宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年三月二十六日

§1重要提示

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2013年3月25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。

本年度报告摘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2012年1月1日起至12月31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	88,680,113.63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	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	孙胜华	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	tianqing1.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

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

§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	2012年	2011年	2010年2月8日(基金合同生效日)至2010年12月31日
本期已实现收益	-1,979,902.12	-3,194,950.59	-865,345.88
本期利润	4,938,021.16	-12,342,130.85	-3,940,150.58
加权平均基金份额本期利润	0.0629	-0.1886	-0.0330
本期基金份额净值增长率	8.25%	-20.56%	-10.00%
3.1.2期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2259	-0.2850	-0.1000
期末基金资产净值	68,644,832.99	47,240,096.82	55,880,716.15
期末基金份额净值	0.774	0.715	0.900

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
过去三个月	9.01%	1.16%	11.92%	1.21%	-2.91%	-0.05%
过去六个月	4.31%	1.12%	4.72%	1.14%	-0.41%	-0.02%
过去一年	8.25%	1.13%	10.32%	1.16%	-2.07%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-22.60%	1.27%	-17.18%	1.29%	-5.42%	-0.02%

注: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%

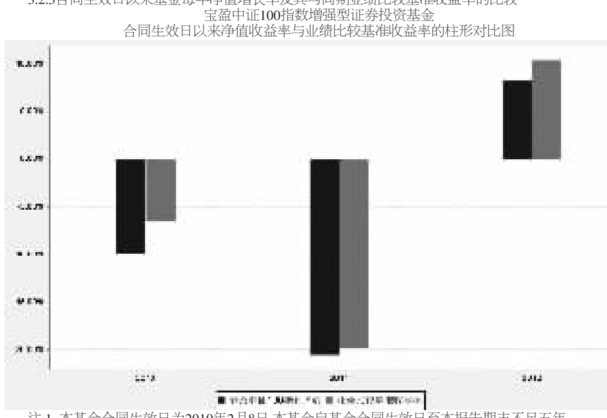
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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2012年12月31日)

注: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。

3.2.3合同生效日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

宝盈中证100指数增强型证券投资基金
合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注:1、本基金合同生效日为2010年2月8日,本基金自基金合同生效日至本报告期末不足五年。

2、本基金合同生效当年,净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较是按照基金合同生效当年实际存续期计算,不按照整个自然年度进行折算。

3、本柱状图显示的2010年的宝盈中证100指数基金的收益率和业绩比较基准收益率是从2010年2月8日到2010年12月31日之间的收益率。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

§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	2010-02-08	-	6年	温胜普先生,经济学硕士。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。
余述胜	本基金基金经理兼宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理	2011-08-17	-	14年	余述胜先生,金融学博士。1998年3月至2007年10月就职于南方基金管理有限公司,历任研究员、投资部副总监、交通运输行业首席分析师。2007年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任投资部副总监、研究部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

注:1.温胜普为首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写;

2.余述胜非首任基金经理,其"任职日期"指根据公司决定确定的聘任日期;

3.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2012年12月31日。

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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年CPI同比涨幅出现先回落后逐步企稳的走势,CPI同比涨幅在2012年10月份达到全年低点,而宏观政策环境逐步宽松,出现结构性松动,央行两次下调存款准备金率和两次下调存贷款基准利率;另一方面,经济增速也出现先回落后逐步企稳的走势,GDP同比增速在2012年三季度达到全年低点。2012年期间,市场关注的重点不断在"憧憬政策放松、预期经济增速见底、担忧国内经济大幅下滑及外围环境不确定"中切换,市场情绪波动较大,这使得A股市场在2012年呈现宽幅震荡走势。行业而言,房地产、券商保险、建筑、家电、医药等板块全年整体表现相对较好,而通信、电力设备、计算机、纺织服装、商贸零售等板块全年整体表现相对较弱;指数方面,中小板综指、创业板综指等小盘指数表现偏弱,而上证50、中证100等大盘蓝筹指数相对较强。报告期,本基金的股票仓位维持在较高水平,结构上在复制中证100指数权重的基础上,适当配置食品饮料、机械制造、煤炭等行业进行增强型投资。整个2012年看,上证指数收益率为3.17%,中证100指数收益率为10.77%,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2012年的净值跟随基准指数出现了一定幅度的上涨。

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8.25%,同期业绩比较基准收益率是10.32%。

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2013年,我们认为宏观经济增速将继续企稳并有所回升,国内经济将延续2012年四季度以来的温和复苏态势,而物价水平上半年仍将在较低水平趋稳,下半年通胀压力将有所加大;另一方面,只要通胀水平没有大幅上升,整体政策环境仍会偏向宽松,继续出现结构性松动的可能性较大,但大幅度放松的可能性较小,经济结构调整是未来经济发展的方向。当前市场整体估值水平仍较低,市场情绪也较为乐观,虽然市场在阶段性上涨后可能出现震荡调整,但只要经济回升力度符合预期,股票供给不大幅增加,市场仍将延续震荡向上的走势。风格上,低估值的大盘股仍有投资机会,而中小盘股将出现分化,部分业绩增速确定、估值合理的中小盘个股值得重点关注,有望取得较大的超额收益。综合以上因素,我们认为市场在2013年仍有望延续震荡向上的走势,并将以结构性行情为主,重点关注符合经济转型方向、具有实际业绩支撑的板块。

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,由投资部、研究部、固定收益部、特定客户资产管理部、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、固定收益部、特定客户资产管理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

本基金2012年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2013)第20145号"标准无保留意见的审计报告",投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	6,915,298.00	2,598,992.80
结算备付金	5,474.90	5,707.79
存出保证金	1,627.51	7,251.12
交易性金融资产	63,289,334.26	44,276,370.15
其中:股票投资	63,289,334.26	44,276,370.15
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	-	207,301.64
应收利息	1,692.77	635.61
应收股利	-	-
应收申购款	135,098.07	255,003.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	70,348,525.51	47,351,262.48
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	1,438,651.14	-
应付赎回款	52,280.40	3,014.41
应付管理人报酬	38,248.49	34,515.16
应付托管费	7,649.70	6,903.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,163.24	12,221.71
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	154,699.55	54,511.34
负债合计	1,703,692.52	111,165.66
所有者权益:		
实收基金	88,680,113.63	66,068,639.59
未分配利润	-20,035,280.64	-18,828,542.77
所有者权益合计	68,644,832.99	47,240,096.82
负债和所有者权益总计	70,348,525.51	47,351,262.48

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.774元,基金份额总额88,680,113.63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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	5,919,261.04	-11,342,994.49
1.利息收入	45,597.57	33,832.55
其中:存款利息收入	45,578.34	33,782.50
债券利息收入	19.23	50.05
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)	-1,079,159.79	-2,265,792.49
其中:股票投资收益	-2,245,705.19	-2,914,739.87
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,352.47	15,395.95
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,157,192.93	633,551.43
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6,917,923.28	-9,147,180.26
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	34,899.98	36,145.71
减:二、费用(以"-"号填列)	981,239.88	999,136.36
1.管理人报酬	433,961.55	414,855.96
2.托管费	86,792.33	82,971.08
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	90,981.20	127,374.65
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	369,504.80	373,934.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,938,021.16	-12,342,130.85
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,938,021.16	-12,342,130.85

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	66,068,639.59	-18,828,542.77	47,240,096.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,938,021.16	4,938,021.16
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)	22,611,474.04	-6,144,759.03	16,466,715.01
其中:1.基金申购款	66,180,185.11	-17,638,276.74	48,541,908.37
2.基金赎回款	-43,568,711.07	11,493,517.71	-32,075,193.36
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)	88,680,113.63	-20,035,280.64	68,644,832.99

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	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)	-	-12,342,130.85	-12,342,130.85
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)	3,977,560.46	-276,048.94	3,701,511.52
其中:1.基金申购款	41,021,425.44	-6,485,912.23	34,535,513.21
2.基金赎回款	-37,043,864.98	6,209,863.29	-30,834,001.69
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)	66,068,639.59	-18,828,542.77	47,240,096.82

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:

基金管理公司负责人:汪钦,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

7.4.1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 X 95%+银行活期存款利率(税后) X 5%。

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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012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2012年12月31日的财务状况以及2012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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(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,股权的股息、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,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。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税。

(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。

7.4.7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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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
中国对外经济贸易信托有限公司	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

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	433,961.55	414,855.96
其中:支付销售机构的客户维护费	124,781.76	120,504.41

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	86,792.33	82,971.08

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。

7.4.8.3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同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1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。

7.4.8.4.2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期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	6,915,298.00	44,392.67	2,598,992.80	32,698.61

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。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无需披露其他关联交易事项。

7.4.9期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1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。

7.4.9.2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
000527	美的电器	2012-08-27	重大资产重组	9.69	-	-	30,000	467,994.58	290,700.00	-
601618	中国中冶	2012-12-28	重大资产重组	2.26	2013-01-04	2.33	80,000	279,223.96	180,800.00	-
000002	万科A	2012-12-26	B股转H股	10.12	2013-01-21	11.13	160,000	1,398,234.48	1,619,200.00	-

注:本基金截至2012年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1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。

7.4.9.3.2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。

7.4.10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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)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:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

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)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2012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级的余额为61,198,634.26元,属于第二层级的余额为2,090,700.00元,无属于第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级44,276,370.15元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

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,本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;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级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,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	63,289,334.26	89.97
	其中:股票	63,289,334.26	89.97
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	6,920,772.90	9.84
6	其他各项资产	138,418.35	0.20
7	合计	70,348,525.51	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1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	102,240.00	0.15
B	采掘业	6,574,717.10	9.58
C	制造业	13,720,667.00	19.99
C0	食品、饮料	3,721,881.00	5.42
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	830,100.00	1.21
C5	电子	155,550.00	0.23
C6	金属、非金属	3,221,707.00	4.69
C7	机械、设备、仪表	5,181,249.00	7.55
C8	医药、生物制品	585,760.00	0.85
C99	其他制造业	24,420.00	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,567,080.00	2.28
E	建筑业	2,030,700.00	2.96
F	交通运输、仓储业	1,547,368.00	2.25
G	信息技术业	915,000.00	1.33
H	批发和零售贸易	492,100.00	0.72
I	金融、保险业	26,345,130.00	38.38
J	房地产业	3,188,440.00	4.64
K	社会服务业	463,500.00	0.68
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	56,946,942.10	82.96

8.2.2积极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	1,014,500.00	1.48
C	制造业	4,693,042.16	6.84
C0	食品、饮料	2,779,692.46	4.05
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,612,349.70	2.35
C8	医药、生物制品	301,000.00	0.44
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	106,000.00	0.15
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	240,450.00	0.35
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	288,400.00	0.42
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,342,392.16	9.24

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	206,000	2,832,500.00	4.13
2	600016	民生银行	350,000	2,751,000.00	4.01
3	601318	中国平安	56,000	2,536,240.00	3.69
4	601166	兴业银行	120,000	2,002,800.00	2.92
5	601328	交通银行	390,000	1,926,600.00	2.81
6	600000	浦发银行	185,000	1,835,200.00	2.67
7	000002	万科A	160,000	1,619,200.00	2.36
8	601398	工商银行	384,650	1,596,297.50	2.33
9	600030	中信证券	110,000	1,469,600.00	2.14
10	600519	贵州茅台	6,900	1,442,238.00	2.10

注:投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.byfunds.com网站的年度报告正文。

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	600059	古越龙山	197,213	2,252,172.46	3.28
2	002698	博实股份	110,058	1,612,349.70	2.35
3	600123	兰花科创	50,000	1,014,500.00	1.48
4	600887	伊利股份	24,000	527,520.00	0.77
5	600276	恒瑞医药	10,000	301,000.00	0.44

注:投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细,应阅读登载于宝盈基金管理有限公司http://www.byfunds.com网站的年度报告正文。

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	600059	古越龙山	5,676,973.22	12.02
2	601117	中国化学	5,297,700.00	11.21
3	000988	华工科技	3,309,680.00	7.01
4	600123	兰花科创	2,619,683.00	5.55
5	600547	山东黄金	1,871,022.00	3.96
6	002698	博实股份	1,686,728.95	3.57
7	601989	中国重工	1,330,500.00	2.82
8	601328	交通银行	721,850.00	1.53
9	601288	农业银行	618,500.00	1.31
10	600036	招商银行	574,400.00	1.22
11	601318	中国平安	523,108.00	1.11
12	600887	伊利股份	520,205.00	1.10
13	600015	华夏银行	515,830.00	1.09
14	000629	攀钢钒钛	504,600.00	1.07
15	601818	光大银行	444,400.00	0.94
16	601166	兴业银行	418,000.00	0.88
17	600519	贵州茅台	398,300.00	0.84
18	600016	民生银行	392,800.00	0.83
19	000568	泸州老窖	383,294.93	0.81
20	600011	华能国际	381,100.00	0.81

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	601117	中国化学	4,888,160.48	10.35
2	600059	古越龙山	3,537,933.97	7.49
3	000988	华工科技	3,183,484.00	6.74
4	600547	山东黄金	1,769,034.40	3.74
5	600123	兰花科创	1,433,719.76	3.03
6	601989	中国重工	1,321,660.00	2.80
7	002589	瑞康医药	895,284.60	1.90
8	600559	老白干酒	861,984.00	1.82
9	002549	凯美特气	637,706.00	1.35
10	600030	中信证券	436,900.00	0.92
11	600036	招商银行	424,500.00	0.90
12	600309	烟台万华	398,200.00	0.84
13	600016	民生银行	300,000.00	0.64
14	601166	兴业银行	258,500.00	0.55
15	000776	广发证券	254,220.00	0.54
16	600000	浦发银行	229,650.00	0.49
17	600048	保利地产	224,000.00	0.47
18	600015	华夏银行	217,250.00	0.46
19	601009	南京银行	192,800.00	0.41
20	000538	云南白药	183,600.00	0.39

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

买入股票的成本(成交)总额	39,157,179.13
卖出股票的收入(成交)总额	24,816,433.11

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6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。

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投资明细

本基金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

本基金本报告期末未持有权证。

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责、处罚。

8.9.2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。

8.9.3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	1,627.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,692.77
5	应收申购款	135,098.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,418.35

8.9.4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。

8.9.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000002	万科A	1,619,200.00	2.36	B股转H股

8.9.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.9.6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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,953	22,433.62	19,894,531.37	22.43%	68,785,582.26	77.57%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,411,143.42	1.5913%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为:50万份至100万份(含);

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为:0至10万份(含)。

§10开放式基金份额变动

单位:份

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	66,068,639.59
本报告期基金总申购份额	66,180,185.11
减:本报告期基金总赎回份额	43,568,711.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,680,113.63

§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

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2012年11月15日,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2012]961号)。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2012]1036号)。

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审计费50,000元,目前事务所已连续4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	48,346,562.96	75.63%	42,438.36	76.61%	-
华泰证券	1	15,577,414.28	24.37%	12,953.39	23.39%	-

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		回购交易		权证交易		其它	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	126,371.70	100.00%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单独指股票交易佣金。

2、本基金本报告期未租用和退租交易单元。

§12影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日,根据工作需要,中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

宝盈基金管理有限公司
二〇一三年三月二十六日