

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014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
送出日期:2014年8月28日

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法律责任。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告等,保证基金管理人不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的投资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先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。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2014年1月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金投资组合. Details include fund name, codes, and asset allocation.

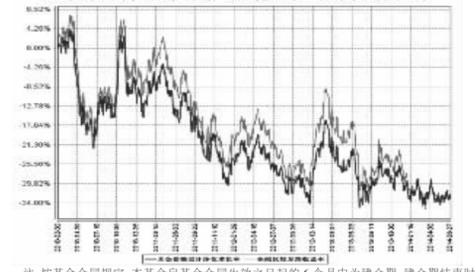
2.1 基金基本情况
基金名称:宝盈中证100指数增强型证券投资基金
基金代码:213010
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Lists names and contact information for management and custody.

2.2 基金业绩表现
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本基金资产的80%。
截至2014年6月30日,本基金资产净值为人民币1,428,281,688.24元。

Table with 2 columns: 主要财务指标和基金净值表现. Shows performance metrics and net asset value trends.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要会计数据和财务指标
3.1.2 基金净值表现
3.1.3 基金业绩比较基准



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起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规定。

3.2 基金管理人及基金经理情况
3.2.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.2.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists the names and roles of the fund manager and other key personnel.

注:1. 基金经理为聘任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写;
2. 陈小仁曾任基金经理,其“任职日期”指根据公司公告确定的聘任日期;
3. 证券从业的年限遵从行业协会《证券投资基金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2014年6月30日。

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
4.1.2 基金经理情况

4.2 基金业绩表现
截至本报告期末,本基金的份额净值为0.679元,本基金在本报告期内净值增长率为-3.82%,同期业绩比较基准收益率为-7.11%。

4.3 基金管理人及基金经理情况
4.3.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.3.2 基金经理情况

4.4 基金管理人及基金经理情况
4.4.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.4.2 基金经理情况

4.5 基金管理人及基金经理情况
4.5.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.5.2 基金经理情况

4.6 基金管理人及基金经理情况
4.6.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.6.2 基金经理情况

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订的与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
4.8 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
4.9 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

Table with 2 columns: 资产, 负债. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.1 资产负债表
6.2 利润表
6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the income statement and equity changes for the fund.

6.4 基金管理人及基金经理情况
6.4.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.4.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.5 所有者权益(基金净值)变动表
6.6 基金管理人及基金经理情况
6.6.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.6.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.7 基金管理人及基金经理情况
6.7.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.7.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.8 基金管理人及基金经理情况
6.8.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.8.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.9 基金管理人及基金经理情况
6.9.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.9.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.10 基金管理人及基金经理情况
6.10.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.10.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the balance sheet for the fund as of June 30, 2014.

6.11 基金管理人及基金经理情况
6.11.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.11.2 基金经理情况

在1个月以内(含1个月),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,暂减按25%计入应纳税所得额。
(4)基金卖出股票按20%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。

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 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
6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

注:支付基金托管人中国建设银行股份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。
6.4.8.2.1 基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

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。
6.4.8.2.2 基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

6.4.8.4 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
6.4.8.5 关联方为保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。
6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销的情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

6.4.9.1 银行间市场债券正回购
6.4.9.2 交易所市场债券正回购
6.4.9.3 交易所市场债券正回购交易余额

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

6.5 基金管理人及基金经理情况
6.5.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.5.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

6.6 基金管理人及基金经理情况
6.6.1 基金管理人及其管理基金的经验
6.6.2 基金经理情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows the management fees and other expenses for the fund.

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

注:1.买入包括基金二级市场主动的买入、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(成交净额乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.2 买入金额按买卖成交金额(成交净额乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

注:1.卖出主要指二级市场主动的卖出、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(成交净额乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:1.买入股票成本(成交总额)和卖出股票收入(成交)总额,均按买卖成交金额(成交净额乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.6 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
7.7 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资产支持证券投资明细
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.9 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
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
7.10.3 本基金股指期货的投资政策
7.10.4 本基金股指期货的投资政策
7.10.5 本基金股指期货的投资政策
7.10.6 本基金股指期货的投资政策
7.10.7 本基金股指期货的投资政策
7.10.8 本基金股指期货的投资政策
7.10.9 本基金股指期货的投资政策
7.10.10 本基金股指期货的投资政策