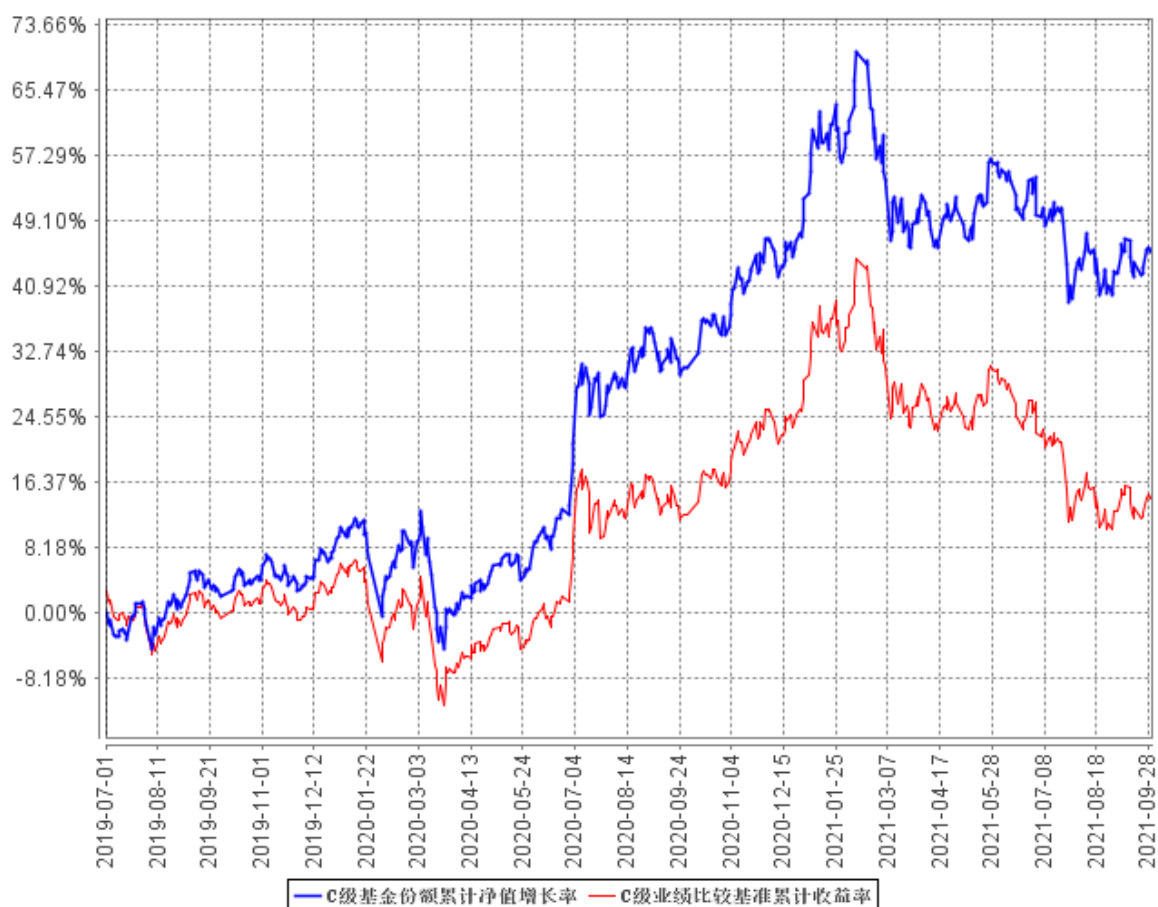
| | 率① | 标准差② | 准收益率③ | 益率标准差④ | | |
|------------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.04% | 1.23% | -8.67% | 1.26% | 3.63% | -0.03% |
| 过去六个月 | -2.09% | 1.11% | -8.87% | 1.13% | 6.78% | -0.02% |
| 过去一年 | 11.50% | 1.19% | 2.16% | 1.20% | 9.34% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.81% | 1.19% | 14.74% | 1.21% | 31.07% | -0.02% |

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

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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---|----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 蔡丹 | 本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金基金经理 | 2017 年 8 月 5 日 | - | 11 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。 |
|--|--|--|--|--|---------------|

4.1.1 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度国内经济增速下行压力加大，上下游分化、消费偏弱的特征较为明显。在 7 月份经济数据走弱后，8 月份经济数据进一步确认了经济下行压力，近期公布的 9 月制造业 PMI 回落至收缩区间内。从细分项目来看，在疫情、汛情的影响下，消费数据都较为疲弱，此外，上游大宗商品价格上涨和“能耗双控”政策也对经济也造成了较大负面影响。从海外来看，美国 QE 退出节奏已基本明朗化，当前美国债务上限问题仍悬而未决，如年底美国通胀超预期，全球股市将同时面临美国流动性政策收紧及上游原材料涨价的双重冲击。从 A 股走势来看，本季度以震荡为主，上证综指在 7 月份经历了一波下跌后开启一波明显的反弹，于 9 月 14 日创出本轮反弹新高 3723.85 点，之后震荡回落。从北向资金来看，本季度北上资金流动情况与 A 股走势较为一致，在 8 月下旬之前市场涨跌大都对应着流入流出，8 月下旬之后以净流入为主。2017Q1 以来北上累计净流入达到 1.35 万亿元，单季度平均净流入在 708.67 亿元左右，本季度净流入 681.9 亿，相比上季度

的 1237.67 亿元有明显的回落。

从市场走势来看，本季度指数之间分化也较大，周期板块较为强势，大消费板块较为低迷。主要指数表现如下：中证 1000 上涨 4.54%，中证 500 上涨 4.34%，上证综指下跌 0.64%，中证 800 下跌 4.36%，创业板 50 下跌 6.54%，创业板指下跌 6.69%，沪深 300 下跌 6.85%，上证 50 下跌 8.62%，深证 100 下跌 8.74%，中证 100 下跌 9.13%。分行业来看，也是涨少跌多，申万 28 个一级行业中有 9 个行业上涨，涨幅前五的行业分别为：采掘（上涨 36.6%）、公用事业（上涨 25.2%）、有色金属（上涨 23.11%）、钢铁（上涨 19.72%）和化工（上涨 13.7%）；跌幅前五的行业：医药生物（下跌 13.68%）、休闲服务（下跌 13.07%）、食品饮料（下跌 13%）、传媒（下跌 10.88%）和家电（下跌 10.14%）。

从大小盘风格来看，从 2 月 10 日到 9 月中旬，中证 1000 相对中证 100 持续走强，9 月下旬相对走弱；从价值成长风格来看，今年 3 月份到 7 月份成长风格相对价值风格震荡走强，但 8 月份到 9 月上旬成长风格相对价值风格快速走弱，整个季度来看，成长和价值风格没有明显的强弱差异。

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。2021 年三季度，本基金 A 份额单位净值下跌 4.84%，相对基准超额收益为 3.83%，年化跟踪误差为 1.30%；本基金 C 份额本季度单位净值下跌 5.04%，相对基准超额收益 3.63%。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。

4.5 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 2.338 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.84%；截至本报告期末宝盈中证 100 指数增强 C 基金份额净值为 2.298 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.04%；同期业绩比较基准收益率为-8.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 244,413,834.50 | 92.76 |
| | 其中：股票 | 244,413,834.50 | 92.76 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 9,008,100.00 | 3.42 |
| | 其中：债券 | 9,008,100.00 | 3.42 |
| | 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 | 9,312,947.64 | 3.53 |
| 8 | 其他资产 | 753,882.12 | 0.29 |
| 9 | 合计 | 263,488,764.26 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,649,555.20 | 1.39 |
| B | 采矿业 | 6,193,431.00 | 2.36 |
| C | 制造业 | 115,655,519.11 | 44.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,349,401.00 | 2.04 |
| E | 建筑业 | 2,488,302.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,571,505.00 | 2.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,638,746.00 | 2.15 |
| J | 金融业 | 72,755,833.54 | 27.74 |
| K | 房地产业 | 5,249,298.00 | 2.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,206,419.84 | 2.37 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,763,081.60 | 1.82 |
| 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 | 344,712.00 | 0.13 |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,753,517.60 | 1.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 236,619,321.89 | 90.20 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 18,116.82 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 48,612.00 | 0.02 |
| C | 制造业 | 5,331,395.57 | 2.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 141,519.00 | 0.05 |
| E | 建筑业 | 84,825.00 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 143,402.78 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 310,108.20 | 0.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 954,790.12 | 0.36 |
| J | 金融业 | 234,803.00 | 0.09 |
| K | 房地产业 | 338,512.00 | 0.13 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 40,945.84 | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 77,273.94 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 30,202.00 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 36,661.22 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 7,794,512.61 | 2.97 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 11,600 | 21,228,000.00 | 8.09 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 239,300 | 12,072,685.00 | 4.60 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 200,825 | 9,711,897.00 | 3.70 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 36,366 | 7,978,336.74 | 3.04 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 79,060 | 6,520,868.80 | 2.49 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 92,050 | 6,406,680.00 | 2.44 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 163,557 | 5,621,454.09 | 2.14 |
| 8 | 601888 | 中国中免 | 18,800 | 4,888,000.00 | 1.86 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 260,300 | 4,763,490.00 | 1.82 |
| 10 | 603259 | 药明康德 | 31,172 | 4,763,081.60 | 1.82 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值 |
|----|------|------|-------|---------|---------|
|----|------|------|-------|---------|---------|

| | | | | | 比例 (%) |
|---|--------|------|---------|------------|--------|
| 1 | 601728 | 中国电信 | 197,005 | 778,169.75 | 0.30 |
| 2 | 603486 | 科沃斯 | 2,600 | 394,940.00 | 0.15 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 600 | 315,438.00 | 0.12 |
| 4 | 601919 | 中远海控 | 17,090 | 295,315.20 | 0.11 |
| 5 | 688538 | 和辉光电 | 84,485 | 258,524.10 | 0.10 |

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|--------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 9,008,100.00 | 3.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 (可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 9,008,100.00 | 3.43 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|---------------|
| 1 | 019645 | 20 国债 15 | 50,000 | 5,004,500.00 | 1.91 |
| 2 | 019654 | 21 国债 06 | 40,000 | 4,003,600.00 | 1.53 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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兴业银行、招商银行的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2021 年 1 月 15 日，中国银行间市场交易商协会自律处分信息认定兴业银行股份有限公司作为债务融资工具主承销商，在为永城煤电控股集团有限公司提供中介服务过程中，存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现，未能充分保证尽职调查质量；二是未对永煤控股受限货币资金异常情况保持足够的职业怀疑，未开展进一步核查；三是永煤控股 DFI 项目尽职调查工作底稿不完整，尽职调查工作开展不规范。根据银行间债券市场相关自律规定，经 2020 年第 18 次自律处分会议审议，对兴业银行予以通报批评，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。同时，中国银行间市场交易商协会已将兴业银行有关违规情况报送中国人民银行、中国银保监会。

2021 年 8 月 20 日，银保监罚决字〔2021〕26 号显示，兴业银行违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被罚款 5 万元。

2021 年 5 月，根据银监罚决字〔2018〕1 号的决定，中国银监会认定招商银行股份有限公司存在（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；

(三) 同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保; (四) 销售同业非保本理财产品时违规承诺保本; (五) 违规将票据贴现资金直接转回出票人账户; (六) 为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保; (七) 未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目; (八) 高管人员在获得任职资格核准前履职; (九) 未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务; (十) 未严格审查贸易背景真实性开立信用证; (十一) 违规签订保本合同销售同业非保本理财产品; (十二) 非真实转让信贷资产; (十三) 违规向典当行发放贷款; (十四) 违规向关系人发放信用贷款的违法违规事实。中国银监会决定对招商银行股份有限公司作出罚款 6570 万元, 没收违法所得 3.024 万元的行政处罚, 罚没合计 6573.024 万元。

我们认为相关处罚措施对兴业银行、招商银行的正常经营会产生一定影响, 但影响可控。本基金投资兴业银行、招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 (元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 34,091.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | 38,905.48 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 168,107.76 |
| 5 | 应收申购款 | 512,777.59 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 753,882.12 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 601728 | 中国电信 | 778,169.75 | 0.30 | 新股锁定 |
| 2 | 688538 | 和辉光电 | 258,524.10 | 0.10 | 新股锁定 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 宝盈中证 100 指数增强 A | 宝盈中证 100 指数增强 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 98,576,461.39 | 7,932,459.05 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,395,759.32 | 7,784,782.31 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 10,790,557.32 | 1,451,393.40 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 98,181,663.39 | 14,265,847.96 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 2,957,206.52 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 2,957,206.52 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 2.63 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金设立的文件。

《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》。

《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金托管协议》。

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。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

9.3 查阅方式

上述备查文件文本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

2021 年 10 月 27 日