

## 宝盈中证100指数增强型证券投资基金

## 2015第三季度报告

2015年9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:2015年10月26日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人的董事长及其董事对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告出自财务资料未经审计。

报告期末至报告期截止日止:

§ 2 基金产品概况

基金简称 宝盈中证100指数增强

基金代码 213000

交易代码 213000

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2010年7月3日

报告期末基金份额总额 94,369,788.59份

投资目标 在基金合同约定的范围内,通过严格的择时和行业轮动策略以及合理的资产配置手段,结合宏观环境、政策因素、行业景气度、估值水平等多方面的分析,力争实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金将综合运用量化分析方法,结合宏观经济的走势及宏观政策的变化进行行业配置,通过行业轮动策略,在不同行业之间进行资产配置,同时根据宏观经济形势变化,适时调整资产配置比例,相对估值定价策略,采用市场公认的定价模型,选择具有估值优势的股票进行投资。

业绩比较基准 中证100指数×65%+银行存款利率(税后)×35%

风险收益特征 本基金为股票型基金,风险收益特征与股票型基金相似。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 4,924,032.77

2.本期利润 -46,560,129.33

3.期末基金资产净值 96,931,678.05

4.期末基金份额净值 0.9664

注:1.本期已实现收益指基金本期收入扣除基金费用后的余额。

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.所述基金净值是指不包括有认购或申购交易费用,计费用后实际收益水平将低于所列数字。

4.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

5.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 4,924,032.77

2.本期利润 -46,560,129.33

3.期末基金资产净值 96,931,678.05

4.期末基金份额净值 0.9664

注:1.本期已实现收益指基金本期收入扣除基金费用后的余额。

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.所述基金净值是指不包括有认购或申购交易费用,计费用后实际收益水平将低于所列数字。

4.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

5.2 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准净值涨跌幅的比较

序号 评估期间 评估名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 2006/1/18-2006/6/30 中国银行 160,190 4,783,723.40 5.26

2 2006/6/30-2006/12/31 招商银行 235,400 4,591,918.00 4.95

3 2006/12/31-2007/6/30 中信银行 434,000 3,667,000.00 4.03

4 2007/6/30-2007/12/31 交通银行 160,000 2,420,000.00 3.11

5 2007/12/31-2008/6/30 光大银行 2,520,000.00 2.75

6 2008/6/30-2008/12/31 工商银行 424,000 1,815,000.00 2.03

7 2008/12/31-2009/6/30 五矿发展 143,200 1,821,000.00 2.01

8 2009/6/30-2009/12/31 交通银行 295,600 1,702,000.00 1.98

9 2009/12/31-2010/6/30 中信银行 134,000 1,737,000.00 1.91

10 2010/6/30-2010/12/31 中信证券 116,300 1,579,354.00 1.74

5.3.2 评估期间和报告评估公允价值占基金净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 评估期间 投资品种 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 2012/7/1-2012/12/31 航天信息 299,999 3,884,587.05 4.27

2 2012/12/31-2013/6/30 高新稍物 89,800 880,040.00 0.97

3 2013/6/30-2013/12/31 中国软件 17,700 400,020.00 0.44

5.4 基金净值历史走势图与业绩比较基准净值的历史走势图

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。

§ 5 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(基金经理助理) 从事业务年限 说明

赵晓龙 基金经理 2015年7月10日 - 2005年8月至2011年5月,在长城基金管理有限公司担任基金经理助理;2011年5月至2012年1月,在国海富兰克林基金管理有限公司担任基金经理助理;2012年1月至2013年1月,在国海富兰克林基金管理有限公司担任基金经理;2013年1月至今,在宝盈基金管理有限公司担任基金经理。

黄英 基金经理助理 2015年9月27日 - 2012年7月加入宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理;2013年1月加入宝盈基金管理有限公司担任基金经理。

§ 6 公司基本情况

4.1 平安易利基金管理有限公司

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公开交易制度指引》及《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.2 基金管理人和基金托管人

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.3 基金销售机构

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.4 基金登记机构

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.5 基金份额登记机构

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.6 基金销售服务

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.7 基金份额持有人

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.8 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.9 基金管理人和基金托管人

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.10 基金份额持有人

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.11 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.12 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.13 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.14 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.15 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.16 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.17 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.18 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.19 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.20 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.21 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.22 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.23 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.24 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.25 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.26 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.27 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.28 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.29 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理有限公司公司公平交易制度》的规定,对本基金的公平交易行为进行监督。

4.30 其他

基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《平安易利基金管理