

宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 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 2022 年 1 月 21 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 宝盈中证 100 指数增强 |
| 基金主代码 | 213010 |
| 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 | 107,106,527.41 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 | 100,691,376.78 份 | 6,415,150.63 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 10 月 1 日 — 2021 年 12 月 31 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 | 6,227,550.16 | 513,620.62 |
| 2. 本期利润 | 4,576,269.03 | 398,664.13 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0461 | 0.0411 |
| 4. 期末基金资产净值 | 240,066,869.09 | 15,000,855.02 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.384 | 2.338 |

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

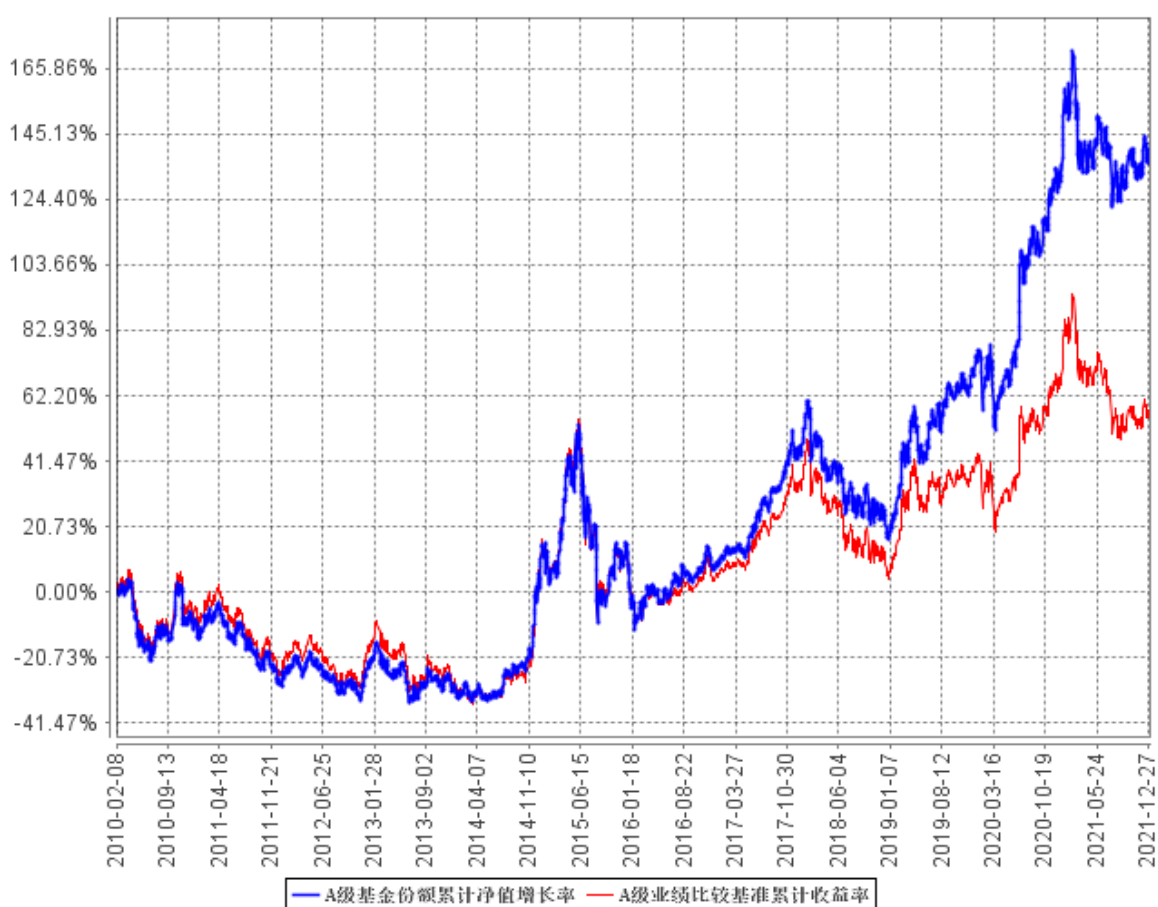
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.97% | 0.82% | 1.28% | 0.83% | 0.69% | -0.01% |
| 过去六个月 | -2.97% | 1.05% | -7.50% | 1.07% | 4.53% | -0.02% |
| 过去一年 | -1.45% | 1.16% | -9.95% | 1.18% | 8.50% | -0.02% |
| 过去三年 | 101.69% | 1.22% | 47.91% | 1.23% | 53.78% | -0.01% |
| 过去五年 | 121.15% | 1.15% | 50.48% | 1.15% | 70.67% | 0.00% |
| 自基金合同生 效起至今 | 138.40% | 1.34% | 56.50% | 1.36% | 81.90% | -0.02% |

宝盈中证 100 指数增强 C

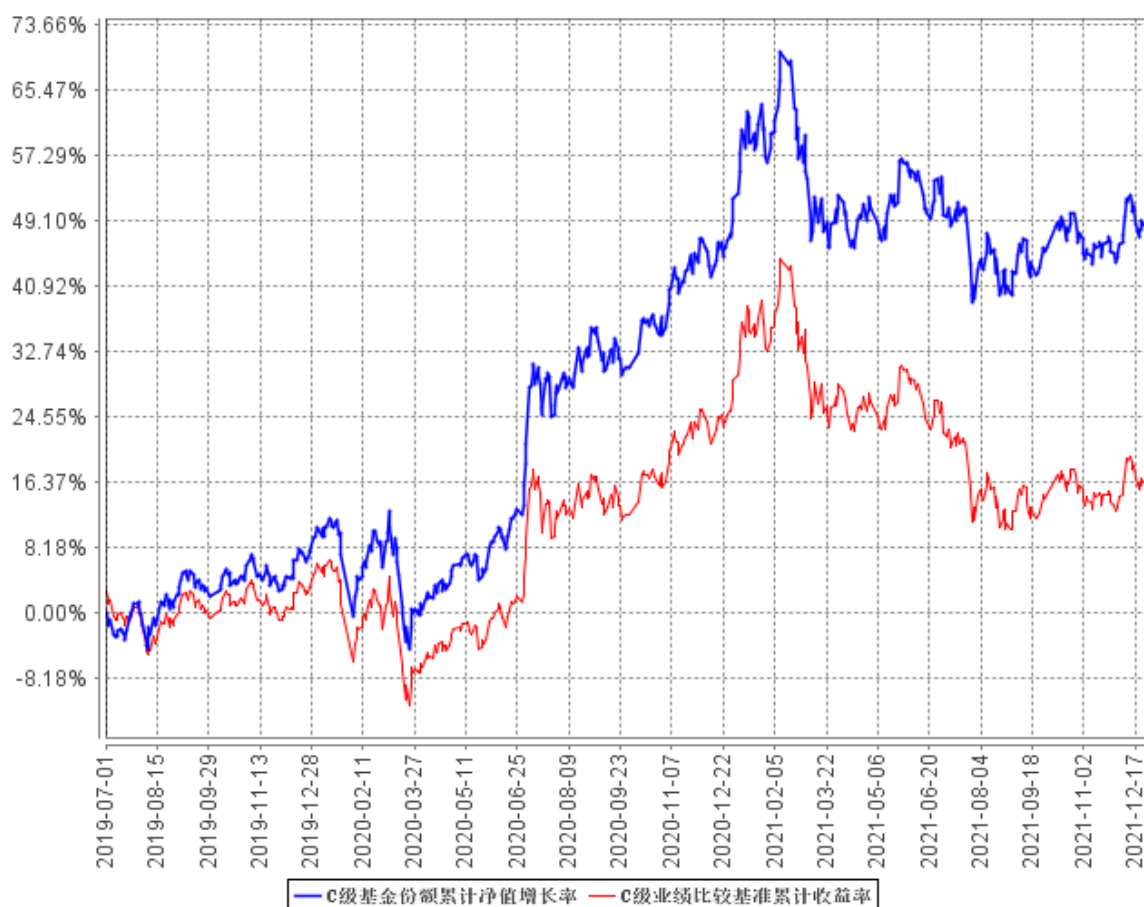
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.74% | 0.81% | 1.28% | 0.83% | 0.46% | -0.02% |
| 过去六个月 | -3.39% | 1.05% | -7.50% | 1.07% | 4.11% | -0.02% |
| 过去一年 | -2.26% | 1.16% | -9.95% | 1.18% | 7.69% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 48.35% | 1.16% | 16.20% | 1.17% | 32.15% | -0.01% |

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，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。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------|

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合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年上市公司业绩表现较好，但下半年随着经济增长动能放缓，盈利压力显现。9月底披露的 PMI 年内首次跌破枯荣线，当月颁布的“能耗双控”细则进一步落实，拉闸限电加剧了经济衰退的预期。10月23日，房地产税试点改革决定落地，央行提及要保持房地产信贷平稳有序投放，地产端的信贷呵护逐步升温，地产股开始了快速反弹。之后，监管定调由单纯的“能耗双控”转为“稳价保供”，市场悲观预期进一步修正，稳增长信号逐步增强。在预期修正后，TMT、军工和新能源车再度领跑。12月政治局会议与中央经济工作会议，均明确提出“稳增长”是首要目标，稳健的货币政策要灵活适度，保持流动性合理充裕，12月中旬降准落地，营造了宽松的货币环境。

今年多个行业监管收紧，互联网、教育、地产经历“去杠杆”，双碳调控也将撬动高耗能产业

的去杠杆，相关行业出现了较大幅度的调整。从板块来看，这个季度板块轮动加速，年内估值调整较大的金融和消费得到一定的修复，元宇宙呈现火热走势，TMT 板块也再度走强。

从 A 股走势来看，本季度以窄幅震荡为主，上证综指本季度初至 11 月上旬出现一波调整之后震荡盘升，本季度收盘上涨 2.01%，区间振幅仅有 7.3%，今年整年上证综指振幅也就 12.06%，刷新历史新低。从成交额来看，今年下半年，A 股成交额中枢趋势上移，日度成交一度突破 1.7 万亿，万亿成交成了新常态。从北向资金来看，本季度三个月北上资金均为净流入，12 月份净流入 889.92 亿，创历史新高；本季度累计净流入 1403.19 亿，位居有数据以来第二高水平；纵观 2021 年全年，北向累计净流入 4321.69 亿，也处于有数据以来最高水平。

从市场走势来看，本季度宽基指数基本都录得上涨，但不同指数之间分化也较大，小盘表现较好，大盘相对较弱。主要指数表现如下：中证 1000 上涨 8.17%，中证 500 上涨 3.6%，上证 50 上涨 2.42%，创业板上涨 2.4%，中证 800 上涨 2.01%，创 50 上涨 1.58%，沪深 300 上涨 1.52%，中证 100 上涨 1.33%。分行业来看是涨多跌少，申万 31 个一级行业中有 21 个行业上涨，涨幅前五的行业分别为：传媒（上涨 20.61%）、国防军工（上涨 16.38%）、通信（上涨 12.74%）、轻工制造（上涨 11.68%）和电子（上涨 11.63%）；跌幅前五的行业：煤炭（下跌 12.6%）、钢铁（下跌 9.41%）、石油石化（下跌 8.98%）、美容护理（下跌 3.29%）和社会服务（下跌 1.90%）。

从大小盘风格来看，今年整体是小盘风格优势特别明显，2 月大跌过后，中证 1000 开始显著跑赢中证 100，小盘风格的超额收益持续走强；从价值成长风格来看，今年 8 月份到 9 月上旬成长风格相对价值风格快速走弱，之后成长风格继续走强，整个季度来看，小盘成长相对占优。

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，同时积极参与与主板、科创板和创业板的网下新股申购。2021 年四季度，本基金 A 份额单位净值上涨 1.97%，相对基准超额收益为 0.69%，年化跟踪误差为 1.06%；本基金 C 份额本季度单位净值上涨 1.74%，相对基准超额收益 0.46%。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 2.384 元，本报告期基金份额净值

增长率为 1.97%；截至本报告期末宝盈中证 100 指数增强 C 基金份额净值为 2.338 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%；同期业绩比较基准收益率为 1.28%。

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 | 240,003,917.50 | 93.72 |
| | 其中：股票 | 240,003,917.50 | 93.72 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 7,008,700.00 | 2.74 |
| | 其中：债券 | 7,008,700.00 | 2.74 |
| | 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 | 8,766,373.35 | 3.42 |
| 8 | 其他资产 | 298,603.68 | 0.12 |
| 9 | 合计 | 256,077,594.53 | 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 | 3,549,464.00 | 1.39 |
| B | 采矿业 | 5,065,531.00 | 1.99 |
| C | 制造业 | 129,827,528.49 | 50.90 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,798,031.00 | 2.27 |
| E | 建筑业 | 1,715,700.00 | 0.67 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,727,745.10 | 2.64 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,304,988.35 | 2.08 |
| J | 金融业 | 62,189,549.46 | 24.38 |
| K | 房地产业 | 3,836,981.00 | 1.50 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 4,752,131.28 | 1.86 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,791,239.76 | 1.49 |
| 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 | 219,294.00 | 0.09 |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,778,465.92 | 0.70 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 234,556,649.36 | 91.96 |

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 | 51,580.00 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 37,094.00 | 0.01 |
| C | 制造业 | 3,483,357.09 | 1.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 58,509.00 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 7,378.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 186,075.29 | 0.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,923.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 288,426.95 | 0.11 |
| J | 金融业 | 166,629.68 | 0.07 |
| K | 房地产业 | 260,554.00 | 0.10 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 759,824.32 | 0.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 37,427.39 | 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 | 38,061.78 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 50,819.64 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,447,268.14 | 2.14 |

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 | 10,300 | 21,115,000.00 | 8.28 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 22,900 | 13,465,200.00 | 5.28 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 198,100 | 9,649,451.00 | 3.78 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 179,325 | 9,039,773.25 | 3.54 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 30,966 | 6,894,889.56 | 2.70 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 82,050 | 6,056,110.50 | 2.37 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7 | 601012 | 隆基股份 | 67,760 | 5,840,912.00 | 2.29 |
| 8 | 300059 | 东方财富 | 136,257 | 5,056,497.27 | 1.98 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 226,700 | 4,316,368.00 | 1.69 |
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 15,100 | 4,048,612.00 | 1.59 |

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 | 688105 | 诺唯赞 | 2,090 | 194,976.10 | 0.08 |
| 2 | 002129 | 中环股份 | 4,300 | 179,525.00 | 0.07 |
| 3 | 300759 | 康龙化成 | 1,200 | 169,524.00 | 0.07 |
| 4 | 600848 | 上海临港 | 11,000 | 163,570.00 | 0.06 |
| 5 | 002841 | 视源股份 | 2,000 | 162,800.00 | 0.06 |

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 | 7,008,700.00 | 2.75 |
| 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 | 7,008,700.00 | 2.75 |

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 | 019654 | 21 国债 06 | 40,000 | 4,001,200.00 | 1.57 |
| 2 | 019641 | 20 国债 11 | 30,000 | 3,007,500.00 | 1.18 |

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 | 13,927.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 97,238.32 |
| 5 | 应收申购款 | 187,437.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 298,603.68 |

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 | 688105 | 诺唯赞 | 194,976.10 | 0.08 | 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 | 98,181,663.39 | 14,265,847.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,060,059.55 | 2,596,306.47 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 7,550,346.16 | 10,447,003.80 |
| 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 | 100,691,376.78 | 6,415,150.63 |

§ 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(%) | 2.76 |

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

2022 年 1 月 24 日