宝盈货币市场证券投资基金

2010 第四季度报告

2010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:二〇一一年一月二十四日

§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2011年1月21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2010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	
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	403,135,940.25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	本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。 本基金定位于现金管理的工具,采用活期存款税后利率作为本基金的业绩比较基准,更能体现本基金良好的流动性与安全性。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出,或有更科学客观的权重比例适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致,在履行适当程序后实施,并在更新的招募说明书中列示。	
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	99,653,274.69份	303,482,665.56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(2010年10月1日-2010年12月31日)	
	宝盈货币A	宝盈货币B
1.本期已实现收益	101,344.36	770,591.05
2.本期利润	101,344.36	770,591.05
3.期末基金资产净值	99,653,274.69	303,482,665.56

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

1.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	0.4208%	0.0098%	0.0907%	0.0000%	0.3301%	0.0098%

注:本基金收益分配按日结转份额。

2.宝盈货币B

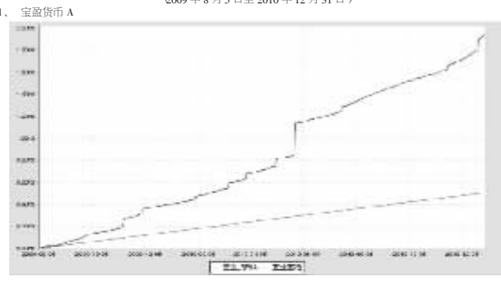
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4812%	0.0098%	0.0907%	0.0000%	0.3905%	0.0098%

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

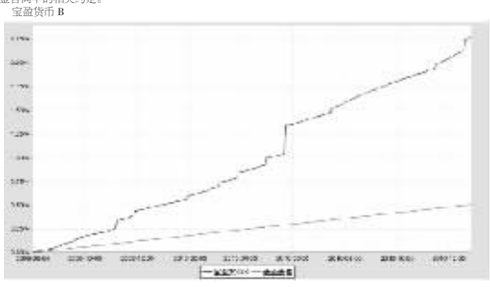
宝盈货币市场证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年8月5日至2010年12月31日)

1、 宝盈货币A



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。

2、 宝盈货币B



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		
陈若劲	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	2009-8-6	-	7年	陈若劲,女,1971年生,香港中文大学金融MBA,具有7年证券从业经历,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、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员,现任宝盈基金管理有限公司宝盈增强收益债券型证券投资基金经理,中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,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。经检查,公平交易制度执行情况良好。本报告期内,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,无损害组合持有人利益的行为。

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

本报告期内,本投资组合与管理人旗下的其他组合不存在有利益输送嫌疑的异常交易行为。

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,受商业银行年终考核、央行连续上调存贷款利率和存款准备金率等多重影响,货币市场资金面持续紧张并在12月中下旬达到顶峰。11月至12月,资金利率持续大幅跳升,隔夜回购利率由期初的1.73%一度上行到5.11%的水平,7天回购利率更是由期初的1.89%一度上行到6.37%的水平,分别创近三年来新高。

在资金利率上行的带动下,各期限央票品种二级市场收益率也迅速上行。3月央票收益率由期初的2.02%一度上行到3.70%的水平,1年央票由期初2.12%一度上行到3.60%的水平。伴随加息,央票发行利率有所提高,但是一二级利率差距不断拉大,央票发行基本停滞。

报告期内,我们主要配置三个月以内的央票,增持了shibor的浮息品种,随着利率上行我们调整了短融券持仓,配置了收益率更高的品种。

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增长率是0.4208%,同期业绩比较基准收益率是0.0907%。
货币B:
本基金在本报告期内净值增长率是0.4812%,同期业绩比较基准收益率是0.0907%。

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2011年一季度,我们认为随着年末效应的消退,12月市场资金极度紧张的局面将有所缓解,资金面将很快重新回归宽松,回购利率将快速下行,回到3%附近的水平,但是回到10月份2%附近的可能性很小。

相应地,预计1月份各期限央票品种二级市场收益率将明显下行,但是在通胀没有明显缓解、央行可能进一步上调存贷款基本利率和存款准备金率的情况下,央票利率整体仍然处于上行通道中,一季度的收益率中枢将高于2010年四季度。

基于以上的判断,一季度我们将在相关法规政策允许的范围内,在收益率下降的阶段降低组合的久期,以防范收益率上行的风险,我们将继续寻找浮息债和短融券阶段性的投资机会,同时保留适当的现金和超短期央票等资产以保证组合足够的流动性。

§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	389,140,817.78	70.39
	其中:债券	389,140,817.78	70.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	6,317,023.22	1.14
4	其他各项资产	157,377,244.67	28.47
5	合计	552,835,085.67	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.06
	其中:买断式回购融资	-

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	-	-
	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

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

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	147
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	147
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

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。

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	13.95	37.09
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	49.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.43	-
4	90天(含)—180天	17.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	7.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.09	37.09

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	149,241,033.83	37.02
3	金融债券	130,098,692.72	32.27
	其中:政策性金融债	130,098,692.72	32.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	109,801,091.23	27.24
6	其他	-	-
7	合计	389,140,817.78	96.53
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,951,418.54	7.43

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	1001021	10央行票据21	1,000,000	99,314,731.51	24.64
2	080303	08进出03	600,000	60,120,314.70	14.91
3	1001091	10央行票据91	500,000	49,926,302.32	12.38
4	080403	08农发03	400,000	40,026,959.48	9.93
5	100236	10国开36	300,000	29,951,418.54	7.43
6	1081437	10常纺CP01	200,000	19,983,193.69	4.96
7	1081354	10亨通CP02	200,000	19,858,145.71	4.93
8	1081210	10大族CP02	100,000	10,021,859.20	2.49
9	1081120	10晋三维CP01	100,000	10,013,376.58	2.48
10	1081174	10亨通CP01	100,000	10,001,009.56	2.48

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1160%
报告期内偏离度的最低值	-0.1244%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0812%

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法"计价,即估值对象以买入成本列示,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 其他各项资产构成

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	1,651,190.82
4	应收申购款	155,726,053.85
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	157,377,244.67

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

	宝盈货币A	宝盈货币B
本报告期期初基金份额总额	30,870,005.50	101,803,132.93
本报告期基金总申购份额	175,368,481.34	362,507,265.64
减:本报告期基金总赎回份额	106,585,212.15	160,827,733.01
本报告期期末基金份额总额	99,653,274.69	303,482,665.56

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的文件。

《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》。

《宝盈货币市场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。

7.2 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

7.3 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
二〇一一年一月二十四日

宝盈资源优选股票型证券投资基金

2010 第四季度报告

2010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:二〇一一年一月二十四日

§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2011年1月21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2010年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈资源优选股票	
基金主代码	213008	
交易代码	213008	213908
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年4月15日	
报告期末基金份额总额	234,879,227.44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,处于稀缺状态的资源占现其强大的经济价值,相关上市公司体现出较好的投资价值,本基金根据研究能的估值模型,优选各个行业中具有资源优势的上市公司,建立股票池,在严格控制投资风险的前提下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	本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合,并注重资产在各相关行业的配置,适当进行时机选择,采用"自上而下"进行资产配置和行业配置、"自下而上"精选个股的积极投资策略。 1.资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况,市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2.股票投资策略 本基金将把握资源的价值变化规律,对各类资源的现状和发展进行分析判断,及时适当调整各类资源行业的配置比例,重点投资于各类资源行业中的优势企业,分享资源长期价值提升所带来的投资收益。 在个股选择层面,本基金以净资产收益率、预期PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据,通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。 3.债券及短期金融工具投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。 4.权证投资策略 本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益,以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件,运用有关数量模型进行估值和风险评估,谨慎投资。	
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%	
风险收益特征	风险水平和期望收益相对较高	
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(2010年10月1日-2010年12月31日)
1.本期已实现收益	13,170,527.10
2.本期利润	22,351,553.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1048
4.期末基金资产净值	249,120,638.14
5.期末基金份额净值	1.0606

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

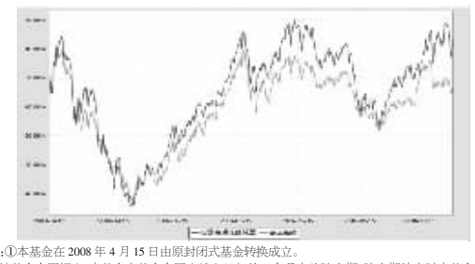
3.2 基金净值表现

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	12.83%	1.83%	4.99%	1.33%	7.84%	0.50%

3.2.2 自基金转型以来基金累计份额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

宝盈资源优选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年4月15日至2010年12月31日)



注:①本基金在2008年4月15日由原封闭式基金转换成立。

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。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		
彭敢	本基金基金经理	2010-11-5	-	9年	彭敢先生,1969年生,金融学硕士,9年证券从业经历,曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作,2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部,现同时担任资源优选股票型证券投资基金经理。
杨宏亮	本基金基金经理,宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2009-7-11	2010-11-5	7年	杨宏亮先生,1974年生,经济学博士,具有7年金融从业经历。曾就职于国家开发银行综合计划局、深圳国信证券综合研究所和中再资产管理股份有限公司从事统计模型与方法研究、宏观研究、证券市场投资策略构建、产品设计和风险管理等工作,在宝盈基金管理公司工作期间负责金融工程工作。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,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。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

本基金在2008年4月15日由原封闭式基金转换成立。成立后,基金的投资风格和原来作为封闭式基金的投资风格有较大差异,和管理人旗下的其他封闭式基金和开放式基金的投资风格也存在较大差异。由于投资风格的差异,本基金的投资组合业绩和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 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年四季度,市场经过8月、9月两个月的盘整,国庆节后以煤炭、有色、金融板块的大幅上涨带动市场活跃,随后又在煤炭、有色、金融板块的拖累下大幅下跌,走出一个倒v字行情,全季度沪深300指数上涨6.56%。期间股价分化较为严重,中小板和创业板股票走势较好,指数分别上涨7.84%和20.7%。

报告期内,本基金根据不同行业、板块间动态估值水平的差异,在4季度,增加了高新技术、品牌消费品、油田服务、医药等行业的配置比例。第4季度本基金净值增长率为12.83%,好于比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是12.83%,同期业绩比较基准收益率是4.99%。

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2011年,本基金管理人认为短期内前期跌幅较大的煤炭、有色板块有回归均值的要求,趋势上可适当投资在煤炭、金融板块。短期内科技成长股由于4季度涨幅较大,有一定调整压力,但随着市场调整,其中增长确定的个股会重新回到上升轨道,中期内仍然是本基金持股的重点。此外,4季度后期,消费、医药、农业板块持续调整,目前调整幅度较大,中期继续看好。地产股预计有脉冲式行情,较难把握,可以适当配置基本面较好、受政策影响不大的地产股。

投资管理人将坚持价值投资的理念,结合资源优选基金的特点,为投资者追求较高的收益。

§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	233,289,938.75	92.85
	其中:股票	233,289,938.75	92.85
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	15,979,443.16	6.36
6	其他各项资产	1,982,501.07	0.79
7	合计	251,251,882.98	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	采掘业	27,782,385.51	11.15
C	制造业	127,735,725.00	51.27
C0	食品,饮料	18,542,323.00	7.44
C1	纺织,服装,皮毛	3,665,200.00	1.47
C2	木材,家具	-	-
C3	造纸,印刷	-	-
C4	石油,化学,塑胶,塑料	28,040,902.00	11.26
C5	电子	19,367,940.00	7.77
C6	金属,非金属	11,796,700.00	4.74
C7	机械,设备,仪表	31,078,260.00	12.48
C8	医药,生物制品	13,853,200.00	5.56
C99	其他制造业	1,391,200.00	0.56
D	电力,煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,807,000.00	1.13
F	交通运输,仓储业	7,769,000.00	3.12
G	信息技术业	39,790,300.00	15.97
H	批发和零售贸易	17,768,128.24	7.13
I	金融,保险业	3,664,000.00	1.47
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	5,973,400.00	2.40
M	综合类	-	-
	合计	233,289,938.75	93.65

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	300084	海默科技	640,469	22,922,385.51	9.20
2	002449	国星光电	330,000	14,470,500.00	5.81
3	600498	烽火通信	330,000	13,648,800.00	5.48
4	300044	赛为智能	330,000	10,114,500.00	4.06
5	600778	友好集团	649,500	8,651,340.00	3.47
6	002096	南岭民爆	250,000	8,487,500.00	3.41
7	600559	老白干酒	191,800	7,221,270.00	2.90
8	600697	欧亚集团	280,000	7,112,000.00	2.85
9	002099	海翔药业	294,000	6,997,200.00	2.81
10	300135	宝利沥青	150,300	6,889,752.00	2.77

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金所投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	890,741.00
2	应收证券清算款	902,996.54
3	应收股利	-
4	应收利息	3,621.55
5	应收申购款	185,141.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,982,501.07

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	171,244,615.21
本报告期基金总申购份额	143,285,225.26
减:本报告期基金总赎回份额	79,650,613.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	234,879,227.44

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批复鸿飞基金的名称变更为宝盈资源优选股票型证券投资基金的文件。

《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈资源优选股票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。

7.2 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

7.3 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
二〇一一年一月二十四日

鸿阳证券投资基金

2010 第四季度报告

2010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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年一月二十四日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年1月21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2010年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈鸿阳封闭
基金主代码	184728
交易代码	184728
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001年12月10日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良而稳定的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险,在保持基金资产良好的流动性的基础上,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳利益。
投资策略	作为成长价值复合型基金,本基金股票投资包括两部分:一部分为成长型投资,另一部分为价值型投资,成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整,但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的30%,最高均不得高于股票投资总额的70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则,在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合,分散和降低投资风险,确保基金资产安全,谋求基金长期稳定的收益。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	风险水平和期望收益适中。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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(2010年10月1日-2010年12月31日)
1.本期已实现收益	114,574,585.01
2.本期利润	111,214,239.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0556
4.期末基金资产净值	1,677,641,083.88
5.期末基金份额净值	0.8388

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.上述基金业绩指标不包括份额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。

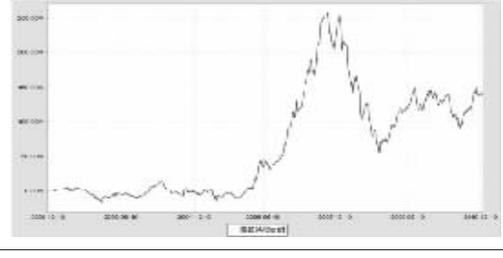
3.2 基金净值表现

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	7.10%	2.20%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

鸿阳证券投资基金
累计份额净值增长率历史走势图
(2001年12月10日至2010年12月31日)



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		
彭敢	本基金基金经理	2010-12-29	-	9年	男,1969年生,金融学硕士,9年证券从业经历,曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作,2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部,现同时担任资源优选股票型证券投资基金经理。
高峰	本基金基金经理,宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理,宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理、总经理助理