

# 宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告

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

送出日期：2022 年 3 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 2022 年 3 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
8.6 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.....	60
8.7 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.....	60

8.8 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 .....	60
8.9 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 .....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 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 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2 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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</b>
12.1 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 .....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
13.1 备查文件目录 .....	70
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## § 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	107,106,527.41 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	100,691,376.78 份	6,415,150.63 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张磊
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	021-60637111
传真	0755-83515599	021-60635778
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	518034	100033
法定代表人	马永红	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年		2020 年		2019 年	
	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C	宝盈中证 100 指数增强 A	宝盈中证 100 指数增强 C	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	64,475,000.76	3,447,326.10	53,483,761.42	1,801,641.01	31,448,832.20	588,181.77
本期利润	-5,789,785.37	-159,742.20	114,074,059.37	1,656,809.02	89,396,461.09	819,859.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0494	-0.0209	0.7947	0.3068	0.5684	0.2128
本期加权平均净值利润率	-2.05%	-0.89%	40.20%	16.73%	37.48%	12.86%
本期基金份额净值增长率	-1.45%	-2.26%	39.75%	38.59%	46.45%	9.52%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	130,544,872.60	7,992,067.64	123,175,566.75	5,031,810.49	54,626,998.92	3,137,867.52

期末可供分配基金份额利润	1.2965	1.2458	0.7594	0.7359	0.4026	0.3968
期末基金资产净值	240,066,869.09	15,000,855.02	392,426,688.49	16,358,066.37	234,932,920.35	13,646,157.67
期末基金份额净值	2.384	2.338	2.419	2.392	1.731	1.726
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	138.40%	48.35%	141.90%	51.78%	73.10%	9.52%

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈中证 100 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	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%

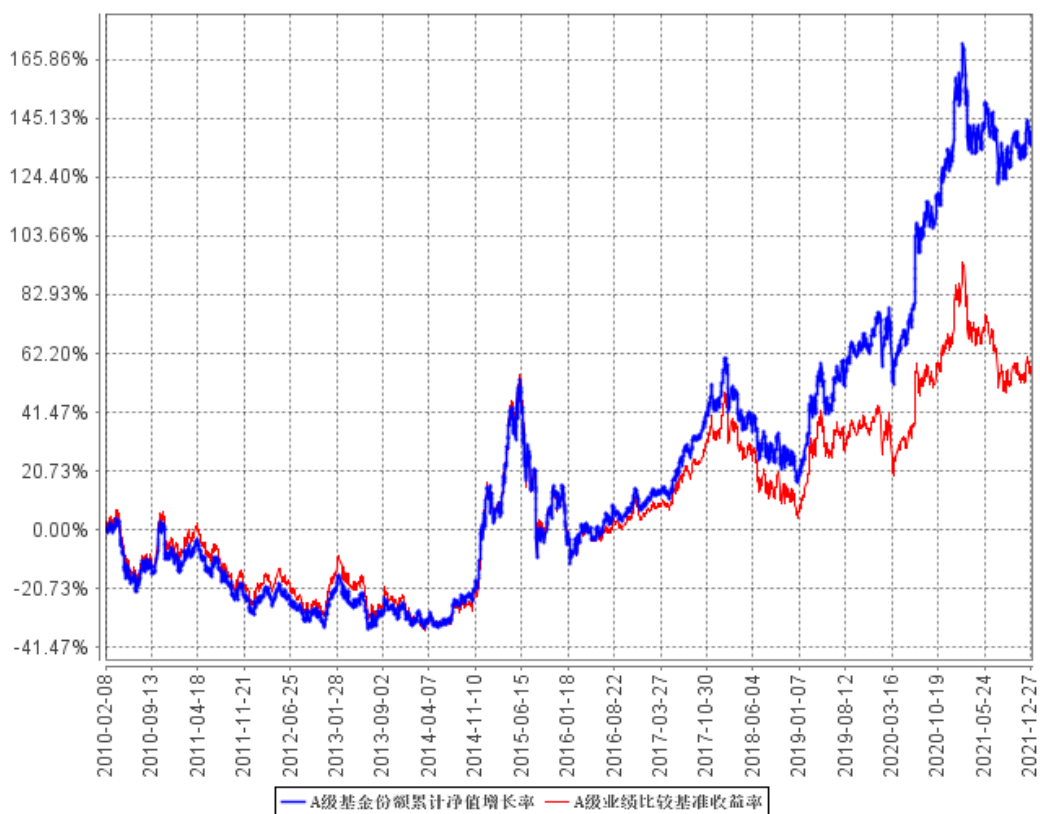
宝盈中证 100 指数增强 C

阶段	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%

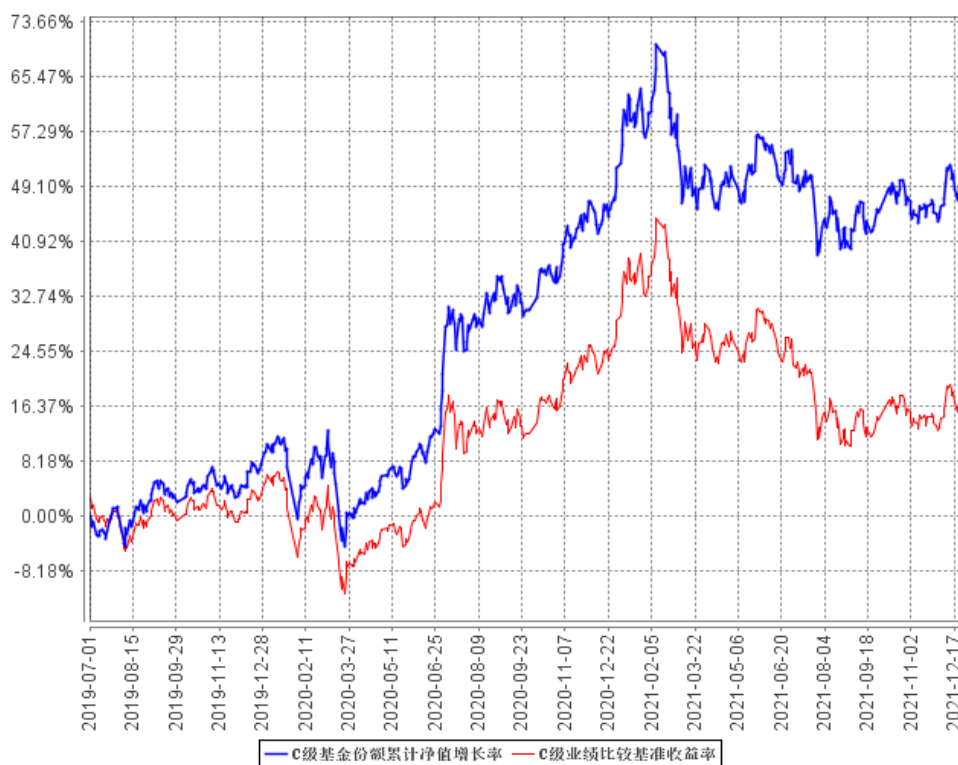
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





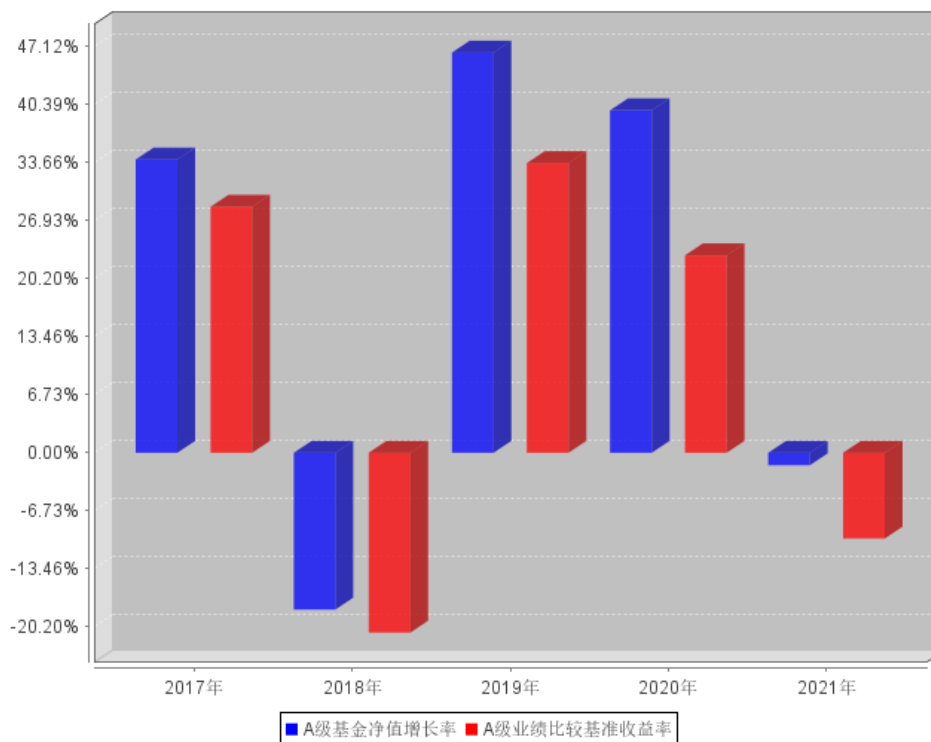
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



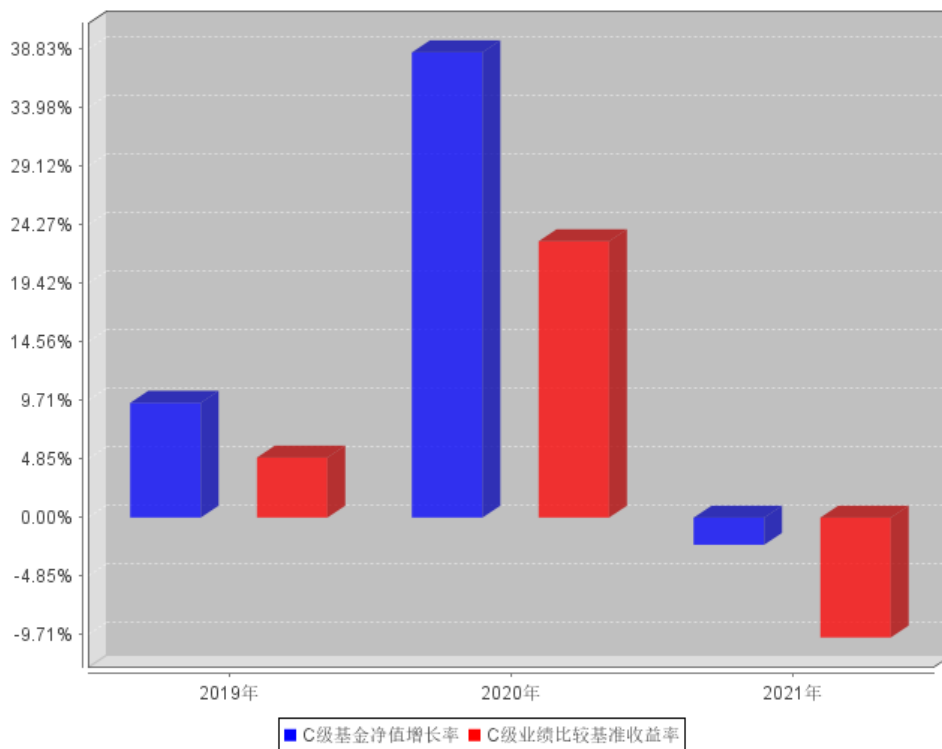
注：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈中证 100 指数增强 C”。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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”。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝

盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈盈顺纯债债券、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈辉纯债、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、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数、宝盈优质成长混合、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合五十五只基金，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、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。

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 2021 年 12 月 31 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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2021 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 月政治局会议于中央经济工作会议，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 月中旬将准落地，营造了宽松的货币环境。

2021 年多个行业监管收紧，互联网、教育、地产经历“去杠杆”，双碳调控也对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，这一年以震荡走势为主，上证综指在本年度初历经一波拉升，在 2 月中旬达到年度高点 3731.69 点，之后震荡回落。纵观全年，上证综指振幅仅有 12.06%，刷新历史新低。从成交额来看，年初成交额有小幅抬升，之后随着市场的回落开始萎缩，7 月中旬至 9 月中旬，成交量放量较为明显，A 股成交额中枢趋势上移，日度成交一度突破 1.7 万亿，从日均成交额来看，本年日均成交额达到 1.058 万亿，超过 2015 年高点，为 2008 年以来的新高，万亿成交成了新常态。从北向资金来看，本年度四个季度北上资金均为净流入，四个季度分别净流入 998.93 亿元、1237.67 亿元、681.9 亿元和 1403.19 亿元，2021Q4 净流入位居历史第二高水平，全年净流入 4321.69 亿元，创出历史新高。

从市场走势来看，本年度宽基指数涨跌参半，不同指数之间分化较大，中小创表现较好，大盘相对较弱。主要指数表现如下：中证 1000 上涨 20.52%，创 50 上涨 16.88%，中证 500 上涨 15.58%，创业板指上涨 12.02%，上证综指涨 4.8%，中证 800 下跌 0.76%，沪深 300 下跌 5.20%，上证 50 下跌 10.06%，中证 100 下跌 10.55%。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：电力设备（上涨 47.86%）、有色（上涨 40.47%）、煤炭（上涨 39.60%）、基础化工（上涨 37.19%）和钢铁（上涨 34.06%）；跌幅前五的行业：家电（下跌 19.54%）、非银金融（下跌 17.55%）、房地产（下跌 11.89%）、社会服务（下跌 10.27%）和食品饮料（下跌 6.01%）。

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，整年来看，成长价值分化不太明显。

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 年本基金 A 份额单位净值下跌 1.45%，相对基准超额收益为 8.50%，年化跟踪误差为 1.06%；本基金 C 份额单位净值下跌 2.26%，相对基准超额收益 7.69%。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 基金份额净值为 2.384 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.45%；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-2.26%；同期业绩比较基准收益率为-9.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

春节前后，受美联储议息会议鹰派言论及乌克兰局势不明朗的影响，美债收益率快速上升、美股显著调整，投资者对流动性紧缩的担忧导致市场风险偏好下降，A 股也出现了较大幅度的调整。当前来看，国内经济反弹出现小幅波折，最新披露的官方制造业 PMI 小幅回落至 50.1，1 月财新服务业 PMI 环比回落 1.7 个百分点至 51.4，我国经济总体延续恢复态势，但景气水平有所回落。

从美国来看，过去 2 年强力经济刺激政策导致了较高的基数，当前美联储加息预期较为充分，美国经济见顶回落的迹象较为明显。

当前国内货币政策维持独立宽松态势，人行引导金融机构有力扩大信贷投放，继续降低企业特别是中小微企业融资成本，市场流动性及政策环境均较为友好。从已披露的四季报数据来看，企业盈利预告基本平稳，A 股基本面没有明显的风险。

从技术面来看，上证 50、中证 100 和沪深 300 于 2021 年 Q3 确认了周线级别下跌，截止当前已经经历了 5 段或 7 段日线级别调整，最大调整幅度也都超过了 20%，当前调整已较为充分。综合股息率、股本变动率、盈利增速和估值变化，这三个指数未来一年的预期收益空间已经打开，

未来一年机会将大于风险。

从指数估值水平来看，以 2021/1/28 为基准，上证 50 的 PE 为 10.72 倍，中证 100 的为 11.70 倍，沪深 300 的 PE 为 13.06 倍，中证 500 的 PE 为 18.29 倍，创业板的 PE 为 55.35 倍。从 PE 所处的历史分位数来看，创业板位于历史的 55.94% 左右，上证 50 和沪深 300 均处于历史中位数左右，而中证 100 位于历史的 51.93% 左右；从 PB 历史分位数来看，几个大盘蓝筹指数处中位数以下，整体来看，估值水平都处于中性偏低水平。

2021 年以来，A 股国际指数扩容进程暂缓，但这丝毫没有减缓外资流入的步伐，2021 年全年北上净流入创出历史新高，中国经济复苏的较强确定性、A 股估值相对便宜，美联储加息可能短期内会对资金流向造成扰动，但我们预计外资净流入的趋势还是难以扭转。

展望未来，A 股市场流动性有望维持宽松水平，且当前 A 股市场整体的估值水平不高，拉长窗口期来看，我们认为前期调整充分的大盘蓝筹股机会将多于风险。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管（协管）领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估

值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

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

#### 4.8 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。

#### 4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 21503 号



## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金(以下简称“宝盈中证 100 指数增强基金”)的财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表, 2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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, 公允反映了宝盈中证 100 指数增强基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于宝盈中证 100 指数增强基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>宝盈中证 100 指数增强基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估宝盈中证 100 指数增强基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算宝盈中证 100 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督宝盈中证 100 指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;</p>

	<p>设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对宝盈中证 100 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致宝盈中证 100 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	童咏静   肖菊
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	8,706,559.44	8,457,809.26
结算备付金		59,813.91	61,755.94
存出保证金		13,927.46	48,361.12
交易性金融资产	7.4.7.2	247,012,617.50	401,971,013.26
其中：股票投资		240,003,917.50	385,973,813.26
基金投资		-	-
债券投资		7,008,700.00	15,997,200.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	239,650.57
应收利息	7.4.7.5	97,238.32	341,086.68
应收股利		-	-
应收申购款		187,437.90	338,176.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		256,077,594.53	411,457,853.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	621,265.26
应付赎回款		142,951.85	1,240,816.60
应付管理人报酬		316,883.68	254,922.21
应付托管费		32,513.94	50,984.45
应付销售服务费		11,101.86	10,381.23
应付交易费用	7.4.7.7	106,074.90	92,812.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	400,344.19	401,916.42
负债合计		1,009,870.42	2,673,098.45
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	107,106,527.41	169,033,698.12
未分配利润	7.4.7.10	147,961,196.70	239,751,056.74
所有者权益合计		255,067,724.11	408,784,754.86
负债和所有者权益总计		256,077,594.53	411,457,853.31

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，宝盈中证 100 指数增强 A 基金份额净值 2.384 元，基金份额总额 100,691,376.78 份；宝盈中证 100 指数增强 C 基金份额净值 2.338 元，基金份额总额 6,415,150.63 份。宝盈中证 100 指数增强份额总额合计为 107,106,527.41 份。

## 7.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-2,017,726.56	119,364,710.69
1. 利息收入		286,408.06	293,812.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	39,977.65	57,431.37
债券利息收入		246,430.41	236,381.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		70,888,374.40	58,310,543.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	66,076,264.87	51,451,697.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-88,600.00	-7,889.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,900,709.53	6,866,735.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-73,871,854.43	60,445,465.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	679,345.41	314,888.82
<b>减：二、费用</b>		3,931,801.01	3,633,842.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,277,126.13	2,185,832.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	455,425.24	437,166.48
3. 销售服务费		144,881.22	79,064.74
4. 交易费用	7.4.7.19	870,827.86	743,452.37
5. 利息支出		410.95	3,671.08
其中：卖出回购金融资产支出		410.95	3,671.08
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	183,129.61	184,655.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,949,527.57	115,730,868.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,949,527.57	115,730,868.39

## 7.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	169,033,698.12	239,751,056.74	408,784,754.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,949,527.57	-5,949,527.57
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）	-61,927,170.71	-85,840,332.47	-147,767,503.18
其中：1. 基金申购款	64,387,701.54	90,212,218.64	154,599,920.18
2. 基金赎回款	-126,314,872.25	-176,052,551.11	-302,367,423.36
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）	107,106,527.41	147,961,196.70	255,067,724.11
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	143,601,994.02	104,977,084.00	248,579,078.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	115,730,868.39	115,730,868.39
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）	25,431,704.10	19,043,104.35	44,474,808.45
其中：1. 基金申购款	183,886,162.19	157,338,111.99	341,224,274.18
2. 基金赎回款	-158,454,458.09	-138,295,007.64	-296,749,465.73

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）	169,033,698.12	239,751,056.74	408,784,754.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨凯 _____	_____ 张献锦 _____	_____ 何瑜 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制



等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动

额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### **7.4.5.2 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。

##### **7.4.5.3 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。

##### **7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	8,706,559.44	8,457,809.26
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计:	8,706,559.44	8,457,809.26

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	220,575,352.01	240,003,917.50	19,428,565.49
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,019,400.00	7,008,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	7,019,400.00	7,008,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	227,594,752.01	247,012,617.50	19,417,865.49
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	292,626,393.34	385,973,813.26	93,347,419.92
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,054,900.00	15,997,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	16,054,900.00	15,997,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	308,681,293.34	401,971,013.26	93,289,719.92

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	914.68	974.70
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	29.59	30.58
应收债券利息	96,287.12	340,057.53
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	6.93	23.87
合计	97,238.32	341,086.68

## 7.4.7.6 其他资产

无余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	106,074.90	92,812.28
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	106,074.90	92,812.28

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付赎回费	344.19	1,916.42
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	400,000.00	400,000.00
合计	400,344.19	401,916.42

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 A	
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	162,196,049.83	162,196,049.83
本期申购	46,796,816.22	46,796,816.22
本期赎回 (以“-”号填列)	-108,301,489.27	-108,301,489.27
本期末	100,691,376.78	100,691,376.78

金额单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	6,837,648.29	6,837,648.29
本期申购	17,590,885.32	17,590,885.32
本期赎回 (以“-”号填列)	-18,013,382.98	-18,013,382.98
本期末	6,415,150.63	6,415,150.63

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	123,175,566.75	107,055,071.91	230,230,638.66
本期利润	64,475,000.76	-70,264,786.13	-5,789,785.37
本期基金份额交易产生的变动数	-57,105,694.91	-27,959,666.07	-85,065,360.98
其中：基金申购款	47,679,295.28	18,668,281.08	66,347,576.36
基金赎回款	-104,784,990.19	-46,627,947.15	-151,412,937.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	130,544,872.60	8,830,619.71	139,375,492.31

单位：人民币元

宝盈中证 100 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,031,810.49	4,488,607.59	9,520,418.08
本期利润	3,447,326.10	-3,607,068.30	-159,742.20
本期基金份额交易产生的变动数	-487,068.95	-287,902.54	-774,971.49
其中：基金申购款	18,899,981.33	4,964,660.95	23,864,642.28
基金赎回款	-19,387,050.28	-5,252,563.49	-24,639,613.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,992,067.64	593,636.75	8,585,704.39

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	37,372.37	53,591.40
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	2,131.08	3,163.61
其他	474.20	676.36
合计	39,977.65	57,431.37

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	328,292,095.54	218,179,995.68
减：卖出股票成本总额	262,215,830.67	166,728,298.68
买卖股票差价收入	66,076,264.87	51,451,697.00

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	26,611,000.00	11,065,973.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	26,088,600.00	10,808,689.40
减：应收利息总额	611,000.00	265,173.16
买卖债券差价收入	-88,600.00	-7,889.40

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

##### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

##### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
----	---	--



股票投资产生的股利收益	4,900,709.53	6,866,735.60
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	4,900,709.53	6,866,735.60

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	-73,871,854.43	60,445,465.96
——股票投资	-73,918,854.43	60,511,856.56
——债券投资	47,000.00	-66,390.60
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-73,871,854.43	60,445,465.96

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
基金赎回费收入	297,043.78	231,421.04
基金转换费收入	16,791.71	83,467.78
其他	365,509.92	-
合计	679,345.41	314,888.82

注：其他为康美药业案赔偿款。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易费用	870,827.86	743,452.37
银行间市场交易费用	-	-

交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	870,827.86	743,452.37

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	3,129.61	4,655.20
合计	183,129.61	184,655.20

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（以下简称“宝盈基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,277,126.13	2,185,832.43
其中:支付销售机构的客户维护费	563,283.49	455,854.23

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	455,425.24	437,166.48

注:支付基金托管人中国建设银行的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:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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
建设银行	0.00	0.00	0.00
宝盈基金公司	0.00	80,744.54	80,744.54
合计	0.00	80,744.54	80,744.54
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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
建设银行	0.00	0.00	0.00
宝盈基金公司	0.00	39,198.37	39,198.37
合计	0.00	39,198.37	39,198.37

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

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

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.10.4 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

## 7.4.10.4.1 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。

## 7.4.10.4.2 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。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 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 2021年1月1日至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
报告期初持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.94%	-

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
报告期初持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,957,206.52	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.82%	-

## 7.4.10.5.2 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。

## 7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	8,706,559.44	37,372.37	8,457,809.26	53,591.40
--------	--------------	-----------	--------------	-----------

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	41.98	41.98	2,443	102,557.14	102,557.14	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-

688768	容知日新	2021年7月16日	2022年1月26日	新股流通受限	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688296	和达科技	2021年7月19日	2022年1月27日	新股流通受限	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	343	7,559.72	19,304.04	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股流通受限	4.53	4.27	197,005	892,432.65	841,211.35	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	60.64	234.74	134	8,125.76	31,455.16	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
688091	上海谊众	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	38.10	42.81	2,075	79,057.50	88,830.75	-
301058	中粮工科	2021年9月	2022年3月	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-

		1 日	9 日	受限							
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-	
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-	
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-	
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-	
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-	
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-	
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-	
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-	
301081	严牌股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301083	百胜智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
688737	中自科技	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 22 日	新股流通受限	70.90	55.06	1,180	83,662.00	64,970.80	-	
301087	可孚医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股流通受限	93.09	75.34	157	14,615.13	11,828.38	-	
688553	汇宇制药	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 26 日	新股流通受限	38.87	32.11	2,856	111,012.72	91,706.16	-	
301090	华润材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	新股流通受限	10.45	11.22	981	10,251.45	11,006.82	-	
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301088	戎美股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	新股流通受限	33.16	24.67	286	9,483.76	7,055.62	-	
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股流通受限	36.50	31.31	310	11,315.00	9,706.10	-	
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股流通受限	36.31	35.52	191	6,935.21	6,784.32	-	
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-	

688105	诺唯赞	2021 年 11 月 5 日	2022 年 5 月 16 日	新股流通受限	55.00	93.29	2,090	114,950.00	194,976.10	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301099	雅创电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
688190	云路股份	2021 年 11 月 18 日	2022 年 5 月 26 日	新股流通受限	46.63	92.51	1,394	65,002.22	128,958.94	-
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
688230	芯导科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	新股流通受限	134.81	130.31	882	118,902.42	114,933.42	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股流通受限	57.27	53.71	107	6,127.89	5,746.97	-
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	12.37	19.23	635	7,854.95	12,211.05	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	29.28	32.00	241	7,056.48	7,712.00	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流通受限	43.99	50.77	146	6,422.54	7,412.42	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	新股流通受限	30.73	29.14	245	7,528.85	7,139.30	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流通受限	39.08	52.13	197	7,698.76	10,269.61	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流通受限	116.88	116.08	139	16,246.32	16,135.12	-
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流通受限	26.17	44.86	269	7,039.73	12,067.34	-
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股流通受限	26.91	43.36	308	8,288.28	13,354.88	-
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股流通受限	27.81	31.14	285	7,925.85	8,874.90	-
301096	百诚医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股流通受限	79.60	78.53	82	6,527.20	6,439.46	-
301211	亨迪药业	2021 年 12 月	2022 年 6 月	新股流通受限	25.80	33.65	416	10,732.80	13,998.40	-



		月 14 日	22 日	受限						
688167	炬光科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流通受限	78.69	176.67	719	56,578.11	127,025.73	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流通受限	27.85	27.46	277	7,714.45	7,606.42	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流通受限	86.06	94.50	102	8,778.12	9,639.00	-
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流通受限	66.18	56.62	165	10,919.70	9,342.30	-
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新股流通受限	12.03	17.12	939	11,296.17	16,075.68	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资和资产支持证券投资(2020 年 12 月 31 日:同)。

##### 7.4.13.2.1 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,001,200.00	15,997,200.00
合计	4,001,200.00	15,997,200.00

注:于 2021 年 12 月 31 日,未评级部分为国债。债券信用评级取自第三方评级机构。

##### 7.4.13.2.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	3,007,500.00	-
合计	3,007,500.00	-

注:于 2021 年 12 月 31 日,未评级部分为国债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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期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上市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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.10%。

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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	8,706,559.44	-	-	-	8,706,559.44
结算备付金	59,813.91	-	-	-	59,813.91
存出保证金	13,927.46	-	-	-	13,927.46
交易性金融资产	7,008,700.00	-	-	240,003,917.50	247,012,617.50
应收利息	-	-	-	97,238.32	97,238.32
应收申购款	-	-	-	187,437.90	187,437.90
资产总计	15,789,000.81	-	-	240,288,593.72	256,077,594.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	142,951.85	142,951.85
应付管理人报酬	-	-	-	316,883.68	316,883.68
应付托管费	-	-	-	32,513.94	32,513.94
应付销售服务费	-	-	-	11,101.86	11,101.86
应付交易费用	-	-	-	106,074.90	106,074.90
其他负债	-	-	-	400,344.19	400,344.19
负债总计	-	-	-	1,009,870.42	1,009,870.42

利率敏感度缺口	15,789,000.81	-	-	239,278,723.30	255,067,724.11
上年度末 2020 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	8,457,809.26	-	-	-	8,457,809.26
结算备付金	61,755.94	-	-	-	61,755.94
存出保证金	48,361.12	-	-	-	48,361.12
交易性金融资产	15,997,200.00	-	-	385,973,813.26	401,971,013.26
应收证券清算款	-	-	-	239,650.57	239,650.57
应收利息	-	-	-	341,086.68	341,086.68
应收申购款	-	-	-	338,176.48	338,176.48
资产总计	24,565,126.32	-	-	386,892,726.99	411,457,853.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	621,265.26	621,265.26
应付赎回款	-	-	-	1,240,816.60	1,240,816.60
应付管理人报酬	-	-	-	254,922.21	254,922.21
应付托管费	-	-	-	50,984.45	50,984.45
应付销售服务费	-	-	-	10,381.23	10,381.23
应付交易费用	-	-	-	92,812.28	92,812.28
其他负债	-	-	-	401,916.42	401,916.42
负债总计	-	-	-	2,673,098.45	2,673,098.45
利率敏感度缺口	24,565,126.32	-	-	384,219,628.54	408,784,754.86

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.75% (2020 年 12 月 31 日：3.91%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	240,003,917.50	94.09	385,973,813.26	94.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	240,003,917.50	94.09	385,973,813.26	94.42

#### 7.4.13.4.3.2 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 中证 100 指数收益率上升 5%		12,381,258.33
2. 中证 100 指数收益率下降 5%		-12,381,258.33	-18,518,298.94

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 237,199,678.95 元，属于第二层次的余额为 7,192,211.07 元，属于第三层次的余额为 2,620,727.48 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 381,765,364.50 元，第二层次 20,205,648.76 元，无第三层次)。

(ii) 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日本基金持有的公允价值归属于第三层次的金融工具 2,620,727.48 元。于 2021 年度，本基金购买第三层次的金融工具 1,941,555.2 元，计入损益的利得或损失总额(均计入利润表中的公允价值变动收益项目)679,172.28 元。于 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动为 679,172.28 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次交易性金融资产(均为证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资)公允价值为 2,620,727.48 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具



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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，相应调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	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	其他各项资产	298,603.68	0.12
9	合计	256,077,594.53	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

### 8.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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
11	600900	长江电力	177,700	4,033,790.00	1.58
12	600887	伊利股份	96,800	4,013,328.00	1.57
13	600030	中信证券	146,400	3,866,424.00	1.52
14	002415	海康威视	73,887	3,865,767.84	1.52
15	603259	药明康德	31,972	3,791,239.76	1.49
16	002475	立讯精密	76,988	3,787,809.60	1.49
17	600276	恒瑞医药	69,528	3,525,764.88	1.38
18	601888	中国中免	15,600	3,422,796.00	1.34
19	000568	泸州老窖	12,300	3,122,601.00	1.22
20	300760	迈瑞医疗	7,700	2,932,160.00	1.15
21	601398	工商银行	607,700	2,813,651.00	1.10
22	000001	平安银行	169,920	2,800,281.60	1.10
23	000651	格力电器	74,700	2,766,141.00	1.08
24	000725	京东方 A	523,800	2,645,190.00	1.04

25	600809	山西汾酒	8,340	2,633,605.20	1.03
26	603501	韦尔股份	8,200	2,548,314.00	1.00
27	600309	万华化学	24,400	2,464,400.00	0.97
28	300274	阳光电源	16,300	2,376,540.00	0.93
29	002142	宁波银行	60,820	2,328,189.60	0.91
30	601328	交通银行	494,300	2,278,723.00	0.89
31	600436	片仔癀	5,100	2,229,465.00	0.87
32	601899	紫金矿业	224,100	2,173,770.00	0.85
33	002714	牧原股份	40,690	2,171,218.40	0.85
34	600438	通威股份	48,200	2,167,072.00	0.85
35	600031	三一重工	93,700	2,136,360.00	0.84
36	300014	亿纬锂能	17,900	2,115,422.00	0.83
37	002352	顺丰控股	30,600	2,108,952.00	0.83
38	000002	万科 A	106,300	2,100,488.00	0.82
39	603288	海天味业	19,656	2,066,042.16	0.81
40	002812	恩捷股份	8,200	2,053,280.00	0.80
41	600837	海通证券	160,400	1,966,504.00	0.77
42	300124	汇川技术	28,500	1,955,100.00	0.77
43	601919	中远海控	103,090	1,926,752.10	0.76
44	601288	农业银行	632,300	1,858,962.00	0.73
45	300015	爱尔眼科	42,064	1,778,465.92	0.70
46	600690	海尔智家	58,500	1,748,565.00	0.69
47	600048	保利发展	111,100	1,736,493.00	0.68
48	601668	中国建筑	343,140	1,715,700.00	0.67
49	600406	国电南瑞	42,800	1,713,284.00	0.67
50	601816	京沪高铁	342,700	1,655,241.00	0.65
51	000063	中兴通讯	49,000	1,641,500.00	0.64
52	600585	海螺水泥	38,700	1,559,610.00	0.61
53	600000	浦发银行	181,433	1,547,623.49	0.61
54	600745	闻泰科技	11,900	1,538,670.00	0.60
55	300122	智飞生物	12,300	1,532,580.00	0.60
56	002304	洋河股份	9,300	1,531,989.00	0.60
57	600104	上汽集团	73,000	1,505,990.00	0.59
58	600016	民生银行	384,160	1,498,224.00	0.59
59	601601	中国太保	54,700	1,483,464.00	0.58
60	601688	华泰证券	82,900	1,472,304.00	0.58
61	000661	长春高新	5,100	1,384,140.00	0.54
62	300498	温氏股份	71,560	1,378,245.60	0.54
63	002027	分众传媒	162,312	1,329,335.28	0.52

64	601211	国泰君安	72,400	1,295,236.00	0.51
65	601766	中国中车	195,500	1,190,595.00	0.47
66	601088	中国神华	52,600	1,184,552.00	0.46
67	600050	中国联通	296,100	1,163,673.00	0.46
68	601229	上海银行	161,985	1,154,953.05	0.45
69	600019	宝钢股份	150,100	1,074,716.00	0.42
70	600999	招商证券	59,000	1,041,350.00	0.41
71	600905	三峡能源	132,600	995,826.00	0.39
72	600028	中国石化	232,500	983,475.00	0.39
73	601988	中国银行	322,100	982,405.00	0.39
74	601138	工业富联	81,000	965,520.00	0.38
75	601633	长城汽车	19,600	951,384.00	0.37
76	600588	用友网络	26,500	950,820.00	0.37
77	002493	荣盛石化	49,900	906,184.00	0.36
78	601818	光大银行	272,000	903,040.00	0.35
79	000166	申万宏源	170,145	871,142.40	0.34
80	601728	中国电信	197,005	841,211.35	0.33
81	601658	邮储银行	165,000	841,500.00	0.33
82	000538	云南白药	7,935	830,397.75	0.33
83	000895	双汇发展	26,000	820,300.00	0.32
84	601628	中国人寿	27,200	818,448.00	0.32
85	003816	中国广核	245,500	768,415.00	0.30
86	600346	恒力石化	31,700	728,149.00	0.29
87	601857	中国石油	147,400	723,734.00	0.28
88	600009	上海机场	14,800	691,012.00	0.27
89	300433	蓝思科技	30,000	689,400.00	0.27
90	688111	金山办公	2,400	636,000.00	0.25
91	601066	中信建投	19,400	567,450.00	0.22
92	601336	新华保险	13,000	505,440.00	0.20
93	002736	国信证券	42,100	483,308.00	0.19
94	300999	金龙鱼	6,400	402,752.00	0.16
95	600018	上港集团	63,100	345,788.00	0.14
96	601998	中信银行	59,540	275,074.80	0.11
97	601319	中国人保	54,900	258,030.00	0.10
98	002607	中公教育	27,900	219,294.00	0.09
99	601995	中金公司	4,400	215,732.00	0.08

## 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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
6	002311	海大集团	2,200	161,260.00	0.06
7	002709	天赐材料	1,400	160,510.00	0.06
8	300347	泰格医药	1,200	153,360.00	0.06
9	603986	兆易创新	800	140,680.00	0.06
10	603198	迎驾贡酒	2,000	138,900.00	0.05
11	688190	云路股份	1,394	128,958.94	0.05
12	688167	炬光科技	719	127,025.73	0.05
13	688230	芯导科技	882	114,933.42	0.05
14	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.04
15	688739	成大生物	1,358	103,384.54	0.04
16	688262	国芯科技	2,443	102,557.14	0.04
17	301091	深城交	3,100	101,664.50	0.04
18	688768	容知日新	907	98,445.78	0.04
19	688192	迪哲医药	2,566	94,967.66	0.04
20	603260	合盛硅业	700	92,379.00	0.04
21	688553	汇宇制药	2,856	91,706.16	0.04
22	688091	上海谊众	2,075	88,830.75	0.03
23	688211	中科微至	1,050	78,750.00	0.03
24	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.03
25	301088	戎美股份	2,853	73,540.92	0.03
26	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.03
27	688737	中自科技	1,180	64,970.80	0.03
28	600176	中国巨石	3,372	61,370.40	0.02
29	002041	登海种业	2,000	51,580.00	0.02
30	300601	康泰生物	500	49,270.00	0.02
31	300146	汤臣倍健	1,600	43,136.00	0.02
32	300251	光线传媒	3,300	42,405.00	0.02
33	301029	怡合达	462	41,519.94	0.02
34	300390	天华超净	500	40,500.00	0.02
35	000708	中信特钢	1,900	38,912.00	0.02

36	601636	旗滨集团	2,200	37,620.00	0.01
37	600570	恒生电子	600	37,290.00	0.01
38	002179	中航光电	360	36,201.60	0.01
39	600008	首创环保	10,000	34,100.00	0.01
40	600760	中航沈飞	500	34,020.00	0.01
41	603185	上机数控	200	33,396.00	0.01
42	300502	新易盛	840	32,911.20	0.01
43	603369	今世缘	600	32,640.00	0.01
44	002541	鸿路钢构	600	32,124.00	0.01
45	603659	璞泰来	200	32,122.00	0.01
46	601231	环旭电子	2,000	32,120.00	0.01
47	301050	雷电微力	134	31,455.16	0.01
48	688036	传音控股	200	31,380.00	0.01
49	000069	华侨城 A	4,400	30,976.00	0.01
50	000615	奥园美谷	2,800	30,184.00	0.01
51	000012	南玻 A	3,000	29,790.00	0.01
52	002460	赣锋锂业	200	28,570.00	0.01
53	000887	中鼎股份	1,300	28,353.00	0.01
54	600926	杭州银行	2,200	28,204.00	0.01
55	002945	华林证券	2,000	27,320.00	0.01
56	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
57	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
58	600795	国电电力	7,700	24,409.00	0.01
59	002867	周大生	1,350	24,003.00	0.01
60	601607	上海医药	1,200	23,844.00	0.01
61	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
62	300450	先导智能	320	23,798.40	0.01
63	002007	华兰生物	800	23,312.00	0.01
64	300142	沃森生物	400	22,480.00	0.01
65	601878	浙商证券	1,700	22,406.00	0.01
66	002230	科大讯飞	400	21,004.00	0.01
67	000100	TCL 科技	3,400	20,978.00	0.01
68	601225	陕西煤业	1,700	20,740.00	0.01
69	601155	新城控股	700	20,391.00	0.01
70	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
71	600763	通策医疗	100	19,900.00	0.01
72	301035	润丰股份	343	19,304.04	0.01
73	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
74	600111	北方稀土	400	18,320.00	0.01

75	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
76	601377	兴业证券	1,800	17,784.00	0.01
77	600655	豫园股份	1,600	16,480.00	0.01
78	601100	恒立液压	200	16,360.00	0.01
79	601898	中煤能源	2,600	16,354.00	0.01
80	301177	迪阿股份	139	16,135.12	0.01
81	301127	天源环保	939	16,075.68	0.01
82	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
83	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
84	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.01
85	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
86	301211	亨迪药业	416	13,998.40	0.01
87	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
88	301101	明月镜片	308	13,354.88	0.01
89	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
90	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
91	000733	振华科技	100	12,428.00	0.00
92	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
93	301126	达嘉维康	635	12,211.05	0.00
94	301138	华研精机	269	12,067.34	0.00
95	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
96	301087	可孚医疗	157	11,828.38	0.00
97	002414	高德红外	476	11,523.96	0.00
98	301090	华润材料	981	11,006.82	0.00
99	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
100	002241	歌尔股份	200	10,820.00	0.00
101	002271	东方雨虹	200	10,536.00	0.00
102	301168	通灵股份	197	10,269.61	0.00
103	600029	南方航空	1,500	10,215.00	0.00
104	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
105	301166	优宁维	102	9,639.00	0.00
106	600660	福耀玻璃	200	9,428.00	0.00
107	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
108	301189	奥尼电子	165	9,342.30	0.00
109	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
110	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
111	301100	风光股份	285	8,874.90	0.00
112	300676	华大基因	100	8,780.00	0.00
113	300677	英科医疗	150	8,676.00	0.00



114	000625	长安汽车	560	8,506.40	0.00
115	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
116	002146	荣盛发展	1,900	8,265.00	0.00
117	300628	亿联网络	100	8,145.00	0.00
118	600038	中直股份	100	8,030.00	0.00
119	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
120	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
121	301199	迈赫股份	241	7,712.00	0.00
122	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
123	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
124	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
125	301190	善水科技	277	7,606.42	0.00
126	301179	泽宇智能	146	7,412.42	0.00
127	600606	绿地控股	1,700	7,378.00	0.00
128	000656	金科股份	1,600	7,168.00	0.00
129	301193	家联科技	245	7,139.30	0.00
130	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
131	301092	争光股份	191	6,784.32	0.00
132	600115	中国东航	1,300	6,708.00	0.00
133	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
134	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
135	301096	百诚医药	82	6,439.46	0.00
136	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
137	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
138	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
139	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
140	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
141	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
142	301108	洁雅股份	107	5,746.97	0.00
143	300595	欧普康视	100	5,737.00	0.00
144	000403	派林生物	200	5,606.00	0.00
145	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
146	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
147	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
148	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
149	601216	君正集团	1,000	5,230.00	0.00
150	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
151	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
152	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00

153	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
154	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
155	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
156	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
157	002001	新和成	120	3,734.40	0.00
158	600299	安迪苏	300	3,696.00	0.00
159	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
160	600884	杉杉股份	100	3,277.00	0.00
161	000039	中集集团	100	1,716.00	0.00
162	600919	江苏银行	200	1,166.00	0.00
163	601600	中国铝业	100	609.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300750	宁德时代	15,290,900.70	3.74
2	600519	贵州茅台	7,745,267.80	1.89
3	600036	招商银行	3,230,349.00	0.79
4	600438	通威股份	3,213,511.00	0.79
5	601318	中国平安	3,212,958.00	0.79
6	000858	五粮液	3,121,666.64	0.76
7	300760	迈瑞医疗	2,997,232.00	0.73
8	300124	汇川技术	2,962,821.50	0.72
9	300014	亿纬锂能	2,934,940.00	0.72
10	002415	海康威视	2,922,532.60	0.71
11	600436	片仔癀	2,876,124.00	0.70
12	300274	阳光电源	2,686,299.00	0.66
13	601012	隆基股份	2,559,532.00	0.63
14	603259	药明康德	2,556,011.20	0.63
15	000333	美的集团	2,469,460.80	0.60
16	002812	恩捷股份	2,443,192.00	0.60
17	601919	中远海控	2,314,913.20	0.57
18	601816	京沪高铁	2,310,488.00	0.57
19	300015	爱尔眼科	2,175,992.00	0.53
20	688111	金山办公	2,141,457.47	0.52

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。

#### 8.4.2 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	16,386,285.00	4.01
2	601318	中国平安	13,239,890.00	3.24
3	600036	招商银行	11,692,928.00	2.86
4	000858	五粮液	10,172,004.00	2.49
5	000333	美的集团	7,355,540.75	1.80
6	601166	兴业银行	6,184,272.00	1.51
7	600276	恒瑞医药	6,108,281.39	1.49
8	601888	中国中免	5,319,460.41	1.30
9	000651	格力电器	5,081,193.00	1.24
10	601012	隆基股份	4,816,417.00	1.18
11	002415	海康威视	4,776,205.00	1.17
12	300059	东方财富	4,766,624.40	1.17
13	600887	伊利股份	4,466,506.00	1.09
14	000001	平安银行	4,449,494.05	1.09
15	600030	中信证券	4,364,783.00	1.07
16	002594	比亚迪	3,957,575.00	0.97
17	603259	药明康德	3,926,690.00	0.96
18	000568	泸州老窖	3,804,974.00	0.93
19	000725	京东方 A	3,723,945.00	0.91
20	601398	工商银行	3,705,024.00	0.91

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。

#### 8.4.3 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	190,164,789.34
卖出股票收入（成交）总额	328,292,095.54

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。

#### 8.5 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	7,008,700.00	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

## 8.6 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	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

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除兴业银行、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。

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	298,603.68

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 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	688105	诺唯赞	194,976.10	0.08	新股锁定

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)	额	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	12,458	8,082.47	25,146,259.54	24.97%	75,545,117.24	75.03%
宝盈中证 100 指数增强 C	1,936	3,313.61	3,041,362.53	47.41%	3,373,788.10	52.59%
合计	14,394	7,441.05	28,187,622.07	26.32%	78,918,905.34	73.68%

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

## 9.2 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	33,145.01	0.0329%
	宝盈中证 100 指数增强 C	5,802.51	0.0905%
	合计	38,947.52	0.0364%

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）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈中证 100 指数增强 A	0~10
	宝盈中证 100 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈中证 100 指数增强 A	0
	宝盈中证 100 指数增强 C	0
	合计	0

## § 10 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	162,196,049.83	6,837,648.29
本报告期基金总申购份额	46,796,816.22	17,590,885.32
减：本报告期基金总赎回份额	108,301,489.27	18,013,382.98
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	100,691,376.78	6,415,150.63

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 60,000.00 元，目前事务所已连续 13 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	309,624,053.96	61.68%	282,161.07	61.68%	-



华泰证券	1	192,399,296.09	38.32%	175,334.40	38.32%	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

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、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无新租和退租交易单元。

### 11.7.2 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	17,053,100.00	100.00%	6,700,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 12 月 8 日
2	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加国信证券股份有限公司手续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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 12 月 2 日
3	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 11 月 26 日

4	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	2021 年 11 月 26 日
5	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	2021 年 11 月 26 日
6	宝盈基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	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	2021 年 10 月 30 日
7	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 27 日
8	宝盈基金管理有限公司旗下 49 只基金 2021 年第 3 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	2021 年 10 月 27 日
9	宝盈基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构及参与相关费率优惠的公告	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	2021 年 10 月 22 日
10	宝盈基金管理有限公司关于新增北京创金启富基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 30 日
11	宝盈基金管理有限公司关于新增奕丰金融为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 30 日
12	宝盈基金管理有限公司关于新增基煜基金为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 23 日
13	宝盈基金管理有限公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为旗下部分 C 类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	2021 年 9 月 22 日
14	宝盈基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 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	2021 年 9 月 8 日
15	宝盈基金管理有限公司关于新增招商银行股份有限公司招赢	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基	2021 年 9 月 8 日

	通平台销售旗下部分基金的公告	金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	
16	宝盈基金管理有限公司关于增加西部证券股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 3 日
17	关于宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金增加恒泰证券股份有限公司为代销机构的公告	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	2021 年 9 月 3 日
18	宝盈基金管理有限公司关于新增众惠基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 3 日
19	宝盈基金管理有限公司关于宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 3 日
20	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 31 日
21	宝盈基金管理有限公司旗下 48 只基金 2021 年中期报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2021 年 8 月 31 日
22	宝盈基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 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	2021 年 8 月 18 日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长城证券股份有限公司手续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	2021 年 8 月 16 日
24	宝盈基金管理有限公司关于新增财咨道信息技术有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 13 日
25	宝盈基金管理有限公司关于新增上海爱建基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 13 日
26	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司手续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	2021 年 8 月 13 日
27	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 21 日

28	宝盈基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 7 月 21 日
29	宝盈基金管理有限公司旗下 48 只基金 2021 年第 2 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	2021 年 7 月 21 日
30	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司基金申购及定期定额投资手续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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日
31	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 6 月 25 日
32	宝盈基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 5 月 21 日
33	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
34	宝盈基金管理有限公司旗下 46 只基金 2021 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	2021 年 4 月 22 日
35	宝盈基金管理有限公司关于新增北京度小满基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 4 月 16 日
36	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 4 月 15 日
37	宝盈基金管理有限公司关于新增玄元保险代理有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 4 月 13 日
38	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
39	宝盈基金管理有限公司旗下 45 只基金 2020 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	2021 年 3 月 31 日
40	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
41	宝盈中证 100 指数增强型证券	本基金管理人网站, 中国证	2021 年 3 月 31 日

	投资基金基金合同	券会基金电子披露网站	
42	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金托管协议	本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
43	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根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同、托管协议等法律文件有关条款的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
44	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
45	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
46	宝盈基金管理有限公司关于增加中邮证券股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 19 日
47	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加东方证券股份有限公司手续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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 3 月 15 日
48	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司手续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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
49	宝盈基金管理有限公司关于新增中信期货有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
50	宝盈基金管理有限公司关于参加信达证券股份有限公司费率优惠的公告	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 2 月 2 日
51	宝盈基金管理有限公司关于网上直销平台“招商银行一网通”渠道费率优惠的公告	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, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
52	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 1 月 22 日

53	宝盈基金管理有限公司旗下 45 只基金 2020 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	2021 年 1 月 22 日
54	宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金调整限制大额申购、转换转入、定期定额投资业务金额的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证券会基金电子披露网站	2021 年 1 月 19 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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

### 13.3 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 3 月 30 日