宝盈增强收益债券型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月十九日

§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2011年7月18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2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈增强收益债券
基金主代码	213007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月15日
报告期末基金份额总额	1,184,599,099.75份
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股(含增发、配售)以及二级市场股票投资之间的配置: ①基于对利率、信用等因素的分析,预测固定收益品种的风险和收益; ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断; ③基于对新股发行规模、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析,预测新股中购的风险和收益; ④股票市场走势的预测。
业绩比较基准	中信标普全债指数 中信标普全债指数涵盖国债、企业债、金融债、可转债,具有良好的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出,或有更科学客观的权重比例适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致,在履行适当程序后实施,并在更新的招募说明书中列示。
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基金简称	宝盈增强收益债券A/B / 宝盈增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	213007(前端),213907(后端) / 213917
报告期末下属两级基金的份额总额	966,161,279.42份 / 218,437,820.33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(2011年4月1日-2011年6月30日)	
	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
1.本期已实现收益	-6,659,693.14	-1,781,396.69
2.本期利润	-7,602,303.85	-2,291,059.24
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0080	-0.0092
4.期末基金资产净值	999,549,112.95	223,164,893.19
5.期末基金份额净值	1.0346	1.0216

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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 本报告期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

1、宝盈增强收益债券A/B:

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	-0.76%	0.31%	0.53%	0.04%	-1.29%	0.27%

2、宝盈增强收益债券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	-0.88%	0.31%	0.53%	0.04%	-1.41%	0.27%

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

宝盈增强收益债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年5月15日至2011年6月30日)

1.宝盈增强收益债券A/B:

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

2.宝盈增强收益债券C:

注:① 本基金于2008年10月20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"宝盈增强收益债券C"。

②按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理兼固定收益部总监	2008-9-1	-	8年	陈若劲,女,1971年生,香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。现同时担任宝盈货币市场证券投资基金基金经理、固定收益部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,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。经检查,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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为债券型基金,其投资风格及管理人旗下其它基金和投资组合的风格存在较大差异,本基金业绩和管理人旗下其它组合的投资业绩不具有可比性。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季末,我们判断二季度经济增速环比可能回落,通胀水平依然高企,政策基调以严控通胀并巩固前期成果为主,力度不会加码,主要扰动市场情绪的因素是对通胀和调控的预期变化。流动性方面,我们判断将逐步趋紧,而整体收益率中枢将小幅上行。

实际的宏观经济运行情况符合预期,调控节奏基本保持每月上调一次准备金率并在4月加息一次。流动性方面,市场资金的紧张程度超出我们的预期,尽管我们预期二季度回购利率会逐渐上行,但是回购利率上行幅度和在高位维持的时间长度远超我们的预期。

债券类资产组合的操作上,减持浮动利率债券和短期融资券,并在可转债下跌过程中逐渐增仓,在市场收益率上行后配置部分新发公司债。

对于权益类品种,我们坚持自下而上的挖掘可持续增长、估值合理的公司。市场下跌过程中,逐步加仓,权益类资产占比较一季末有所上升。对于一级新股网下认购,则较为谨慎,获配量相对较少。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

增强收益A/B:

本基金在本报告期内净值增长率是-0.76%,同期业绩比较基准收益率是0.53%。

增强收益C:

本基金在本报告期内净值增长率是-0.88%,同期业绩比较基准收益率是0.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年三季度,我们判断经济增速下滑空间有限,通胀水平有回落但幅度不大,而货币政策整体仍将延续前期紧缩的基调,力度不会加码。考虑到紧信贷、去库存带来的工业增速下滑,财政政策可能会更加积极。

我们对债券类资产的配置将保持谨慎,收益率曲线较二季度末略趋于陡峭化,季末因素过后,短端收益率有一定的下行空间,中长端收益率以窄幅波动为主,中长期看收益率中枢仍将逐渐上行。信用产品的供给压力不容忽视,我们将重点关注非城投、非地产类中短期信用产品和溢价率处于历史低位的部分可转债。

我们对权益类资产的配置相对乐观,尽管市场仍有较多的不确定性,能否形成趋势性上升仍有待观察,但在市场整体估值水平不高的情况下,优质公司的投资机会正在出现。我们将自下而上的选择基本面良好、符合国家产业政策的优质公司参与一二级市场的投资。

§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	184,721,019.20	11.80
	其中:股票	184,721,019.20	11.80
2	固定收益投资	1,342,857,854.94	85.75
	其中:债券	1,342,857,854.94	85.75
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	22,574,966.27	1.44
6	其他各项资产	15,854,143.52	1.01
7	合计	1,566,007,983.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	72,614,378.00	5.94
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	23,136,000.00	1.89
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,378,428.00	0.44
C5	电子	10,215,000.00	0.84
C6	金属、非金属	8,856,000.00	0.72
C7	机械、设备、仪表	6,374,000.00	0.52
C8	医药、生物制品	14,264,000.00	1.17
C99	其他制造业	4,390,950.00	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	741,888.00	0.06
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	103,414,753.20	8.46
L	传播与文化产业	7,950,000.00	0.65
M	综合类	-	-
	合计	184,721,019.20	15.11

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	300187	永清环保	1,898,215	103,414,753.20	8.46
2	002572	宁基股份	300,000	23,136,000.00	1.89
3	600085	同仁堂	400,000	14,264,000.00	1.17
4	300223	北京君正	250,000	10,215,000.00	0.84
5	000629	攀钢钒钛	800,000	8,856,000.00	0.72
6	300148	天舟文化	600,000	7,950,000.00	0.65
7	300159	新研股份	200,000	6,374,000.00	0.52
8	300198	纳川股份	194,800	5,378,428.00	0.44
9	002549	凯美特气	150,375	4,390,950.00	0.36
10	002589	瑞康医药	28,800	741,888.00	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	69,670,000.00	5.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	395,558,000.00	32.35
	其中:政策性金融债	395,558,000.00	32.35
4	企业债券	233,908,756.94	19.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	643,721,098.00	52.65
8	其他	-	-
9	合计	1,342,857,854.94	109.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113001	中行转债	3,450,000	364,251,000.00	29.79
2	110202	11国开02	3,100,000	306,125,000.00	25.04
3	110015	石化转债	1,000,000	107,850,000.00	8.82
4	110234	11国开34	900,000	89,433,000.00	7.31
5	113002	工行转债	700,000	82,929,000.00	6.78

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

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

5.8.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	822,762.03
2	应收证券清算款	6,311,897.39
3	应收股利	-
4	应收利息	8,697,432.81
5	应收申购款	22,051.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,854,143.52

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	364,251,000.00	29.79
2	113002	工行转债	82,929,000.00	6.78
3	125709	唐钢转债	53,020,320.00	4.34
4	110003	新钢转债	14,310,933.00	1.17
5	110078	澄星转债	10,716,300.00	0.88
6	110007	博汇转债	10,643,545.00	0.87

5.8.5 报告期末前十名股票中在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	002572	宁基股份	23,136,000.00	1.89	网下新股
2	300223	北京君正	10,215,000.00	0.84	网下新股

5.8.6 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	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
本报告期期初基金份额总额	1,005,206,302.87	277,938,628.15
本报告期基金总申购份额	42,852,380.00	4,580,811.34
减:本报告期基金总赎回份额	81,897,403.45	64,081,619.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	966,161,279.42	218,437,820.33

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的文件。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦15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

7.3 查阅方式

上述备查文件文本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
二〇一一年七月十九日

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月十九日

§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2011年7月15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2011年4月1日起至6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
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月8日
报告期末基金份额总额	64,460,986.92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	本基金的业绩比较基准为: 中证100指数x95%+活期存款利率(税后)x5% 中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股,它流动性高,可投资性强,综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况,其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用,能够作为指数基金的标的指数。 如果中证100指数被停止编制及发布,或中证100指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致中证100指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准;并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准,基金管理人应履行适当程序,报中国证监会核准后予以公告。
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

§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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	438,671.18
2.本期利润	-2,102,245.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0352
4.期末基金资产净值	56,987,280.87
5.期末基金份额净值	0.884

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

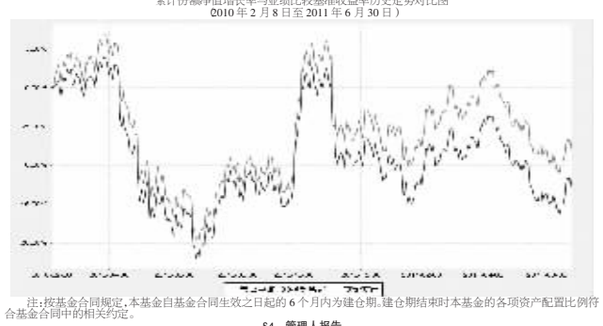
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.02%	1.03%	-4.44%	1.02%	0.42%	0.01%

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

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年2月8日至2011年6月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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		
温胜普	本基金基金经理	2010-2-8	-	5年	温胜普先生,经济学硕士,4年基金从业经历。2006年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任金融工程部风险管理岗,现任宝盈中证100指数增强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。

4.2 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,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,经检查,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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为指数基金,本基金的投资风格与管理人旗下的其他基金和投资组合的风格存在较大差异。由于投资风格的差异,本基金的投资组合业绩与管理人旗下其他组合的投资业绩不具有可比性。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年2季度,稳定物价"仍是政策关注的重点,宏观政策延续了年初以来的基调,继续处于偏紧状态,期间央行3次提高存款准备金率,并于2季度初上调了存贷款基准利率。随着宏观政策紧和效应的加强,市场资金面持续紧张,市场利率水平持续处于高位,在这种状况下,A股市场在2季度呈现震荡向下的走势,期间大小盘风格延续1季度以来的态势,大盘股相对于小盘股有较大幅度的领先。结构而言,食品饮料、煤炭、金融地产等板块整体表现较好;而以TMT为代表的战略新兴产业以及中小板、创业板指数整体表现较弱。报告期内,本基金的股票仓位继续维持在较高位水平,结构上在中证100指数权重的基础上,超配了信息技术、航空、医药、有色金属等行业进行增强型投资。整个2季度看,上证指数收益率为-5.67%,中证100指数收益率为-4.69%,作为以完全复制法为主进行投资的指数增强型基金,本基金2季度的净值跟踪准指数出现了一定幅度的下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是-4.02%,同期业绩比较基准收益率是-4.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年3季度,我们基本维持年初以来的判断,认为宏观经济增速会有所回落但仍将保持较高水平,通胀水平在6、7月份将出现年内高点随后逐步回落,全年处于可控范围;另一方面,3季度整体政策环境仍可能维持偏紧状态,"稳定物价"仍是政策调控关注的重点,但局部领域会进行微调。5月份以后市场对宏观经济及上市公司业绩的担忧过度,导致2季度后半段市场跌幅较大,而一旦上市公司中报业绩好于之前的悲观预期,市场可能会向上修复。目前中小盘股票的整体风险在上半年已有较大程度的释放,市场整体估值水平处于低位区域。综合以上因素,我们认为市场在2011年3季度将震荡筑底并可能出现一定幅度的反弹,大盘股相对于小盘股仍有相对较好的表现,但前期超跌的板块、具有实际业绩支撑的战略新兴产业及消费服务板块值得积极关注。

我们将严格按照基金合同的规定,被动投资为主,适当辅之以增强型投资,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。

§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	52,129,066.96	90.17
	其中:股票	52,129,066.96	90.17
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,078,587.48	5.33
6	其他各项资产	2,601,156.01	4.50
7	合计	57,808,810.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,937,992.50	6.91
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	2,702,992.50	4.74
C6	金属、非金属	1,235,000.00	2.17
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	779,400.00	1.37
H	批发和零售贸易	772,800.00	1.36
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	537,300.00	0.94
M	综合类	-	-
	合计	6,027,492.50	10.58

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	6,036,629.90	10.59
C	制造业	11,094,391.56	19.47
C0	食品、饮料	2,367,506.00	4.15
C1	纺织、服装、皮毛	144,102.00	0.25
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	555,568.50	0.97
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	2,452,835.00	4.30
C7	机械、设备、仪表	5,496,960.06	9.65
C8	医药、生物制品	77,420.00	0.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	938,440.00	1.65
E	建筑业	1,321,230.00	2.32
F	交通运输、仓储业	3,449,534.00	6.05
G	信息技术业	1,035,230.00	1.82
H	批发和零售贸易	704,550.00	1.24
I	金融、保险业	19,257,643.00	33.79
J	房地产业	1,853,273.00	3.25
K	社会服务业	263,403.00	0.46
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	147,250.00	0.26
	合计	46,101,574.46	80.90

5.3 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 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	600036	招商银行	170,000	2,213,400.00	3.88
2	601318	中国平安	42,500	2,051,475.00	3.60
3	600030	中信证券	143,000	1,870,440.00	3.28
4	601166	兴业银行	130,000	1,752,400.00	3.08
5	600016	民生银行	290,000	1,661,700.00	2.92
6	601328	交通银行	270,000	1,495,800.00	2.62
7	600000	浦发银行	150,000	1,476,000.00	2.59
8	601111	中国国航	152,000	1,457,680.00	2.56
9	601398	工商银行	299,650	1,336,439.00	2.35
10	601088	中国神华	38,000	1,145,320.00	2.01

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

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	002179	中航光电	120,133	2,702,992.50	4.74
2	000060	中金岭南	60,000	798,000.00	1.40
3	600498	烽火通信	30,000	779,400.00	1.37
4	002589	瑞康医药	30,000	772,800.00	1.36
5	002238	天威视讯	30,000	537,300.00	0.94

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金所投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,496.12
2	应收证券清算款	492,866.86
3	应收股利	82,425.54
4	应收利息	713.63
5	应收申购款	2,008,653.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,601,156.01

5.8.4 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。

5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中不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。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	58,746,765.25
本报告期基金总申购份额	8,282,636.57
减:本报告期基金总赎回份额	2,568,414.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,460,986.92

§7 备查文件目录

7.1 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合同》。

《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人办公地址:深圳市深南路6008号特区报业大厦1501

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

7.3 查阅方式

上述备查文件文本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
二〇一一年七月十九日

鸿阳证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月十九日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月15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