

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2013半年度报告摘要

2013年6月30日

负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下及时修订估值方法,以保证其适用。投资部、研究部、固定收益部、特定客户资产部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价;金融工程部负责对估值模型及方法进行评估,选择最具适用性的估值模型及参数,并负责估值模型的选取及测算;基金事业部负责进行日常估值,并与托管行的估值结果核对一致;监察稽核部负责监督估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的估值披露工作。

上述参与估值流程的基本基金管理人、基本托管人和本基金聘请的会计师事务所各自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

本基金报告期末利润分配情况符合相关法规及基金合同的规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守基金合同情况说明

本报告期,本基金管理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、基金费用开支、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金收益分配、基金资产估值、基金净值增长率、基金资产净值增长率等指标进行定期报告,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,本基金托管人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,本基金管理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、基金费用开支、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金收益分配、基金资产估值、基金净值增长率、基金资产净值增长率等指标进行定期报告,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,本基金托管人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。

5.3 托管人对半年度报告中财务分析等内容的属实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本基金报告中的财务指标、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,对本基金报告不存在虚假记载、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:2013年6月30日

单位:人民币元

资产 附注号 本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

资产: 项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日

货币资金 3,837,294.03 6,915,298.00

结算备付金 92,907,36 5,474,00

存出保证金 14,290,08 1,627,51

交易性金融资产 45,139,263.03 63,289,334.26

其他应收款 45,139,263.03 63,289,334.26

基金投资 - -

银行存款 - -

应收证券清算款 - -

应付利息 961.98 1,692.77

应付股利 181,997.97 -

应付申购款 4,492,319.70 135,098.07

应付赎回款 - -

应付销售服务费 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 31,904.36 38,248.49

应付审计费用 6,389.87 7,649.70

应付交易费用 27,473.46 12,163.24

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付红利 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -

应付交易费用 - -

应付税款 - -

应付利息 - -

应付利润 - -

应付股利 - -

应付管理人报酬 - -

应付托管费 - -

应付审计费用 - -