宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:2015年1月21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2015年1月20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2014年10月1日起至12月31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	320,639,832.08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	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。
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

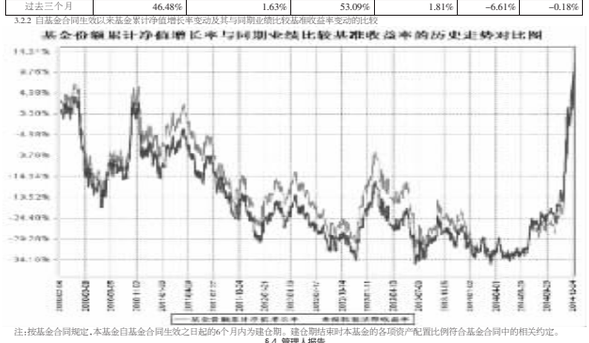
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	3,976,777.87
2.本期利润	52,318,508.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.4142
4.期末基金资产净值	359,912,418.96
5.期末基金份额净值	1.122

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	46.48%	1.63%	53.09%	1.81%	-6.61%	-0.18%

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



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年2月8日	-	8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。

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 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,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。
4.3.2 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
在"一路一带"去产能、部分城市房地产销量回暖预期下,市场提升了对未来经济回升的预期,加上经济自2011年开始连续三年趋势性下降后,过剩产能有一定程度的自然出清,也逐步提高了供给收缩带来的经营好转。但预计经济整体仍然难有出彩的表现,这些局部的积极迹象还不足于扭转大的趋势。经济转型仍是长期共识,长期关注点也主要在改革的落实和受益于经济调结构的品种。整个四季度市场风格剧烈转变,尤其最后两个月,以大盘蓝筹为代表的称动的指数如上证50大涨55.77%,以小票为代表的创业板指指则下跌5.47%。本基金在四季度,及时调整结构,重点加仓了金融板块,表现良好。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
宝盈核心优势混合A:本基金在本报告期内净值增长率是28.12%,同期业绩比较基准收益率是27.78%。
宝盈核心优势混合C:本基金在本报告期内净值增长率是27.87%,同期业绩比较基准收益率是27.75%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望未来,市场预计仍然比较活跃。一方面,资金宽松持续,成本的趋势性下降基本确立,这是高层经济政策方面的重要目标;另一方面,居民资产配置的再分配还有比较大的空间,2013-2014连续两年权益市场的回报率优于其它资产;最后,政策层面对股市的发展仍然比较有利。但在大盘蓝筹股暴涨后,更需要防备分析,急剧超涨大票的戛然熊市可能已经过去,而且如果没能继续展现出良好的净利润效应,部分蓝筹股的资金可能会逐步退出,新增资金的步伐也会放缓。总体上,指数依然有上涨空间,但可能进入相对稳健的阶段。当然,我们投资的是企业,而不是经济前景和市场风格,挖掘真正具有长期成长空间的优秀企业,仍是主要的任务。重点关注的行业包括两大部分,一是超级大白马,在估值、分红、政策趋势等方面占优势的领域;二是具有爆发力成长前景的小票,主要是互联网、先进制造。
我们将严格按照基金合同的规定,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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	284,611,713.40	73.33
	其中:股票	284,611,713.40	73.33
2	固定收益投资	10,149,531.00	2.62
	其中:债券	10,149,531.00	2.62
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,224,179.18	3.92
7	其他资产	78,127,731.16	20.13
8	合计	388,113,154.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末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	采矿业	12,464,179.00	3.46
C	制造业	68,275,700.40	18.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,715,029.00	2.14
E	建筑业	14,320,337.00	3.98
F	批发和零售业	2,152,800.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	6,307,318.00	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,064,326.00	1.41
J	金融业	150,591,954.00	41.84
K	房地产业	15,198,975.00	4.22
L	租赁和商务服务业	883,560.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,576,575.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	284,550,753.40	79.06

5.2.2 报告期末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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	60,960.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,960.00	0.02

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
5.2.3 报告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	601318	中国平安	277,200	20,709,612.00	5.75
2	600016	民生银行	1,468,500	15,977,280.00	4.44
3	600036	招商银行	935,000	15,511,650.00	4.31
4	600030	中信证券	386,700	13,109,130.00	3.64
5	600837	海通证券	376,400	9,056,184.00	2.52
6	601166	兴业银行	547,300	9,030,450.00	2.51
7	600000	浦发银行	538,000	8,441,220.00	2.35
8	000002	万 科A	560,100	7,785,390.00	2.16
9	601328	交通银行	796,600	5,416,880.00	1.51
10	601288	农业银行	1,436,000	5,327,560.00	1.48

5.2.4 报告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	002736	国信证券	6,000	60,960.00	0.02

5.3 报告期末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	10,149,531.00	2.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,149,531.00	2.82

5.4 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	019414	14国债14	100,900	10,149,531.00	2.82

5.5 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。
5.6 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.7 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和揽品明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除中国平安外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。
2014年12月8日,中国证券会发布《中国证监会行政处罚决定书》([2014]103号),因海联讯科技股份有限公司(以下简称"海联讯")上市项目,对平安证券给予警告,没收其海联讯科技股份有限公司发行上市项目中的保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2,867万元,并处以440万元罚款。平安证券为中国平安控股子公司。中国平安为本基金的指数成分股,本基金管理人基本按照其成分股所占的权重进行相应配置,符合相关法规和基金投资策略的要求。
5.10.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,235.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	180,590.04
5	应收申购款	77,935,905.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,127,731.16

5.10.4 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。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中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。
5.10.5.2 报告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。
5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	60,345,382.42
报告期期间基金总申购份额	554,155,955.59
减:报告期期间基金总赎回份额	293,861,505.93
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	320,639,832.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,870,659.08
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,870,659.08
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.14

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 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基金合同》。
《宝盈中证100指数增强型证券投资基金托管协议》。
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。
9.2 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
9.3 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
2015年1月21日

宝盈货币市场证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:2015年1月21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2015年1月20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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈货币	
基金主代码	213009	
交易代码	213009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年8月5日	
报告期末基金份额总额	8,838,832,902.45份	
投资目标	在保持低风险与高流动性的基础上,追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金运用利率预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略等积极的投资策略相结合,对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略考虑各类资产的风险性、流动性及收益性特征,把风险控制在预算之内,在不增加风险的基础上保持高流动性,最终追求稳定的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
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	宝盈货币A	宝盈货币B
下属两级基金的交易代码	213009	213909
报告期末下属两级基金的份额总额	3,245,468,617.83份	5,593,364,284.62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(2014年10月1日 - 2014年12月31日)	
	宝盈货币A	宝盈货币B
1. 本期已实现收益	26,123,287.56	84,766,462.66
2.本期利润	26,123,287.56	84,766,462.66
3.期末基金资产净值	3,245,468,617.83	5,593,364,284.62

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,本基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3.本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈货币A

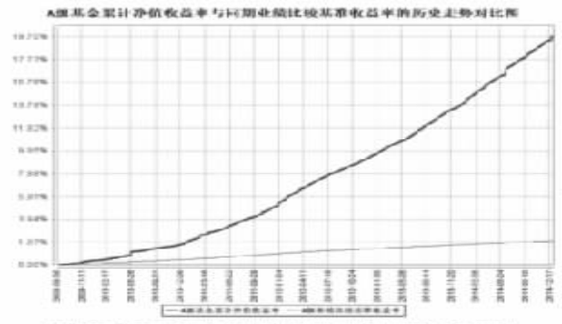
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1596%	0.0163%	0.0882%	0.0000%	1.0714%	0.0163%

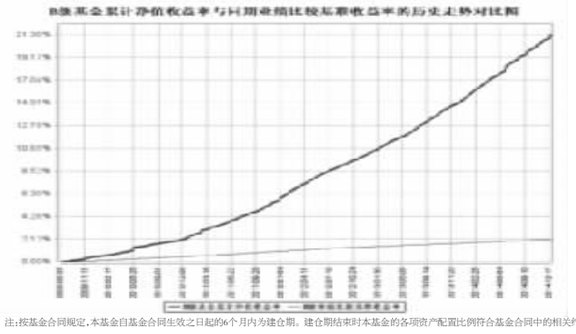
注:本基金收益分配按日结转份额。

宝盈货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2208%	0.0163%	0.0882%	0.0000%	1.1326%	0.0163%

注:本基金收益分配按日结转份额。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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		
陈若劭	本基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈新趋势股票型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2009年8月5日	-	11年	陈若劭女士,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、研发及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
于启明	本基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理	2012年7月6日	-	7年	于启明先生,经济学学士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任投研秘书(集中交易员)及债券组合研究员。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 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,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,在投资管理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 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
报告期内,债券市场表现先松尾,10月走势延续三季度末的乐观情绪,各券种收益率基本都创出年内新低。11月以后资金面逐渐趋紧,尽管其间央行降息并下调公开市场正回购操作利率,但市场人气低迷,收益率以上行为主,短端品种甚至一度直接跌至年初水平,银行同业存款利率也一度上升到7%以上水平。
报告期内,我们操作较为谨慎,基本维持偏低的组合久期,在临近季末时,适当拉长组合久期并适当提高浮息债券的配置。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
货币A:
本基金在本报告期内净值收益率是 1.1596%,同期业绩比较基准收益率是 0.0882%。
货币B:
本基金在本报告期内净值收益率是 1.2208%,同期业绩比较基准收益率是 0.0882%。
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2015年一季度,我们判断保增长压力下宽松政策仍将延续,但是受税票市场和房地产市场双双回暖的影响,力度可能低于市场预期。如果房地产市场回暖能够持续,则一季度可能形成经济增长和通货膨胀的一个阶段性低点并在一季度后期开始有企稳回升迹象。
货币市场方面,我们维持谨慎的态度。我们认为随着利率市场化进程的深入,银行体系资金使用效率不断提高,富余资金量的减少将使得资金成本中枢显著高于以往。如果央行不采取激烈的货币宽松政策,则资金成本进一步大幅下降的可能性较低。在时间上,春节因素将对资金面产生强烈的扰动,预计节后资金面会阶段性相对紧松。
我们在整体维持谨慎态度的前提下,寻找新股发行、春节等资金需求旺盛的时段择机调整投资组合,把握市场收益率上行带来的投资机会。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	固定收益投资	6,831,875,801.75	67.86
	其中:债券	6,831,875,801.75	67.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	673,893,250.84	6.69
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,414,177,304.36	23.98
4	其他资产	146,939,760.94	1.46
5	合计	10,066,886,117.89	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		13.86
	其中:买断式回购融资		0.00
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,214,697,097.95	13.74
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2014年11月25日	32.76	大额赎回	2014年11月28日
2	2014年11月26日	37.81	大额赎回	2014年11月28日
3	2014年11月27日	36.64	大额赎回	2014年11月28日

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	83

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金《基金合同》中关于投资组合限制的约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",且本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天的情况。
5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	31.59	13.74
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.23	-
2	30天(含)-60天	15.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.96	-
3	60天(含)-90天	16.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.23	-
4	90天(含)-180天	37.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	11.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		112.23	13.74

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,388,440,980.12	15.71
	其中:政策性金融债	1,388,440,980.12	15.71
4	企业债券	269,402,535.93	3.05
5	企业短期融资券	4,293,662,953.51	48.58
6	中期票据	880,369,332.19	9.96
7	其他	-	-
8	合计	6,831,875,801.75	77.29
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,009,234,911.04	11.42

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1082087	10中石油MTN1	4,000,000	400,748,724.05	4.53
2	011422003	14神华SCP003	4,000,000	399,884,814.51	4.52
3	1082099	10中油股MTN3	3,000,000	300,159,813.81	3.40
4	041451059	14水钢CP001	3,000,000	299,879,249.67	3.39
5	011420007	14中铝SCP007	3,000,000	299,847,820.76	3.39
6	100236	10国开36	2,800,000	279,166,066.50	3.16
7	041458049	14中铝业CP003	2,600,000	260,998,187.59	2.95
8	011489002	14鞍钢股SCP002	2,300,000	230,780,132.01	2.61
9	0980147	09中航工债浮	2,000,000	204,485,579.53	2.31
10	041453047	14跃钢CP001	2,000,000	201,506,154.41	2.28

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	21
报告期内偏离度的最高值	0.3171%
报告期内偏离度的最低值	-0.0623%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1843%

5.7 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。
5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金估值采用"摊余成本法"计价,即估值对象以买入或本列示,按照票面利率或协定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损益。
5.8.2 本报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。
5.8.3 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。
5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	133,570,480.50
4	应收申购款	12,794,757.45
5	其他应收款	574,522.99
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	146,939,760.94

5.8.5 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	宝盈货币A	宝盈货币B
报告期期初基金份额总额	2,730,599,668.48	5,389,830,286.69
报告期期间基金总申购份额	10,849,470,944.88	11,713,540,521.96
减:报告期期间基金总赎回份额	10,334,601,995.53	11,510,006,524.03
报