# 宝盈增强收益债券型证券投资基金

## 2019 第二季度 报告

2019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
报告送出日期:2019年7月18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2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 宝盈增强收益债券 | |
| 基金主代码 | 213007 | |
| 交易代码 | 213007 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年5月15日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 38,242,480.88份 | |
| 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持续、健康增长的预期,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(含增发)申购以及二级市场股票投资之间的配置:<br>①基于对利率、信用等因素的分析,预测固定收益品种的风险和收益;<br>②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断;<br>③基于对新股发行规模、中签率、上市后的平均盈亏等因素的分析,预测新股申购的风险和收益;<br>④股票市场走势的预测。 | |
| 业绩比较基准 | 中证综合债券指数 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 宝盈增强收益债券A/B | 宝盈增强收益债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 213007 | 213917 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 213007 | – |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 213907 | – |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 25,441,636.89份 | 12,800,843.99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(2019年4月1日－2019年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 宝盈增强收益债券A/B | 宝盈增强收益债券C |
| 1.本期已实现收益 | −2,304,710.70 | −608,088.68 |
| 2.本期利润 | −3,004,473.06 | −705,187.65 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | −0.0630 | −0.0452 |
| 4.期末基金资产净值 | 29,589,223.61 | 14,083,933.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1630 | 1.1002 |

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

宝盈增强收益债券A/B

| 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 | −4.39% | 0.46% | 0.64% | 0.06% | −5.03% | 0.40% |

宝盈增强收益债券C

| 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 | −4.48% | 0.46% | 0.64% | 0.06% | −5.12% | 0.40% |

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

§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 | | |
| 高宇 | 本基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈泰益混合型证券投资基金、宝盈资讯优势混合型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理、固定收益部副总经理 | 2017年11月11日 | – | 11年 | 高宇先生,厦门大学投资学硕士,2008年4月至2009年8月任职于第一创业证券资产管理部,担任研究员;2009年8月至2010年10月任职于国信证券经济研究所,担任固定收益分析师;2010年10月至2016年6月任职于博时基金,先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理等职位;2016年7月至2017年8月任职于天风证券,担任机构业务总部总经理助理;2017年8月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部,历任宝盈货币市场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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度,国内经济在消费、出口、投资等方面仍面临着下行的压力,经济的下行趋势比较确定,政策调整成为当前阶段驱动国内资产价格走势的主要原因。股票和转债等风险资产经历了一轮快速的上涨下跌,目前没有观察到明确的盈利驱动,风险偏好的转变是短期影响价格的主要因素;债券的方向较为确定,但空间取决于是否有更积极的政策。

报告期内,本组合降低了风险资产的仓位,增加了对长端利率债的配置比例,后续将重点配置有足够信用利差的中短期信用债、龙头房企债等资产。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈增强收益债券A/B基金份额净值为1.1630元,本报告期基金份额净值增长率为−4.39%,同期业绩比较基准收益率为0.64%;

截至本报告期末宝盈增强收益债券C基金份额净值为1.1002元,本报告期基金份额净值增长率为−4.48%,同期业绩比较基准收益率为0.64%。

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 | 5,190,948.00 | 8.37 |
| | 其中:股票 | 5,190,948.00 | 8.37 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 46,921,900.00 | 77.51 |
| | 其中:债券 | 46,921,900.00 | 77.51 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,919,690.02 | 8.13 |
| 8 | 其他资产 | 3,506,312.60 | 5.79 |
| 9 | 合计 | 60,538,850.62 | 100.00 |

5.2 报告期末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 | – | – |
| C | 制造业 | 5,190,948.00 | 11.89 |
| 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 | – | – |
| 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 | 5,190,948.00 | 11.89 |

5.3 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

| 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 | 600519 | 贵州茅台 | 2,500 | 2,460,000.00 | 5.63 |
| 2 | 000860 | 顺鑫农业 | 43,200 | 2,015,280.00 | 4.61 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 13,800 | 715,608.00 | 1.64 |

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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 33,189,400.00 | 75.99 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 9,795,000.00 | 22.43 |
| | 其中:政策性金融债 | 9,795,000.00 | 22.43 |
| 4 | 企业债券 | 3,937,500.00 | 9.02 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债(可交换债) | – | – |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 46,921,900.00 | 107.44 |

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 | 180024 | 18附息国债24 | 300,000 | 31,191,000.00 | 71.42 |
| 2 | 190205 | 19国开05 | 100,000 | 9,795,000.00 | 22.43 |
| 3 | 1680155 | 16沪城投 | 50,000 | 3,937,500.00 | 9.02 |
| 4 | 019611 | 19国债01 | 20,000 | 1,998,400.00 | 4.58 |

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。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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损益明细

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。

5.10.2

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 | 134,611.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,741,569.41 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 459,855.37 |
| 5 | 应收申购款 | 170,169.82 |
| 6 | 其他应收款 | 107.00 |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 3,506,312.60 |

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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

| 项目 | 宝盈增强收益债券A/B | 宝盈增强收益债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 59,078,659.03 | 24,678,501.28 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,485,630.28 | 3,009,622.08 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 36,122,652.42 | 14,887,279.37 |
| 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 | 25,441,636.89 | 12,800,843.99 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019年4月1日－2019年6月3日 | 29,318,256.46 | – | 29,318,256.46 | 0.00 | 0.00% |
| 产品持有人风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,在极端情况下可能存在流动性等风险,敬请投资人留意。 | | | | | | | |

8.2 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

中国证监会关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的文件。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金托管协议》。

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:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10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
2019年7月18日

# 宝盈中证100指数增强型证券投资基金

## 2019 第二季度 报告

2019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
报告送出日期:2019年7月18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2019年7月17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2019年4月1日起至6月30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 | 153,795,629.35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的重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0.38%,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深入的积极配置策略,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(2019年4月1日－2019年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 4,429,360.40 |
| 2.本期利润 | 9,280,294.95 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0619 |
| 4.期末基金资产净值 | 236,002,754.41 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.535 |

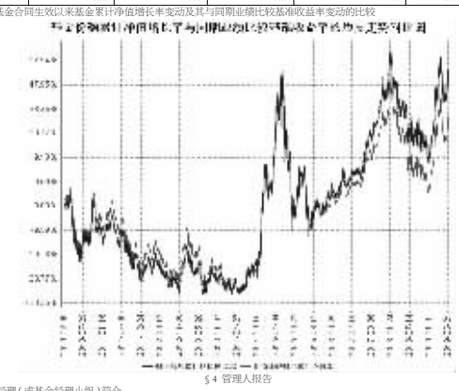
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 3.86% | 1.44% | 1.82% | 1.44% | 2.04% | 0.00% |

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



§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 | | |
| 蔡丹丹 | 本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理 | 2017年8月5日 | – | 9年 | 蔡丹丹女士,CFA,中山大学概率论与数理统计硕士,曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司;2011年9月至2017年7月任职于长城证券股份有限公司,先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理,执行董事;2017年7月加入宝盈基金管理有限公司,中国国籍,证券投资基金从业人员资格。 |
| 刘李杰 | 本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理;量化投资部总经理 | 2019年3月30日 | – | 11年 | 刘李杰先生,美国约翰霍普金斯大学电子与计算机工程博士,华中科技大学通信与信息系统硕士、加拿大多伦多大学数理金融硕士。2008年1月至2008年7月在美国Bayview金融公司担任量化分析师;2009年1月至2011年3月在加拿大帝国商业银行担任高级量化分析师;2011年3月至2012年4月担任加拿大退休金计划投资委员会高级投资分析师/投资经理;2012年6月至2013年8月担任齐鲁证券执行董事;2013年9月至2017年8月担任长城证券股份有限公司资产管理部董总经理,2017年8月加入宝盈基金管理有限公司量化投资部,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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场经历了大幅度的反弹,4月初市场继续上行,上证综指于4月8日创出本轮反弹新高3288.45点,之后市场出现明显回落,5月份上证综指大体在100点范围内窄幅震荡,从基本面来看,4月经济数据低于预期,社融回落,经济复苏进程由折,中美贸易摩擦升级,进出口形势面临较大压力,人民币兑美元汇率从4月中旬至6月上旬快速贬值。从外资来看,5月底MSCI纳入比例提升,6月24日A股纳入富时罗素指数,而北上资金从3月上旬开始一改持续流入态势,直至5月底都呈现出持续流出状态。从政策来看,地方政府专项债、重组新规出台、科创板推进加快等都在一定程度上提振了市场情绪。从指数来看,主要宽基指数都经历了一轮日线级别下跌,上证50和中证100相对强势,二季度分别上涨3.24%和1.88%,这两个指数也于6月下旬确认进入一波日线级别反弹。其余指数表现如下:沪深300指数下跌1.21%,中证800下跌3.6%,上证综指下跌3.62%,创业板下跌10.75%,中证500下跌10.76%,中小板指下跌10.99%,分行业来看,申万28个一级行业仅有5个行业录得上涨,涨幅排前的五个行业是:食品饮料(上涨12.14%)、家电(上涨2.54%)、银行(上涨1.26%)、非银金融(上涨0.82%)和休闲服务(上涨0.6%);涨幅排后的五个行业是:传媒(下跌15.79%)、轻工制造(下跌14.11%)、钢铁(下跌13.17%)、纺织服装(下跌13.04%)和建筑装饰(下跌11.94%)。

从大小盘风格来看,本季度消费和大金融抱团明显,中小创板块跌幅较大,大盘蓝筹风格持续占优,小盘风格优势在均线之下持续走弱。

本基金致力于挖掘财务数据、一致预期数据、市场行情数据、市场情绪数据中蕴含的有效因子,构建多维度、多策略的选股体系。本基金通过对成分股内部有效因子的挖掘,在实现主要风险因子中性的基础上,严格控制与基准指数的偏离度,通过增强策略来增强产品收益。此外,本基金还积极参与主板、中小板、创业板和科创板的网下新股申购,通过打新来提供稳定的增强收益。

报告期内,本基金的股票仓位维持94%左右的水平,在复制中证100指数成分股的基础上,配置了部分增强策略。本基金2019年二季度单位净值上涨3.86%,相对基准超额收益为2.04%,年化跟踪误差为0.95%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.535元;本报告期基金份额净值增长率为3.86%,业绩比较基准收益率为1.82%。

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 | 222,004,919.32 | 93.80 |
| | 其中:股票 | 222,004,919.32 | 93.80 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 9,239,712.00 | 3.90 |
| | 其中:债券 | 9,239,712.00 | 3.90 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,077,769.30 | 2.15 |
| 8 | 其他资产 | 361,652.30 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 236,684,052.92 | 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境内股票投资组合

| 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 | 3,417,458.00 | 1.45 |
| B | 采矿业 | 7,873,244.00 | 3.34 |
| C | 制造业 | 72,327,747.06 | 30.65 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,036,982.00 | 2.13 |
| E | 建筑业 | 6,542,748.00 | 2.77 |
| F | 批发和零售业 | 2,096,793.00 | 0.89 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,142,227.00 | 2.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,209,945.65 | 1.78 |
| J | 金融业 | 99,515,872.49 | 42.17 |
| K | 房地产业 | 9,947,360.00 | 4.21 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,618,564.48 | 1.53 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 225,368.00 | 0.10 |
| 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 | 220,954,309.68 | 93.62 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 142,717.10 | 0.06 |
| C | 制造业 | 479,678.84 | 0.20 |
| 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 | 355,740.00 | 0.15 |
| 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 | 39,603.76 | 0.02 |
| J | 金融业 | 33,869.94 | 0.01 |
| 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 | 1,050,609.64 | 0.45 |

5.3 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

5.3.1 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 | 278,190 | 24,650,415.90 | 10.44 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 12,800 | 12,595,200.00 | 5.34 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 264,000 | 9,498,720.00 | 4.02 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 373,000 | 6,822,170.00 | 2.89 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 123,200 | 6,776,000.00 | 2.87 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 118,650 | 6,153,189.00 | 2.61 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 49,700 | 5,862,115.00 | 2.48 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 79,274 | 5,232,084.00 | 2.22 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 156,300 | 5,221,983.00 | 2.21 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 201,900 | 4,807,239.00 | 2.04 |

5.3.2 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 | 601607 | 上海医药 | 19,600 | 355,740.00 | 0.15 |
| 2 | 600485 | *ST信威 | 19,744 | 288,064.96 | 0.12 |
| 3 | 600968 | 海油发展 | 40,202 | 142,717.10 | 0.06 |
| 4 | 300782 | 卓胜微 | 743 | 80,927.56 | 0.03 |
| 5 | 601698 | 中国卫通 | 10,103 | 39,603.76 | 0.02 |

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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 9,239,712.00 | 3.92 |
| 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(可交换债) | – | – |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 9,239,712.00 | 3.92 |

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 | 019611 | 19国债01 | 48,000 | 4,796,160.00 | 2.03 |
| 2 | 019600 | 18国债18 | 44,400 | 4,443,552.00 | 1.88 |

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。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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除兴业银行外未受到公开谴责、处罚。

2018年9月12日上海证监局就兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时"不符合法定条件,未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试,不具备任职资格"的情形,责令兴业银行股份有限公司于2018年10月25日前整改,健全基金托管业务内部控制制度,加强从业人员管理,并于2018年10月25日前提交整改报告。

上述事项对兴业银行实际运营管理影响较小,鉴于中证100是被动指数型产品,将遵循被动复制为主,在兴业银行的配置上,将按成份股权重配置,不会主动暴露在位。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 21,603.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 159,697.22 |
| 5 | 应收申购款 | 180,351.62 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 361,652.30 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600485 | *ST信威 | 288,064.96 | 0.12 | 重大事项 |

5.11.6 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 | 148,985,663.54 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 28,728,209.77 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 23,918,243.96 |
| 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 | 153,795,629.35 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 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:广东省深圳市福田区福华一路