宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

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：二〇一一年八月二十七日

1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈中证100指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月8日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	64,460,986.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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	孙甦华	尹东
	联系电话	0755-83276688	010-67595003
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	-589,601.14
本期利润	-610,790.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0101
本期基金份额净值增长率	-1.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.1159
期末基金资产净值	56,987,280.87
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。

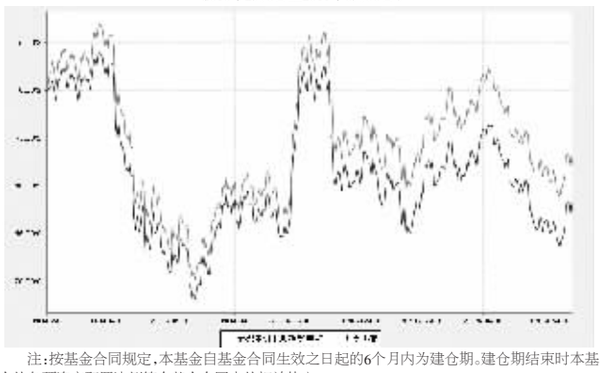
3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.96%	1.13%	0.51%	1.09%	1.45%	0.04%
过去三个月	-4.02%	1.03%	-4.44%	1.02%	0.42%	0.01%
过去六个月	-1.78%	1.15%	-0.41%	1.14%	-1.37%	0.01%
过去一年	11.62%	1.33%	14.53%	1.31%	-2.91%	0.02%
自基金合同生效起至今	-11.60%	1.39%	-6.91%	1.39%	-4.69%	0.00%

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

宝盈中证100指数增强型证券投资基金
份额累计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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001年5月18日成立，注册资本为人民币1亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长、宝盈增强收益、宝盈资源优选、宝盈核心优势、宝盈货币、宝盈中证100九只基金，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）及基金经理助理的简介

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		
温桂普	本基金基金经理	2010-02-08	-	5年	温桂普先生，经济学硕士，5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，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。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 管理人对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年上半年“稳定物价”一直是政策调控的重点，宏观政策持续维持紧缩的基调，期间央行6次提高存款准备金率，并多次上调了存贷款基准利率。上证指数上半年基本以震荡走势为主，4月中旬以前上证指数在金融地产等低估值板块带动下震荡向上，但4月中旬以后随着宏观政策累积效应的加强，市场资金面持续紧张，加上上市公司1季报整体业绩低于预期，使得市场呈现震荡向下的走势。上半年大小盘风格指数表现差异巨大，整体而言，以中证100为代表的大盘股表现较强，而以TMT为代表的战略新兴产业以及中小板、创业板指数表现较弱。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。整个上半年看，上证指数收益率为-1.64%，中证100指数收益率为-0.49%，作为以完全复制法为主进行投资的指数增强型基金，本基金上半年的净值跟随基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

截至本报告期末，本基金的份额净值为0.884元。本报告期本基金的份额净值收益率为-1.78%，业绩比较基准收益率为-0.41%。

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年下半年，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，经济出现“硬着陆”的可能性不大，而通胀水平在6、7月份将出现年内高点并逐步回落，全年处于可控范围；由于6月份CPI创出近年来新高，我们判断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。而如果未来CPI确实出现符合市场预期的回落，宏观政策有望在3季度末4季度初逐步放松。1季报上市公司整体业绩低于预期，令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。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历史低位区域，一旦上市公司中报业绩好于之前的悲观预期，再加上宏观政策在局部领域微调放松，市场可能会向上修复。综合以上因素，我们认为市场在2011年下半年市场将震荡筑底并可能出现较大幅度的反弹，而具备估值优势的大盘股相对于小盘股仍有相对较好的表现，但受益于政策支持、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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值工作小组，估值工作小组由本基金管理人的总经理任小组长，由投资部、研究部、金融工程部、基金事务部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；金融工程部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金事务部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈中证100指数增强型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产：		
银行存款	3,062,905.63	2,945,023.89
结算备付金	15,681.85	139,584.06
存出保证金	16,496.12	8,692.06
交易性金融资产	52,129,066.96	53,010,298.00
其中：股票投资	52,129,066.96	53,010,298.00
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	492,866.86	-
应收利息	713.63	812.35
应收股利	82,425.54	-
应收申购款	2,008,653.86	19,890.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	57,808,810.45	56,124,301.19
负债和所有者权益	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	520,696.43	-
应付赎回款	66,165.91	49,096.49
应付管理人报酬	32,269.20	35,073.31
应付托管费	6,453.81	7,014.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,501.76	102,134.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	183,442.47	50,265.91
负债合计	821,529.58	243,585.04
所有者权益：		
实收基金	64,460,986.92	62,091,079.13
未分配利润	-7,473,706.05	-6,210,362.98
所有者权益合计	56,987,280.87	55,880,716.15
负债和所有者权益总计	57,808,810.45	56,124,301.19

注：本报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.884元，基金份额总额64,460,986.92份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈中证100指数增强型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日
一、收入	-97,983.26	-18,037,631.70
1.利息收入	14,517.04	122,110.03
其中：存款利息收入	14,491.54	121,953.76
债券利息收入	25.50	156.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-106,256.73	1,488,719.13
其中：股票投资收益	-618,871.92	856,798.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,652.50	2,767.03
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	497,962.69	629,153.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-21,189.22	-19,874,691.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	14,945.65	226,230.49
减：二、费用	512,807.10	1,413,655.64
1.管理人报酬	202,387.38	469,899.39
2.托管费	40,477.35	93,979.87
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	77,017.92	706,906.39
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	192,924.45	142,869.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-610,790.36	-19,451,287.34
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-610,790.36	-19,451,287.34

注：本基金合同生效日为2010年2月8日，上年度可比期间为2010年2月8日至2010年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈中证100指数增强型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	62,091,079.13	-6,210,362.98	55,880,716.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-610,790.36	-610,790.36
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）	2,369,907.79	-652,552.71	1,717,355.08
其中：1.基金申购款	16,489,491.30	-1,737,032.59	14,752,458.71
2.基金赎回款	-14,119,583.51	1,084,479.88	-13,035,103.63
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）	64,460,986.92	-7,473,706.05	56,987,280.87
项目	上年度可比期间 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	281,241,387.65	-	281,241,387.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,451,287.34	-19,451,287.34
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）	-174,370,569.89	-2,738,520.19	-177,109,090.08
其中：1.基金申购款	4,143,359.42	-268,562.16	3,874,797.26
2.基金赎回款	-178,513,929.31	-2,469,958.03	-180,983,887.34
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）	106,870,817.76	-22,189,807.53	84,681,010.23

注：本基金合同生效日为2010年2月8日，上年度可比期间为2010年2月8日至2010年6月30日。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：汪钦，主管会计工作负责人：汪钦，会计机构负责人：何瑜

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证100指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2011年6月30日的财务状况以及2011年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本基金本报告期税项未发生变化。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
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、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

本基金合同生效日为2010年2月8日，上年度可比期间为2010年2月8日至2010年6月30日。

6.4.9.2关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	202,387.38	469,899.39
其中：支付销售机构的客户维护费	59,739.47	77,391.02

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

6.4.9.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	40,477.35	93,979.87

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间市场交易。

6.4.9.4各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 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可比报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,062,905.63	13,952.35	5,639,949.04	117,941.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.9.7其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.10 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.10.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000959	首钢股份	2010-10-29	重大资产重组	4.37	-	-	100,000	453,000.00	437,000.00	-
601998	中信银行	2011-06-29	配股发行	4.75	2011-07-07	4.59	30,000	198,724.00	142,500.00	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.11有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

7.2.2 积极资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

7.3 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

7.3.1期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

7.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.byfunds.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	2,636,033.95	4.72
2	600498	烽火通信	1,711,736.00	3.06
3	000060	中金岭南	1,685,993.21	3.02
4	600362	江西铜业	1,595,744.60	2.86
5	000426	富龙热电	1,588,649.00	2.84
6	601111	中国国航	1,463,515.00	2.62
7	600030	中信证券	1,397,048.00	2.50
8	600416	湘电股份	1,219,289.00	2.18
9	601398	工商银行	1,091,500.00	1.95
10	600795	国电电力	787,500.00	1.41
11	002589	瑞康医药	658,678.79	1.18
12	600036	招商银行	640,000.00	1.15
13	000860	顺鑫农业	623,778.40	1.12
14	000983	西