宝盈中证100指数增强型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010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：二〇一〇年八月二十四日

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。本半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2010年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年2月8日起至6月30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	106,870,817.76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	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% 中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股，它流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，能够作为指数基金的标的指数。 如果中证100指数被停止编制及发布，或中证100指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证100指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准后予以公告。
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	刘传葵	尹东
	联系电话	0755-83276688	010-67595003
	电子邮箱	liuck@byfunds.com	yindong.zh@ccb.cn
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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日）
本期已实现收益	423,404.01
本期利润	-19,451,287.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1173
本期基金份额净值增长率	-20.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2010年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.2076
期末基金资产净值	84,681,010.23
期末基金份额净值	0.792

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。
4、本基金合同生效日为2010年2月8日，本报告期为2010年2月8日至2010年6月30日。

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
过去一个月	-5.49%	1.63%	-5.88%	1.59%	0.39%	0.04%
过去三个月	-22.81%	1.76%	-22.91%	1.74%	0.10%	0.02%
自基金合同生效起至今	-20.80%	1.53%	-18.72%	1.56%	-2.08%	-0.03%

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2010年6月30日）

注：①本基金成立于2010年2月8日。截至本报告期末本基金成立尚不足一年。
②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。目前仍然处在建仓期内。

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）及基金经理助理的简介

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	-	4年	温胜普先生，经济学硕士，4年基金从业经历。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 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。经检查，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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为指数基金，本基金的投资风格与管理人旗下的其他基金和投资组合的风格存在较大差异。由于投资风格的差异，本基金的投资组合业绩与管理人旗下其他组合的投资业绩不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金与管理人旗下的其他基金和组合不存在有利益输送嫌疑的异常交易行为。

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

2010年上半年"刺激政策退出与经济结构转型"是宏观经济政策的主基调，期间央行三次提高准备金率，准备金率达到历史高位水平，2010年4月份更是出台了严厉的房地产调控政策。与此同时，一些区域经济振兴、扶持战略新兴产业的政策也陆续出台。在这样的背景下，市场在一季度以弱势震荡为主，而二季度在房地产调控政策出台后则是单边下行，期间市场风格结构分化严重，医药、消费服务等小市值板块表现较好，而以金融地产为首的权重板块大幅下跌。外围市场方面，欧洲主权债务危机愈演愈烈，引发市场担心全球经济再次陷入困境，避险情绪上升，各国股指在二季度也出现大幅下跌，进一步拖累了国内市场的表现。整个上半年看，市场整体持续处于弱势格局。本基金成立于2010年2月8日，处于市场的阶段低点，成立初期市场持续小幅上涨，较低的股票仓位致使本基金相对比较基准有所落后。在完成初始建仓后，本基金的股票仓位维持在高位水平，结构上在中证100指数权重的基础上，小幅超配了大金融、信息技术、机械、钢铁、公用事业等行业进行增强型投资。整个上半年看，上证指数跌幅为-26.82%，中证100指数跌幅为-30.27%，作为以完全复制法为主进行投资的指数增强型基金，本基金成立以来的净值跟随基准指数出现了较大幅度的下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金的份额净值为0.792元。本基金成立于2010年2月8日，自基金合同生效起至今本基金的份额净值收益率为-20.80%，业绩比较基准收益率为-18.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，由于基数效应与前期政策调控效果显现，经济增速将会回落，企业盈利增速将放缓，从国家统计局公布数据看，2010年二季度GDP当季同比增长10.3%，增速比一季度下降1.6个百分点，从季节调整后的环比分析来看，GDP增速已经明显放缓，我们预计这种增速放缓的趋势在下半年仍会延续，但增速仍会处于较高水平；另一方面，上半年密集出台的紧缩政策已经进入观察期，虽然不会马上放松，但近期内继续大力紧缩的可能性较小，相对于上半年，下半年的政策环境将会有所改善，资金紧张的局面将会有所缓解。而市场在经历了上半年的大幅下跌后，系统性风险得到了很大程度的释放，市场估值进入历史低位区域。综合以上因素，我们认为下半年市场将会进入筑底回升的阶段，市场的运行中枢有望上移，政策放松的预期可能会成为阶段性行情的催化剂。我们认为下半年具有明显估值优势的大盘蓝筹板块会有相对较好的表现，而区域经济振兴、经济结构转型等带来的主题投资机会以及一些业绩增长确定、估值合理的个股也将值得关注。

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

本基金管理人设立估值工作小组，负责估值政策的合理制定和估值流程的监督。本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，当基金的估值方法发生变更，并导致基金资产净值的变化在0.25%以上时，聘请会计师事务所进行审核。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。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，并对估值及净值计算进行复核。

估值工作小组由本基金管理人的分管投资的总经理、督察长、投资部总监、研究部总监、金融工程部总监、基金运营部总监、基金会计主管组成。其中总经理陆金海先生拥有4年的基金公司高级管理人员经验。督察长刘传葵先生拥有18年金融、证券、基金行业从业经验，其中11年证券投资研究管理经验，5年基金合规管理经验。投资部总监夏和平先生拥有12年的证券研究和投资管理经验。研究部总监余述胜先生拥有12年的基金公司从业经验。金融工程部总监杨宏亮先生拥有3年的基金风险管理经验。基金运营部总监陈戈先生拥有3年的基金公司运营管理经验。基金会计主管何瑜女士拥有7年的基金会计经验。

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

本基金合同约定：

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%；

4、若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

7、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本报告期末可供分配利润-22,189,807.53元，基金份额净值0.792元，不符合利润分配条件，因此本报告期末无法实施利润分配。

最近三年利润分配情况

利润分配次数　　每10份累计分配金额（元）

2010年上半年　　0　　0

注：本基金成立于2010年2月8日，因此最近三年的利润表述仅包括2010年上半年。

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投资运作遵规守信、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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2010年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年6月30日
资 产：		
银行存款		5,639,949.04
结算备付金		26,879.73
存出保证金		219,512.68
交易性金融资产		79,982,535.36
其中：股票投资		79,982,535.36
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		-
应收利息		998.71
应收股利		50,535.00
应收申购款		5,938.80
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		85,926,349.32
负债和所有者权益	附注号	本期末2010年6月30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		978,353.48
应付赎回款		5,391.49
应付管理人报酬		54,538.18
应付托管费		10,907.66
应付销售服务费		-
应付交易费用		56,187.93
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		139,960.35
负债合计		1,245,339.09
所有者权益：		
实收基金		106,870,817.76
未分配利润		-22,189,807.53
所有者权益合计		84,681,010.23
负债和所有者权益总计		85,926,349.32

注：1、本报告截止日2010年6月30日，基金份额净值0.792元，基金份额总额106,870,817.76份。
2、本基金合同生效日为2010年2月8日，无上年度可比期间数据。

6.2 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：2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日
一、收入		-18,037,631.70
1.利息收入		122,110.03
其中：存款利息收入		121,953.76
债券利息收入		156.27
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）		1,488,719.13
其中：股票投资收益		856,798.94
基金投资收益		-
债券投资收益		2,767.03
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		629,153.16
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-19,874,691.35
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		226,230.49
减：二、费用		1,413,655.64
1.管理人报酬		469,899.39
2.托管费		93,979.87
3.销售服务费		-
4.交易费用		706,906.39
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		142,869.99
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-19,451,287.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-19,451,287.34

注：本基金合同生效日为2010年2月8日，无上年度可比期间数据。

6.3 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：2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30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）	281,241,387.65	-	281,241,387.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,451,287.34	-19,451,287.34
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）	-174,370,569.89	-2,738,520.19	-177,109,090.08
其中：1.基金申购款	4,143,359.42	-268,562.16	3,874,797.26
2.基金赎回款	-178,513,929.31	-2,469,958.03	-180,983,887.34
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）	106,870,817.76	-22,189,807.53	84,681,010.23

注：本基金合同生效日为2010年2月8日，无上年度可比期间数据。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：陆金海，主管会计工作负责人：于志，会计机构负责人：陈戈

6.4 报表附注

6.4.1 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］第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，本基金的投资范围为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。基金的投资组合比例为：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%。本基金的业绩比较基准为：中证100指数×95%+活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 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"）、中国证监会公告［2010］5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《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》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日止期间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2010年6月30日的财务状况以及2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量。

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

（1）计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

（2）重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字［2007］21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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［2004］78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（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派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。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，暂不征收企业所得税。

（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。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于2010年2月8日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	469,899.39
其中：支付销售机构的客户维护费	77,391.02

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	93,979.87

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期未通过关联方进行银行间市场交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2010年2月8日（基金合同生效日）至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,639,949.04	117,941.92

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末（2010年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
000001	深发展A	2010-06-30	重大资产重组	17.51	-	-	140,000	2,820,923.79	2,451,400.00	-
601318	中国平安	2010-06-30	重大资产重组	46.81	-	-	85,000	4,242,479.88	3,978,850.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 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	79,982,535.36	93.08
	其中：股票	79,982,535.36	93.08
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	5,666,828.77	6.59
6	其他各项资产	276,985.19	0.32
7	合计	85,926,349.32	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采掘业	9,116,020.64	10.77
C	制造业	15,165,206.69	17.91
C0	食品、饮料	3,276,203.00	3.87
C1	纺织、服装、皮毛	309,000.00	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	969,360.00	1.14
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	4,743,853.69	5.60
C7	机械、设备、仪表	5,764,490.00	6.81
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	102,300.00	0.12
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,695,700.00	4.36
E	建筑业	1,655,700.00	1.96
F	交通运输、仓储业	3,621,800.00	4.28
G	信息技术业	3,055,520.00	3.61
H	批发和零售贸易	1,140,000.00	1.35
I	金融、保险业	36,527,962.73	43.14
J	房地产业	3,988,938.50	4.71
K	社会服务业	497,200.00	0.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	403,500.00	0.48
	合计	78,867,548.56	93.13

7.2.2 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	-	-
C	制造业	484,000.00	0.57
C0	食品、饮料	-	-
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	484,000.00	0.57
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	630,986.80	0.75
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,114,986.80	1.32

1.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	350,000	4,553,500.00	5.38
2	601318	中国平安	85,000	3,978,850.00	4.70
3	601328	交通银行	575,000	3,455,750.00	4.08
4	600016	民生银行	500,000	3,025,000.00	3.57
5	601166	兴业银行	125,956	2,900,766.68	3.43
6	600000	浦发银行	182,000	2,475,200.00	2.92
7	600030	中信证券	210,000	2,457,000.00	2.90
8	000001	深发展A	140,000	2,451,400.00	2.89
9	600050	中国联通	400,000	2,132,000.00	2.52
10	601601	中国太保	93,545	2,130,019.65	2.52

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.byfunds.com网站的半年度报告正文。

7.3.2 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	000096	广聚能源	124,210	630,986.80	0.75
2	601299	中国北车	100,000	484,000.00	0.57

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.byfunds.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	13,773,179.19	16.26
2	601328	交通银行	11,441,900.99	13.51
3	601318	中国平安	10,976,609.26	12.96
4	601166	兴业银行	9,405,347.31	11.11
5	600016	民生银行	9,395,000.00	11.09
6	600030	中信证券	8,464,495.75	10.00
7	000002	万科A	8,169,260.60	9.65
8	601169	北京银行	7,859,478.40	9.28
9	600000	浦发银行	7,777,537.00	9.18
10	000001	深发展A	7,356,542.80	8.69
11	601088	中国神华	6,413,168.00	7.57
12	000338	潍柴动力	5,678,967.62	6.71
13	600837	海通证券	5,355,432.21	6.32
14	000623	吉林敖东	5,150,000.00	6.08
15	601601	中国太保	5,110,774.00	6.04
16	601398	工商银行	4,852,000.00	5.73
17	600519	贵州茅台	4,766,296.00	5.63
18	000858	五粮液	4,661,939.40	5.51
19	000568	泸州老窖	4,407,238.14	5.20
20	600089	特变电工	4,261,655.16	5.03
21	600050	中国联通	3,905,000.00	4.61
22	002024	苏宁电器	3,869,331.00	4.57
23	000063	中兴通讯	3,550,304.32	4.19
24	600583	海油工程	3,541,521.00	4.18
25	601919	中国远洋	3,467,334.22	4.09
26	000983	西山煤电	3,337,307.57	3.94
27	000096	广聚能源	3,266,225.90	3.86
28	601857	中国石油	3,227,143.69	3.81
29	601628	中国人寿	3,162,841.70	3.74
30	600028	中国石化	3,067,977.00	3.62
31	600900	长江电力	3,049,738.79	3.60
32	000917	电广传媒	3,029,942.06	3.58
33	600037	歌华有线	2,917,948.00	3.45
34	000060	中金岭南	2,870,067.00	3.39
35	600019	宝钢股份	2,759,000.00	3.26
36	601899	紫金矿业	2,556,000.00	3.02
37	600048	保利地产	2,478,846.00	2.93
38	601006	大秦铁路	2,463,000.00	2.91
39	000783	长江证券	2,357,668.36	2.78
40	000651	格力电器	2,262,800.05	2.67
41	600015	华夏银行	2,166,936.90	2.56
42	000792	盐湖钾肥	2,088,299.00	2.47
43	000800	一汽轿车	2,075,000.00	2.45
44	600068	葛洲坝	1,961,406.00	2.32
45	600018	上港集团	1,953,050.00	2.31
46	600832	东方明珠	1,871,183.00	2.21
47	601168	西部矿业	1,867,696.90	2.21
48	600104	上海汽车	1,851,800.00	2.19
49	002142	宁波银行	1,843,255.00	2.18
50	000024	招商地产	1,838,082.00	2.17
51	002202	金风科技	1,836,980.00	2.17
52	000527	美的电器	1,833,017.00	2.16
53	601988	中国银行	1,768,900.00	2.09
54	601186	中国铁建	1,722,000.00	2.03
55	000709	河北钢铁	1,716,701.17	2.03
56	601668	中国建筑	1,699,000.00	2.01
57	000898	鞍钢股份	1,695,950.00	2.00

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	8,706,883.07	10.28
2	601328	交通银行	6,771,353.00	8.00
3	601318	中国平安	6,570,002.00	7.76
4	600016	民生银行	5,999,500.00	7.08
5	000002	万科A	5,992,817.30	7.08
6	000338	潍柴动力	5,832,928.28	6.89
7	601169	北京银行	5,720,080.75	6.75
8	601166	兴业银行	5,703,734.40	6.74
9	600000	浦发银行	5,556,885.25	6.56
10	600030	中信证券	4,758,308.78	5.62
11	000001	深发展A	4,576,609.41	5.40
12	000623	吉林敖东	4,466,410.29	5.27
13	601088	中国神华	3,904,125.50	4.61
14	000568	泸州老窖	3,629,492.22	4.29
15	600837	海通证券	3,408,435.85	4.03
16	600089	特变电工	3,142,980.00	3.71
17	000917	电广传媒	3,100,894.38	3.66
18	000858	五粮液	3,051,024.99	3.60
19	600037	歌华有线	3,023,779.00	3.57
20	601601	中国太保	3,008,103.50	3.55
21	600583	海油工程	2,994,545.36	3.54
22	000060	中金岭南	2,783,256.62	3.29
23	601919	中国远洋	2,771,223.40	3.27
24	601398	工商银行	2,674,000.00	3.16
25	002024	苏宁电器	2,626,070.36	3.10
26	000096	广聚能源	2,534,787.00	2.99
27	600519	贵州茅台	2,531,532.30	2.99
28	000800	一汽轿车	2,312,608.08	2.73
29	000063	中兴通讯	2,201,716.88	2.60
30	000983	西山煤电	2,173,122.00	2.57
31	601857	中国石油	2,126,484.00	2.51
32	600068	葛洲坝	2,103,633.94	2.48
33	601628	中国人寿	2,004,295.28	2.37
34	600028	中国石化	1,887,500.00	2.23

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

7.4.3 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	297,544,548.59
卖出股票的收入（成交）总额	198,544,120.82

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。

7.4 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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	219,512.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	50,535.00
4	应收利息	998.71
5	应收申购款	5,938.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	276,985.19

7.9.4 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。

7.9.5.1 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	601318	中国平安	3,978,850.00	4.70	重大资产重组
2	000001	深发展A	2,451,400.00	2.89	重大资产重组

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,964	54,414.88	39,998,600.00	37.43%	66,872,217.76	62.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	9,660.22	0.01%

9 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,143,359.42
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	178,513,929.31
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	106,870,817.76

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2010年3月19日，宝盈基金管理有限公司独立董事陈小悦先生病逝。2010年6月28日，宝盈基金管理有限公司股东会以直接做出决定的方式通过更换宝盈基金管理有限公司独立董事事项：同意陈雨露辞去宝盈基金管理有限公司独立董事职务；同意贺颖奇和屈文洲担任宝盈基金管理有限公司独立董事。相关情况按规定已报监管部门备案。2010年4月17日公司股东会同意原监事长王慧辞去监事职务，公司拟按规定程序增补监事。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	342,220,605.35	69.17%	290,886.54	70.13%	-
联合证券	1	152,519,915.06	30.83%	123,923.21	29.87%	-

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。

2、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。

3、本基金与本基金管理公司管理的宝盈增强收益债券型证券投资基金共用交易单元，本报告期末租用和退租证券公司交易单元。

10.7.2 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	
	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
长江证券	715,923.30	100.00%	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任本行副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

宝盈基金管理有限公司
二〇一〇年八月二十四日