信息披露 Disclosure

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:二〇一二年三月二十八日

§1 重要提示

\$1重要提示
品企管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈达或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性
和京整性非凡列及使用的技术责任。本年度报告上整二分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签复。
是金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金台阅规定,于2012年3月27日复核了本报告中的财务指标。净值表
现、利润分配指数、财务会计程性、投资组合报告等内容。保证复良内容不存在的整定试验、误守性除述或者重大遗漏。
基金管理人外混印域实信用、勤勉尽责的规则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利。
基金管理人外混印域实信用、勤勉尽责的规则需要和运用基金资产。但不保证基金一定盈利。

辦。 本年度报告續要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 普华永道中天会计师事务所有限公司为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。 本报告期目 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

89 基金简介	
82 卷並同 71	
	宝盈增强收益债券
	213007
213007	213907
	契约型开放式
	2008年5月15日
	宝盈基金管理有限公司
	中国建设银行股份有限公司
	964,769,674.51 份
	不定期
宝盈增强收益债券 A/B	宝盈增强收益债券 C
213007 前端)、213907 后端)	213917
867,904,337.01 份	96,865,337.50 份
	\$2 基金简介 213007 室盈增强收益债券 AB 213007 前端),213907 信端)

2.2 基金产品说明	
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特缐、健康增长的项期,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 给增发)申购以 反之领市场联界设立(如的配置)。 ①基于对利率(信用等因素的分析,预测制造收益品种的风险和收益。 ②可转换债券处行公司的成长性和转债价值的判断。 ②选于对制度处行频率、并签率、上市后的平均涨幅等因素的分析,预测新股申购的风险和收益; ④股票市场走势的预测。
业绩比较基准	中信标音会债指数 声望成绩 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社较基准。如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准抽出,或有更科学客观的权重比例适用于本基金时,未基金管理人们依据维护基金的领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定基金管理人和基金托官人协商一致,在履行适当程序后实施,并在更新的招募员明书中列示。
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。

2.3 基金官埋入	、和墨金批官人		
项目	1	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
	姓名	孙胜华	尹东
信息披露负责人	联系电话	0755-83276688	010-67595003
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	yindong.zh@ccb.com
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	•	*

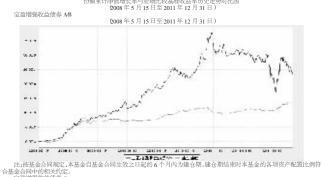
基金年度报告备置地点		基金管理人、基金
A COUNTY A STANDARD CONTRACTOR AND AN AREA FOR	§3 主要财务指标、基金净值表现及	2利润分配情况

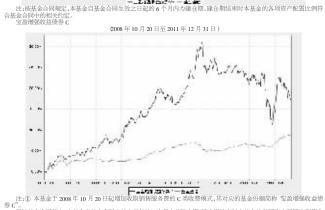
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

	201	1年	2010)年	200	9年
3.1.1 期间数据和指标	宝盈增强收益 债券 A/B	宝盈增强收益 债券 C	宝盈增强收益 债券 AB	宝盈增强收益 债券 C	宝盈增强收益 债券 A/B	宝盈增强收益债 券 C
本期已实现收益	-50,122,758.27	-7,640,364.87	59,387,162.50	8,815,319.29	90,205,243.66	13,293,554.09
本期利润	-56,426,127.52	-19,463,022.35	64,983,826.62	5,258,458.26	64,765,231.58	5,619,820.40
加权平均基金份额本期 利润	-0.0602	-0.0876	0.1051	0.0332	0.0925	0.051
本期基金份额净值增长 率	-5.34%	-5.71%	12.06%	11.62%	9.49%	9.07%
	2011年末		2010	年末	2009	年末
3.1.2 期末数据和指标	宝盈增强收益 债券 A/B	宝盈增强收益 债券 C	宝盈增强收益 债券 AB	宝盈增强收益 债券 C	宝盈增强收益 债券 A/B	宝盈增强收益债 券 C
期末可供分配基金份额 利润	-0.0377	-0.0519	0.0929	0.0821	0.1229	0.1173
期末基金资产净值	871,777,621.44	95,898,829.88	979,866,745.72	558,281,993.86	629,935,339.24	70,712,806.4
期末基金份額净值	1.0045	0.9900	1.1388	1.1277	1.1442	1.138

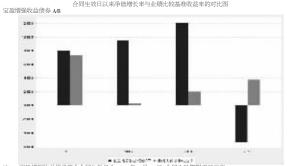
1.1878 1.1277 1.1442 1.13 1. 本期已实现收益指基金本期利组收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益 附蘇相关费用后的余额。 期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 防法基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。 基金价值表现 性表现 分额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

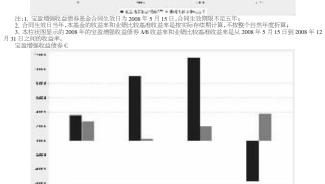
阶段	份额净值增长 率①	份额争值增长 率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	2-4
过去三个月	6.61%	0.74%	2.72%	0.07%	3.89%	0.67%
过去六个月	-2.91%	0.70%	2.43%	0.07%	-5.34%	0.63%
过去一年	-5.34%	0.54%	3.79%	0.06%	-9.13%	0.48%
过去三年	16.15%	0.41%	6.15%	0.06%	10.00%	0.35%
自基金成立起至今	25.48%	0.37%	13.87%	0.08%	11.61%	0.29%
宝盈增强收益债券 C	:	•		•		•
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	6.51%	0.74%	2.72%	0.07%	3.79%	0.67%
过去六个月	-3.09%	0.70%	2.43%	0.07%	-5.52%	0.63%
过去一年	-5.71%	0.54%	3.79%	0.06%	-9.50%	0.48%
过去三年	14.80%	0.41%	6.15%	0.06%	8.65%	0.35%
自基金成立起至今	18.88%	0.39%	8.97%	0.07%	9.91%	0.32%





27 U ②校基金合同规定,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优定。 全合同中的相关约定。
3.2.3 自基金合同生效以来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宝盈增强收益债券型证券投资基金合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





注:1. 宝盈增强收益债券基金合同生效日为 2008 年 5 月 15 日,宝盈增强收益债券 C 始于 2008 年 10 月 20 日,生效期限不足五年; 3.3 过去三年基金的利润分配情况 1、宝盈增强收益债券 A/B

					单位:人戶
年度	毎 10 份基金份额 分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.750	47,420,665.85	23,443,368.84	70,864,034.69	-
2010	1.390	91,207,213.01	39,847,485.78	131,054,698.79	-
2009	0.380	12,458,980.39	9,631,392.90	22,090,373.29	-
合计	2.520	151,086,859.25	72,922,247.52	224,009,106.77	-
2、宝盈均	曾强收益债券 C				单位,人月

2、宝盈堆	曾强收益债券 C			自	位:人民
年度	每 10 份基金份額 分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.750	12,976,404.25	3,264,000.24	16,240,404.49	-
2010	1.390	70,087,242.80	5,407,788.74	75,495,031.54	-
2009	0.380	2,623,738.51	139,270.60	2,763,009.11	-
合计	2.520	85,687,385.56	8,811,059.58	94,498,445.14	-

宝盈增强收益债券型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年 12月 31日

\$4 管理人报告
4.1. 基金管理人及基金经理情况
4.1. 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 法册资本为人民币 1 亿元,往册地在深圳。公司目前管理基金鸡阳、宝盈鸡和败益、宝盈泛沿海、宝盈等路塘块、宝盈塘强败盐、宝盈资源优选、宝盈核心优势、宝盈货币、宝盈中证 100 九 兄基金、公司格予价值投资的投资是,并逐渐形成了稳能,推览的投资成本。公司相与一支总验丰富的投资管理团形,在研究方面、公司来交观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人术,为公司的投资决策提供样等的研究支持,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。以自己的专业和19股为于获得良好业绩,努力为投资者创造丰厚的回报。
4.1.2 基金经理 (截基金经理小组)及基金经理助理的简介

	4.1.2 金並に社 (4.40並に社 750 //(4.40並に)社が注目)同月						
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	PIX			
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	2008-09-02	-	8年	陈若勞, 女,1971年生,香港中文大学金融 粉品,曾在库·向地证券有限代公司固定收 益鄉以事债券投资,研究及交易等工作。2008 住 4 月加、宣都基金管理商股公司任债股 会研究员,期间时担任宣徽货币市场证券投资 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。		

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 2011 年 12 月

4.7 管理人对报注制内基金利润分配情况的说明 末备合同约定。 1由于宝鱼增强收益 AB 表基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分 配收益将有所不明。宝鱼增额收益间一类别内修与基金份额产有简单分配收。 2收益分化更所处生的银行转乘或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额、不足以支付银 行转贩运其他手续费用即,基金金过结赛机与可将收益分衡。 3.本基金份经公允而3.7个则则不进行收益分衡。 3.本基金份经公允而3.7个则则不进行收益分衡。 5.本基金份处分能力所分例明,现金分过至110种投资,投资人可选择现金红利收除息日的基金份额净值自动转为基金份额产 值自动转为基金份额允许可投资。招投资人不选样。本金数以的收益分配力式是现金分红。 6.基金投资到用证现金分别,则不进行收益分衡。 7.基金当即收益的允许可投资。招收资人不选样。本金数以的收益分配力式是现金分红。 6.基金投资到用证现金分别,则不进行收益分衡。 7.基金当即收益的无等补上的于则后,方可进行当即收益分配。 7.基金当即收益的无等补上的于则后,方可进行当即收益分配。 7.基金当即收益的无等补上的于则后,方可进行当即收益分配。 7.基金当即收益的无等补上的于则后,方可进行当即收益分配。 7.基金当即收益的无等补之的一种。2.665、137.19 元、C 类基金份额可供分配利润。5.023、205.44 元、AB 类基金份额价值。2090。元、存金海的资金的资金,在《英基金的额可提入资金》的。2.665、137.19 元、C 类基金子 2011年 6月 2.3 日进行了利润的优化。每10份基金份额分红 0.75 元。 在类型产 2011年 6月 2.3 日进行了利润的优化。每10份基金份额分红 0.75 元。 根据相关法律法据用基金金行的规定的企业,每10份基金份额分红 0.75 元。 根据相关法律法据用基金任营人建则产品在发金类的产品分别。 5.1 程等加入本基金任营人建则产品在发金等的产品的产品分别。 5.2 任营人对提出的本年基金任营及产品,在2016年的公司,在2016年的公司,并2016年的公司,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,并2016年的人,2016年的人

79。报告期内,本基金实施利润分配的金额为 AB 类 70.864.034.69 元,C 类 16.240.404.49 元。
53. 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。
本托管人技作宣子本报告中财场者指标。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。
56. 卖头生母先

7.1 资产负债表 会计主体:宝盈增强收益债券型证券投资基金 报告截止日:2011年12月31日

下	资 产	本期末	上年度末
計字数	237	2011年12月31日	2010年12月31日
1		2 274 000 72	COO 200 010 2
出保证金			
思性金融资产 1,417,465,820.83 1,449,561,793 1,419,561,793 1,5055,380.08 214,404,496 6金投资 1,282,410,440.75 1,235,157,297 产交持证券投资 1,282,410,440.75 1,235,157,297 产交持证券投资 1,283,167,297 1,285,187,297 1,285,1			
中・脱型投資 135,055,380.08 214,404,496 金融投資 1,282,410,440.75 1,235,157,297. 27. 27. 27. 27. 27. 27. 27. 27. 27. 2			
金母校管 1.282.410.440.75 1.235.157.297.			
接受投資		135,055,380.08	214,404,496.9
デュナル デュー デ		-	
排金融资产		1,282,410,440.75	1,235,157,297.
入返権金融資産 10.375.103.64		_	
改正年壽壽蒙 25,679,755.10		-	
取利息 10.375.103.64 6.020.080 201.000 371.273 201.000 371.273 201.000 371.273 201.000 371.273 201.000 371.273 201.000 371.273 201.000 371.273 201.000 2.136.966.541 4.000 2.136.966.541 4.000 2.136.966.541 4.000 2.136.966.541 4.000 2.		-	
渡渡年岡歌 連辞門秘密 1,000,00 371,273 延所門秘密 一 地密声 - 1,503,364,286,04 2,136,966,541 - 2,136,966,541 - 2011年12月31日 2010年12月31日 - 3月 2010年12月31日 2010年12月3	2收证券清算款	25,679,755.10	42,968,186.
次年開放	7收利息	10,375,103.64	6,020,080.
経済得税資产 1.503.364.286.04 2.136.966.541	7收股利	_	
短所得稅壹产	7收申购款	1,000.00	371,273.
接続性 1.503.364.286.04 2.136.966.541 本期末	延所得税资产	_	,
日子 日 1,503,364,286.04 2,136.966.541		_	
### (中の元本)		1 503 364 286 04	2 136 966 541
(情: 2011年12月31日 2010年12月31日 2010年12月31日 1開始			
期情故			2010年 12月 31日
現中金融伝術			
理金融负債		_	
出回戦命議所で数 533,599,605.60 396,399,139 700,000 396,399,139 700,000 396,399,139 700,000 396,399,139 700,000 396,399,139 396,399,139 366,147,17 194,546,446 746		_	
14,811,216 14,811,216 14,811,216 14,811,216 14,811,216 14,811,216 14,811,217 14,546,446 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 165,328,84 166,337,91 198,338,91 198,338,91 198,338,91 199,338,91 198,338,91 1		-	
7月時回歌 366,147.17 194,546,446 1747 194,546,446 1747 194,546,446 1746 1746 1747 194,546,446 1746 1746 1746 1747 1746 1747 1746 1747 1746 1747 1747		533,599,605.60	396,399,139.
71号管班人报酬 495,986.54 780,952 / 村任管费 165,288.84 260,317 / 付销售服务费 33,073.91 198,350 / 付交易费用 62,295.84 6699,038 / 付交易费用 504,612.80 222,288 / 打利息 140,421.95 493,446 / 行利詢 140,421.95 493,446 / 作利翰 320,362.07 496,666 / 储合计 535,687,834.72 598,817,801 / 有者权益; / 改建备 54,769,674.51 1,355,514,754 / 分优利润 2,296,776.81 182,633,985 / 介着 有权益合计 967,676.451,32 1,538,148,739 / 有者权益合计 967,676.451,32 1,538,148,739	z付证券清算款	-	4,811,216.
7月	Z付赎回款	366,147.17	194,546,446.
7付箭催服多费 33.073.91 198.350. 才符交易费用 62.295.84 669.038	Z付管理人报酬	495,986.54	780,952.
1983.502 1983.503 1983.50	7付托管费	165,328.84	260,317.
対交易費用 62.295.84 699.038 た 62.295.84 699.038 699.	7付销售服务费		198,350.
交投费 504.612.80 222,228 打利量 140.421.95 493.446 打利車 140.421.95 493.446 打利車 - - 地方領 320.362.07 496.666 協合计 535.687.834.72 598.817.801 有者权益: 964.769.674.51 1,355.514.75 沙配利両 2.906.776.81 182.63.34 有者权益付 967.66.451.32 1,338.148.739 情和所者者权益付 1.503.364.286.04 2,136.965.286.04 1.503.364.286.04 2,136.965.286.04 2,136.965.286.04			
対判息			
/計判開 鑑斯得股负债 /他负债 320.362.07 496.666 /协合计 535.687,834.72 598,817,801 /有者权益: /%配利间 2.906.776.81 1.355.514,754 /分配利间 2.906.776.81 182.63.36 /有者权益计 967.66.451,32 1.338,148,739 (清和政益计 1.503.364.286.04 2.136.965.			
短所得税负债 320.362.07 496.666 320.362.07 496.666 (信合) 320.362.07 496.666 (信合) 535,687,834.72 598.817,801 信者权益: 984.769.674.51 1,355,514,754 (分配利润 2.906.776.81 182.633.985 (清養权益合) 967.676.451,32 1,538.148.739 (海和所育者权益合) 1,503.364.28604 2,136.965		110,121,55	1,2,110.
抱負債			
(協合计 535,687,834.72 598,817,801		220 262 07	106 666
有者权益。 - 黎基金 964.769.674.51 1,355.514.754 分配利润 2.906.776.81 182.633.985 介者权益计 967.676.451.32 1,538.148.739 (南和所有者权益计 1.503.364.286.04 2,136.965.			
改基金 964,769,674.51 1,355,514,754 分配利間 2,906,776.81 182,633,985 有者权益合计 967,676.451.32 1,538,148,739 (債和所有者权益分 1,303,364,286.04 2,136,966.45		333,087,834.72	398,817,801.
分配利润 2.906.776.81 182.633.985 有者权益合计 967.676.451.32 1.338.148.739 随和所有者权益总计 1.503.364.28604 2.136.965		064 760 674 51	1 255 511 751
有者权益合计 967.676.451.32 1.538.148.739 惯和所有者权益总计 1.503.364.286.04 2.136.966.541			
1,503,364,286.04 2,136,966,541			

	本期	单位:人民币:
项目	平期 2011年1月1日至2011年12	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12
坝日	月31日	月31日
一、收入	-53,212,755.82	84,884,145.35
1.利息收入	28,876,489.89	16,202,064.09
其中:存款利息收入	707,004.29	1,090,009.92
债券利息收入	27,911,636.71	15,055,173.04
资产支持证券利息收入	_	-
买人返售金融资产收入	257,848.89	56,881.13
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以""填列)	-64,204,141.83	65,718,117.65
其中:股票投资收益	5,597,592.16	62,452,452.68
债券投资收益	-70,430,508.82	2,801,285.04
基金投资收益	_	-
资产支持证券投资收益	_	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	628,774.83	464,379.93
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)	-18,126,026.73	2,039,803.09
4.汇兑收益 假失以 ""号填列)	_	-
5.其他收入(损失以""号填列)	240,922.85	924,160.52
咸:二、费用	22,676,394.05	14,641,860.47
1.管理人报酬	7,438,306.20	5,462,203.67
2.托管费	2,479,435.33	1,820,734.57
3.销售服务费	969,660.34	720,462.59
4.交易费用	1,530,193.95	2,746,079.20
5.利息支出	9,839,230.92	3,473,164.11
其中:卖出回购金融资产支出	9,839,230.92	3,473,164.11
6.其他费用	419,567.31	419,216.33
三、利润总额(亏损总额以""号填列)	-75,889,149.87	70,242,284.88
咸:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以""号填列	-75.889.149.87	70,242,284.88

7.3 所有者权益 協金律值 没项表 会计主体:宝盈增强收益债券型证券投资基金 本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日			单位:人民币元	
		本期	, ,	
项目		月1日至2011年12		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
-、期初所有者权益 健金净值)	1,355,514,754.58	182,633,985.00	1,538,148,739.58	
、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利 目)	-	-75,889,149.87	-75,889,149.87	
(本期基金份额交易产生的基金净值变动数 停值 成少以 ""号填列)	-390,745,080.07	-16,733,619.14	-407,478,699.21	
[中:1.基金申购款	486,292,915.71	45,987,188.83	532,280,104.54	
基金赎回款	-877,037,995.78	-62,720,807.97	-939,758,803.75	
 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净 6变动 (争值减少以""号填列) 	-	-87,104,439.18	-87,104,439.18	
、期末所有者权益 健金净值)	964,769,674.51	2,906,776.81	967,676,451.32	
项目	2010年 1	上年度可比期间 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
·、期初所有者权益 ČE金净值)	612,649,934.21	87,998,211.51	700,648,145.72	
、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利 国)	-	70,242,284.88	70,242,284.88	
(本期基金份额交易产生的基金净值变动数 停值 (少以 ""号填列)	742,864,820.37	230,943,218.94	973,808,039.31	
中:1.基金申购款	3,039,335,255.04	603,422,929.74	3,642,758,184.78	
基金赎回款	-2,296,470,434.67	-372,479,710.80	-2,668,950,145.47	
日、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净 直变动(净值减少以""号填列)	-	-206,549,730.33	-206,549,730.33	
L、期末所有者权益 基金 净值)	1,355,514,754.58	182,633,985.00	1,538,148,739.58	

提表附注为财务报表的组成部分 本报告 7.1 至 7.4 则务报表由 下列负责人签署; 基金管理公司负责,大证、主管会计工作负责人、胡坤、会计机构负责人、何瑜 7.4 报表附注 7.4 报表继本情况 1.5 文本 1.5 文本

宏云订核與业分指引入 整료即端欧盆间穿穿阻-苏代安热蒙选鉴咨问 M·叶国证益尝及中的有大规定及冗计的选鉴了业失 控编制。 7-4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金 2011 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 12 月 31 日的财务状况以及 1 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。 7-4.4 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。 7-4.5 差接更正的说明 7-4.5 差接更正的说明 本基金本报告期间无观说明的会计差错更正。

金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。
7.46 税项 国家税券总局标税 2002 128 号 侯于开放式证券投资基金有关税收问题的通知)。财税 2004 78 号 侯于按院基金税收贷的通知。财税 2005 102 号 侯于伊陵法金税收收费的通知。财税 2005 102 号 侯于安陵法金税收收费的通知。财税 2005 102 号 侯于安陵法的人人所得秘度等的补充通知。财税 2005 105 号 侯于金业所得税者干扰惠政策的通知。及其他相关财税法规和实施;主要税则介述下。
1 以及行基金方式募集党金不属于营业股积收费用、否股营业税。
2 据金克莱姆·德尔多维州公东 打造企业股积收费用、否股营业税。
2 据金克莱姆·德尔多维州公东 打造化和公库外域,是全国企业企同基金联设制。20%的个人所得税,暂不征收全。
7 对法金取得的企业债券制度收入,出货行债券的企业企同基金派发税和。红利时营减按 50%计人个人应纳税所得额,现行税处理证明2004代和代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。
4 婚金卖出股票按 0 1%的核单缴纳股票等。

1.4.7 大联月大宗	
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
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
成都工业投资集团有限公司	基金管理人的股东
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。 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易	

7-48 平成市州及工中度。中成州间的大联方交易 7-48.1 通过关联方交易库迁存的交易 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。 7-48.2 关联方报酬 7-48.2 1 基金管理费

本期 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 2010年1月1日至2010年12月31

		H	H		
	当期发生的基金应支付的管理费	7,438,306.20	5,462,203.67		
	其中:支付销售机构的客户维护费	386,130.61	284,756.17		
4	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 0.60%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: 日基金管理人报酬=前一日基金资产净值x0.60%+当年天数 7.48.2.3 基金托管费				
			单位, 人民币元		

	项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的托管费	2,479,435.33	1,820,734.57			
4	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 0.20%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;					

			単位:人民巾			
	20114	本期 手1月1日至2011年12月:	31 ⊟			
获得销售服务费的各关联方名称	当期!	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	宝盈增强收益债券 AB	宝盈增强收益债券 C	合计			
宝盈基金管理有限公司	-	549,410.70	549,410.70			
中国建设银行	-	249,002.01	249,002.01			
合计	-	798,412.71	798,412.71			
	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	宝盈增强收益债券 A/B	宝盈增强收益债券 C	合计			
宝盈基金管理有限公司	-	350,111.87	350,111.87			
中国建设银行	- 203,489.13 203,489.1		203,489.13			
今计	_	553,601.00	553,601.00			

注:(①文付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金价额资产净值 0.40%的年费率计提,逐日累计 方支付给宣基金管理有限公司,再由宣盘基金管理有限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·按前一日基金资产净值x0.40%-34千天数 ② 宝盈增密数益 AB 类基金不收取销售服务费, 7.48.3 与关联方进行银行间同业市场的债券、偿回购)交易

7.4.8.2.3 销售服务费

						单位:人民币元
	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日					
银行间市场交易的 债券交易金额 基金逆回购 基金正回				则均		
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金額	利息支出
中国建设银行			-	-	2,935,280,000.00	811,896.84
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的	债券交	易金额	基金运	白回购	基金正匠	则构
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	20,616,060.68	32,291,333.98	-	-	6,223,120,000.00	1,711,418.57
7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况						

7.48.4 报告期内基金管理、运用固有资金投资本基金的情况 本基金本报告期内基金管理、运用固有资金投资本基金的情况 本基金本报告期外及上年度可比报告期内基金管理人关决。用固有资金投资本基金。 7.48.4 报告期末涨基金管理、之外的其他关张方投资本基金的情况 本基金本报告期末及上年度报告朝末縣基金管理人之外五其他关联方投资本基金。 7.48.5 由关策/解告别有

				单位:人民币元
关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
中国建设银行	3,374,809.72	629,329,018.25	995,321.25	
	了存款由基金托管人中国 承销期内参与关联方承销		利率计息。	

在1:4-海波时採1/将从加速滤灯里入平位脑线球灯床管,次球灯间处小平5/44.6 本基企共营制期外条等大使方案铺座外份信息。 本基金本报告期别及上年度可比期间在新销期内外参与关联方案销证券。 7-4.8.7 其他关键交易事项的创则 本基金本报告期的及上年度可比期间无需披露其他关键交易事项。 7-4.9 期末 包扣 12 月31 日本基金持有的流通受限证券 7-4.9 期末 包期 12 月31 日本基金持有的流通受限证券 本基金本报告期来未持有团的倾脚的公增发证券而流通受限证券。 不基金本报告期来未持有部的停脚等流通受限股票 本基金本报告期来未持有部的停脚等流通受限股票 本基金本报告期来未持有部的停脚医票。 7-4.9.3 期末债券互回购交易中作为抵押的债券 7-4.9.3 1银行即步场争汇回购

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49.599

05.60元,是以如下债券作为抵押:					
				金額单位:人民币	
债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额	
11国开 02	2012-01-05	99.49	200,000	19,898,000.00	
11国开 02	2012-01-06	99.49	200,000	19,898,000.00	
11景兴 CP01	2012-01-06	100.62	100,000	10,062,000.00	
	-	-	500,000	49,858,000.00	
	债券名称 11国开 02 11国开 02 11景兴 CP01	债券名称 回购到期日 11国开 02 2012-01-05 11国开 02 2012-01-06 11景兴 CP01 2012-01-06	備券名称 回喚到期日 期末估值单价 11国开 02 2012-01-05 99.49 11国开 02 2012-01-06 99.49 11景兴 CP01 2012-01-06 100.62	備身名称 回购到期日 期末估值单价 数量 (K) 11国开 02 2012-01-05 99.49 200.000 11国开 02 2012-01-06 99.49 200.000 11景兴 CP01 2012-01-06 100.62 100.000 500.000	

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 载金本报告期末 2011年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 484,000 0000元元子2012年1月6日到期,该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不 年干债叁回购交易的余额。 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

第二层級 直接 化如取目价格 规则报 CLANRARDIOTOTEMEND / 1/2007年39/1/2007 的基人值。 第三层级 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值 (不可观察输入值)。 有) 层层处金融工具公允价值 于 2011 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,327,698,820.83 元,属于 第二层级的金额为 89,767,000.00 元,无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日;第一层级 932,613,793.93 元,第二层级 61 以公允价值所属层以向即重大变动 本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。 有 第三层次公允价值余额和本期变动金额 无。

D 电力、煤气及水的生产

L 传播与文化

8.1 期末基金资产组合情况

			金额单位:人民币
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 6%)
1	权益投资	135,055,380.08	8.98
	其中:股票	135,055,380.08	8.98
2	固定收益投资	1,282,410,440.75	85.30
	其中:债券	1,282,410,440.75	85.30
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	49,192,428.56	3.27
6	其他各项资产	36,706,036.65	2.44
7	合计	1,503,364,286.04	100.00
代码	行业类别	公允价值	金额单位:人民币 占基金资产净值比例 %
A	农、林、牧、海业		-
В	采掘业	_	_
С	制造业	31,230,695.08	3.23
CO	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	1,501,200.00	0.16
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	21,875,495.08	2.26
C8	医药、生物制品	-	-
_	That date o		

8.3 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

					金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比 例 %)
1	300187	永清环保	1,280,000	60,787,200.00	6.28
2	300253	卫宁软件	575,000	24,713,500.00	2.55
3	300260	新莱应材	629,318	15,972,090.84	1.65
4	002230	科大讯飞	300,771	10,526,985.00	1.09
5	002549	凯美特气	300,000	7,854,000.00	0.81
6	002589	瑞康医药	300,000	7,797,000.00	0.81
7	002638	勤上光电	218,969	5,903,404.24	0.61
8	300198	纳川股份	90,000	1,501,200.00	0.16
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动					

8.4.1	累计买人金额超	出期初基金资产净值 2%或	注前 20 名的股票明细	金额单位:人民币
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	歩級半位:八尺川 占期初基金资产净值比 例 ‰)
1	300187	永清环保	102,079,290.03	6.64
2	002233	塔牌集团	27,584,958.49	1.79
3	002572	索菲亚	27,076,882.50	1.76
4	600085	同仁堂	25,423,332.47	1.65
5	002589	瑞康医药	25,236,882.93	1.64
6	300198	纳川股份	22,486,471.82	1.46
7	002559	亚威股份	22,000,000.00	1.43
8	000629	攀钢钒钛	20,075,691.39	1.31
9	300253	卫宁软件	19,192,846.20	1.25
10	600706	ST长信	18,064,214.50	1.17
11	300260	新莱应材	17,820,000.00	1.16
12	300123	太阳鸟	16,894,410.41	1.10
13	300024	机器人	15,334,084.60	1.00
14	002549	凯美特气	14,753,311.15	0.96
15	000430	ST张家界	13,828,502.46	0.90
16	600348	阳泉煤业	13,308,510.45	0.87
17	000731	四川美丰	12,351,859.50	0.80
18	300223	北京君正	10,950,000.00	0.71
19	002230	科大讯飞	9,917,301.31	0.64

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	300187	永清环保	50,394,488.96	3.28
2	002233	塔牌集团	30,303,706.88	1.97
3	300024	机器人	29,460,257.00	1.92
4	002014	永新股份	28,936,210.10	1.88
5	002572	索菲亚	28,615,132.44	1.86
6	600085	同仁堂	26,316,157.90	1.71
7	300152	燃控科技	24,586,941.10	1.60
8	300148	天舟文化	23,190,692.44	1.51
9	300198	纳川股份	22,390,402.64	1.46
10	000629	攀钢钒钛	21,129,906.58	1.37
11	002589	瑞康医药	18,280,965.01	1.19
12	300153	科泰电源	18,254,299.56	1.19
13	300123	太阳鸟	16,394,240.04	1.07
14	002559	亚威股份	16,273,110.14	1.06
15	600706	ST长信	15,942,696.18	1.04
16	300124	汇川技术	15,084,774.51	0.98
17	000821	京山轻机	13,991,554.26	0.91
18	000430	ST张家界	13,964,396.94	0.91
19	600348	阳泉煤业	12,699,371.09	0.83
20	000731	四川美丰	10,137,521.75	0.66
3 主	中 参加鱼汁季巾	众婉" "长赤山 武六众婉	即成次的价重门成次粉景 不老能和关次复费	Ħ

注:表中 本期累计卖出金额"指卖出成交金额,即成交单价乘以成交数量,不考虑相关交易 843至从股票的成本分额及卖油贴票的收入分额

8.4.3 大八以赤印以入心侧又头山以赤印以入心侧	单位:人民币元
买人股票的成本 (成交)总额	480,487,465.16
卖出股票的收入 (成交)总额	544,316,558.58
注:表中 冥人股票成本 戗交)总额"及 实出股票收入 戗 虑相关交易费用。	(交)总额"均指买卖成交金额,即成交单价乘以成交数量,不考

字号	债券品种	公允价值	占基金资产净值b 例 %)
1	国家债券	52,078,000.00	5.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,643,000.00	7.20
	其中:政策性金融债	69,643,000.00	7.20
4	企业债券	476,899,526.00	49.28
5	企业短期融资券	20,124,000.00	2.08
6	中期票据	-	-
7	可转债	663,665,914.75	68.58
8	其他	_	-
9	合计	1,282,410,440.75	132.52

					金额单位:人民币
序号	债券代码	债券名称	数量 胀)	公允价值	占基金资产净值 比例 %)
1	113002	工行转债	2,700,000	287,442,000.00	29.70
2	110015	石化转债	2,800,000	281,428,000.00	29.08
3	126018	08江铜债	1,150,000	96,048,000.00	9.93
4	122092	11大秦 01	925,000	93,591,500.00	9.67
5	126011	08石化债	1,000,000	92,330,000.00	9.54
87 期	末烷公分价估占其	全资产净估比例-	大小排名的前十名资产。	5 持证券投资明细	

8.7 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的基本报告期末未持有资产支持证券。
8.8 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末持有权证。

8.9 投资组合报告附注 8.9.1 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

字号	名称	金額
1	存出保证金	650,177.91
2	应收证券清算款	25,679,755.10
3	应收股利	-
4	应收利息	10,375,103.64
5	应收申购款	1,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,706,036.65

0.2.4 7912	711.HH1XT 145	15391H13 - 14 5135 H132H312H1		金额单位:人民币元
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	113002	工行转债	287,442,000.00	29.70
2	110015	石化转债	281,428,000.00	29.08
3	125731	美丰转债	31,060,200.00	3.21
4	110013	国投转债	14,936,913.00	1.54
5	110003	新钢转债	8,773,600.00	0.91

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

			持有份额	例	持有份额	例
宝盈增强收益债券 A/B	6,140	141,352.50	716,276,620.93	82.53%	151,627,716.08	17.47%
宝盈增强收益债券 C	3,302	29,335.35	10,628,739.49	10.97%	86,236,598.01	89.03%
合计	9,442	102,178.53	726,905,360.42	75.34%	237,864,314.09	24.66%
注:① 本基金采用分级	英式核算,机	构个人投资者持	持有基金份额占总份	额比例的计算	中分母采用各自组	迟别的基金份额
来计算。						

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 () />> /> /> /> /> /> /> () /> /> /> /> /> // ()	项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额比例
★ 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。		宝盈增强收益债券 A/B	57,436.13	0.0066%
6)以公允价值计量的金融工具	基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	宝盈增强收益债券 C	37,583.90	0.0388%
()金融工具公允价值计量的方法 根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为;		合计	95,020.03	0.0098%
第一尺级,相同资产或负债左迁跃市场上,供经调整)的提价	注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总		级基金,比例的分母	1采用各自级别的份
20-7238 TOX FOXING DIVID VARIETY FOXING DIVIDIDENS TO A DESCRIPTION OF THE PROPERTY OF THE PRO	额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计 810-	十数 (利期末基金份额总额)。 F放式基金份额变动		
的输入值。 第二日44、以正列86到60主义数据以外的本是本共加强合约次立式在结份数人在《在开观86数人体》	910	1版文基显历版文明		单位,份

•		单位:伤
项目	宝盈增强收益债券 A/B	宝盈增强收益债券C
基金合同生效日 2008年5月15日)基金份额总额	1,073,777,953.91	-
本报告期期初基金份额总额	860,471,273.67	495,043,480.91
本报告期基金总申购份额	351,309,985.18	134,982,930.53
减:本报告期基金总赎回份额	343,876,921.84	533,161,073.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
★和生物和士士人//86台86	0/2 004 332 01	06 065 227 50

报告期内无基金份額持有人大会决议。
112 基金管理人、基金托管。的专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内本基金管理人、基金托管,的专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内本基金管理人、基金大管、大事支动。
基理 生持工作,其任职资格已经中国建造金库性批准。证监许可 2011 7115 号)解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部副总
经理 生持工作,其任职资格已经中国证金库设并通知用任务工程,但是是是一个企业,是是一个企业,是是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,也是一个企业,是一个企业,也不是一个企业,是一个企业,也不是一个企业,也是一个企业,也不是一个企业,也不是一个企业,也不是一个企业,也不是一个企业,是一

§11 重大事件揭示

当期内,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。

本核音則形,全基實實理、仍據臺環及發展的機關中基並 繁盛管间 尸塊定的投資時時,未及生患者以受。 11.5 为基金进行审计的经过师事务所信息。 标记告期内未发生改聘会计师事务所信息。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所审计费 70,000,00元,目前事务 所已连续3年分本基金提供申证服务。 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员吴稽查或处罚等情况。 在本报告期的、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 基金程用证券公司交易单元的未完任。 11.7 基金程用证券公司交易单元的未完任。

寿 問名杯	量	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	
(江证券	1	145,414,749.86	16.05%	123,601.58	16.67%	-
ド泰联合证券	1	760,697,573.88	83.95%	618,071.69	83.33%	-
7 7 基金和用证券	公司亦易单元讲	行甘他证券投资的情	70			
.7.2 基金租用证券		行其他证券投资的情		· II		单位:人民币:
.7.2 基金租用证券		行其他证券投资的情 全交易 占当期债券	况 回购交	E 易 占当期回购	权证	4.1

| TLU | TL