# 宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会2009年1月6日中国证监会证监许可［2009］5号《关于核准宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准公开发售。本基金基金合同于2009年3月17日正式生效。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。

基金管理人的过往业绩并不预示其未来业绩。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年9月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日。基金托管人中国银行对本招募说明书（更新）中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

## 一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：宝盈基金管理有限公司

注册及办公地址：广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第15层

法定代表人：李建生

总经理：汪钦

组织形式：有限责任公司

成立时间：2001年5月18日

注册资本：1亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：（0755）83276688

传真：（0755）83515599

联系人：张新元

股权结构：本基金管理人是经中国证监会证监基金字［2001］9号文批准发起设立，现有股东包括中铁信托有限责任公司、成都工业投资集团有限公司、中国对外经济贸易信托有限公司。其中中铁信托有限责任公司持有本公司49%的股权，成都工业投资集团有限公司持有26%的股权，中国对外经济贸易信托有限公司持有25%的股权。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

（1）董事会：

李建生女士，董事长，1954年生，中共党员，本科。曾在黑龙江建设兵团、铁道部基建总局工作。1989年始历任中国铁路工程总公司副处长、高级会计师、副总会计师，现任中国中铁股份有限公司副总裁、财务总监兼总法律顾问。

景开强先生，董事，1958年生，硕士研究生，高级会计师。1985年7月至1989年10月在中铁二局机筑公司广州、深圳、珠海项目部任职，历任助理会计师、会计师、财务主管；1989年11月至2001年4月在中铁二局机筑公司财务科任职，历任副科长、科长、总会计师；2001年5月至2003年10月在中铁二局股份公司任财会部部长，中铁二局集团专家委员会财务组组长；2003年11月至2005年10月在中铁八局集团公司任总会计师、总法律顾问、集团公司专家委员会成员；现任中铁信托有限责任公司总经理。

陈赤先生，董事，1966年生，中共党员，经济学博士。1988年7月至1998年5月任西南财经大学公共与行政管理学院教研室副主任；1998年5月至1999年3月在四川省信托投资公司人事部任职；1999年3月至2000年10月在四川省信托投资公司峨眉山办事处任总经理助理，2000年10月至2003年6月在和兴证券有限责任公司工作；2003年6月开始任衡平信托投资有限责任公司总裁助理兼研究发展部总经理，现任中铁信托有限责任公司副总经理兼董事会秘书。

张一冰女士，董事，1967年生，中共党员，陕西财经学院硕士。1989年7月起，在中国华大理工技术公司计财部任职；1990年5月至1999年5月，在中国对外经济贸易信托投资公司计财部、综合部和证券部任职；1999年6月，任香港第一太平银行投资银行部副总裁；2001年4月起，在中国对外经济贸易信托投资公司先后担任投资银行部、稽核法律部总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司董事会秘书兼投资发展部总经理。

曾康霖先生，独立董事，1938年生，中共党员，西南财经大学教授。1951年至1956年，在四川省泸县税务局工作；1956年至1960年，在西南财经大学学习；1960年至今，在西南财经大学任教，现任西南财经大学中国金融研究中心名誉主任，博士生导师。

贺颖奇先生，独立董事，1962年生，中共党员，管理学博士。1986年至1992年，在河北大学经济系任教；1995年至2001年，在厦门大学管理学院任教；2001年至2003年在清华大学经济管理学院管理学博士后流动站从事博士后研究工作；2003年7月至2010年4月，在清华大学会计研究所从事教学与科研工作，任清华大学会计研究所党支部书记，副教授；2010年5月至今，在北京国家会计学院任副教授。

屈文洲先生，独立董事，1972年生，中共党员，金融学博士。1995至1997年，任厦门建发信托投资公司海滨证券营业部投资信息部主任；1997至2001年，任厦门建发信托投资公司投资银行部经理；1998至1999年，借调中国证监会厦门特派办上市公司监管处；2001至2003年任厦门市博亦投资咨询有限公司总经理；2003至2005年任深圳证券交易所研究员；2005至今，在厦门大学管理学院从事教学与研究工作。现任厦门大学管理学院教授、博士生导师，厦门大学中国资本市场研究中心主任，厦门大学管理学院财务学系副主任。兼任厦门空港、山东航空、梅花伞、众和股份独立董事。

汪钦先生，1966年生，中共党员，经济学博士。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处、海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三亚东方实业股份有限公司副总经理、国信证券股份有限公司研究所所长、长城基金管理有限公司副总经理。2010年11月起任宝盈基金管理有限公司总经理。

（2）监事会

王连洲先生，独立监事，1939年生，副研究员。1964年至1983年，在中国人民银行印制局工作，曾担任计划处副处长；1983年至2000年，在全国人大财经委员会工作，主要从事金融立法，先后担任办公室财金组副组长、组长、办公室副主任、研究室巡视员。2000年11月退休。

张建华女士，监事，1969年生，高级经济师。曾就职于四川新华印刷厂、成都科力风险投资公司、成都工商信托有限公司、衡平信托有限责任公司。现任中铁信托有限责任公司理财中心总经理。

杨凯先生，员工监事，1974年生，中山大学岭南学院MBA。2003年7月至今，在宝盈基金管理有限公司工作，先后担任市场部总监助理，市场部总监、特定客户资产管理部总监。目前，其担任宝盈基金管理有限公司总经理助理兼研究部总监。

（3）其他高级管理人员

孙胜华先生，1971年生，中共党员，法学硕士。曾在中国信达信托总公司、中国信达资产管理公司、英国Wyvern （China）投资银行、中国泛海控股集团、民生证券有限责任公司、华夏基金管理有限公司从事法律工作。2010年3月加入宝盈基金管理有限公司任总经理助理兼监察稽核部总监，2010年11月起任宝盈基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

王琼先生，1969年生，管理系工学硕士，具有15年证券从业经历。先后任职于上海万国证券公司投资银行部、招商证券公司投资银行部、研究部和投资管理部，从事宏观经济研究、行业研究工作，曾担任宏观策略小组负责人，研究部副总经理、投资管理部董事（分管QDII业务）；曾任职于融通基金公司研究部、投资部，历任行业研究员、基金经理助理。2009年7月加入宝盈基金管理有限公司，现任宝盈基金管理有限公司投资部副总监，宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金经理。

宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

杨宏亮，2009年7月11日至2010年11月5日；

欧阳东华，2009年3月17日至2009年6月19日。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

汪钦先生，宝盈基金管理有限公司总经理。

高峰先生：宝盈基金管理有限公司总经理助理兼投资部总监、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。

杨凯先生：宝盈基金管理有限公司总经理助理兼研究部总监。

余述胜先生：宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理、宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理。

陈若劲女士：宝盈基金管理有限公司固定收益部总监、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理。

## 二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖 钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后行使中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务大众、振兴民族金融业为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行成为国家外汇外贸专业银行，为国家对外经贸发展和国内经济建设作出了重大贡献。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行开始股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为首家在内地和香港发行上市的中国商业银行。中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港、澳门及31个国家为客户提供全面的金融服务。主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资附属机构中银国际控股集团开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险有限公司及其附属和联营公司经营保险业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过全资子公司中银集团投资有限公司从事直接投资和投资管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。按核心资本计算，2009年中国银行在英国《银行家》杂志"世界1000家大银行"排名中列第十一位。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神，稳健经营的理念，客户至上的宗旨和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010年度房地产业"中国最佳商业银行"，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为"中国最佳私人银行"、"中国最佳贸易融资银行"，被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）主要人员情况

肖钢先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年3月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自1996年10月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年8月，1981年毕业于湖南财经学院，1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自2004年8月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月，1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司执行董事。2000年11月加入中国银行并自此担任中国银行副行长。于1980年11月至2000年11月任职于中国建设银行，曾工作于多个岗位，先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978年毕业于南京信息工程大学。2002年6月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生，自2007年11月27日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自2005年9月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，1983年7月至2005年9月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于1962年11月，获得西南财经大学博士学位。

（三）基金托管部门的情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念；根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工110余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行等重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（四）证券投资基金托管情况

截止2011年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型基金联接基金、海富通大中华精选股票型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、招商标普金砖四国指数证券投资基金、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金、大成标普500等权重指数证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型基金、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数联接基金、博时抗通胀增强回报证券投资基金、诺德优选30股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、华安大中华升级股票型证券投资基金、国联安优选行业股票型证券投资基金、长盛同鑫保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、泰信中证200指数证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业50基金联接基金、深证电子信息传媒产业50交易型指数基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、深证基本面120交易型开放式指数基金、嘉实深证基本面120交易型基金联接基金、上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型基金联接基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、华安深证300指数证券投资基金、嘉实信用债券型证券投资基金、平安大华行业先锋股票型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金等128只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（五）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层

法定代表人：李建生

电话：0755-83276688

传真：0755-83515880

联系人：张珂

宝盈基金爱宝网：http://ibao.byfunds.com

2、代销机构

（1）中国建设银行

注册地址：北京市西城区金融大街25号

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

（2）中国银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

（3）中国农业银行

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（4）交通银行

注册地址：上海市仙霞路18号

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（5）招商银行

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（6）中信银行

注册地：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

客户服务电话：95558

公司网址：www.ecitic.com

（7）北京银行

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

客户服务电话：95526

公司网址：http://www.bankofbeijing.com.cn

（8）平安银行

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

客户服务电话：40066-99999

公司网址：http://www.18ebank.com/

（9）国泰君安证券

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

客户服务电话：4008888666

公司网址：www.gtja.com

（10）中信建投证券

注册地址：北京市新中街68号

客户服务电话：4008888108

公司网址：www.csc108.com

（11）国信证券

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（12）招商证券

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（13）广发证券

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

客户服务电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

（14）中信证券

注册地址：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

客户服务电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

（15）中国银河证券

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦c座

客户服务电话：4008888888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（16）海通证券

注册地址：上海市淮海中路98号

客户服务电话：4008888001

公司网址：www.htsec.com

（17）华泰联合证券

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

客户服务电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

（18）申银万国证券

注册地址：上海市常熟路171号

客户服务电话：021-962505

公司网址：www.sywg.com.cn

（19）兴业证券

注册地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦

客户服务电话：021-68419974

公司网址：www.xyzq.com.cn

（20）长江证券

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

客户服务电话：4008888999

公司网址：www.cjsc.com.cn

（21）安信证券

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

客户服务电话：0755-82825555

公司网址：www.essences.com.cn

（22）西南证券

注册地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦22-25层

客户服务电话：023-63786187

公司网址：www.swsc.com.cn

（23）中信金通证券

注册地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

客户服务电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

（24）万联证券

注册地址：广州市中山二路18号电信广场36-37层

客户服务电话：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

（25）渤海证券

注册地址：天津市河西区宾水道3号

客户服务电话：022-28455588

公司网址：www.ewww.com.cn

（26）中信万通证券

注册地址：青岛市崂山区香港东路316号

客户服务电话：96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（27）东吴证券

注册地址：江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

客户服务电话：0512-96288

公司网址：www.dwjq.com.cn

（28）东方证券

注册地址：上海市中山南路318号2号楼

客户服务电话：021-962506

公司网址：www.dfzq.com.cn

（29）长城证券

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

客户服务电话：0755-82288968

公司网址：www.cc168.com.cn

（30）国联证券

注册地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层

客户服务电话：0510-82588168

公司网址：www.glsc.com.cn

（31）浙商证券

注册地址：浙江省杭州市杭大路1号

客户服务电话：95105665

公司网址：www.stocke.com

（32）平安证券

注册地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦

客户服务电话：95511

公司网址：www.xmpb.com

（33）国都证券

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

客户服务电话：4008188118

公司网址：www.guodu.com

（34）东海证券

注册地址：上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

客户服务电话：0519-8166222

公司网址：www.longone.com.cn

（35）国盛证券

注册地址：江西省南昌市永叔路15号

客户服务电话：0791-6285337

公司网址：www.gsstock.com

（36）华西证券

注册地址：四川省成都市陕西街239号

客户服务电话：4008888818

公司网址：www.hx168.com.cn

（37）宏源证券

注册地址：新疆乌鲁木齐建设路2号

客户服务电话：010-62294600

公司网址：www.ehongyuan.com

（38）齐鲁证券

注册地址：山东省济南市经十路128号

客户服务电话：0531-82084184

公司网址：www.qlzq.com.cn

（39）第一创业证券

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B 座26层

客户服务电话：0755-25832686

公司网址：www.firstcapital.com.cn

（40）金元证券

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

客户服务电话：4008888228

公司网址：www.jyzq.com.cn

（41）中航证券

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

客户服务电话：4008866567

公司网址：www.avicsec.com

（42）中国建银投资证券

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层

客户服务电话：4006008008

公司网址：www.cjis.cn

（43）天源证券

注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦6层

客户服务电话：0755-3333118-8806

公司网址：www.tyzq.com.cn

（44）厦门证券

注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

客户服务电话：0592-5163588

公司网址：www.xmzq.com.cn

（45）世纪证券

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦41层

客户服务电话：0755-83199599

公司网址：www.csco.com.cn

（46）中金公司

注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

客户服务电话：010-85679238

公司网址：www.cicc.com.cn

（47）信达证券

注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

客户服务电话：4008008899

公司网址：www.cindasc.com

（48）英大证券

注册地址：深圳市福田区华能大厦30楼

客户服务电话：0755-26982993

公司网址：www.vsun.com

（49）华福证券

公司网址：www.hfzq.com.cn

客户服务电话：0591-96326

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

（50）天相投顾

公司网址：www.txsec.com

客户服务电话：010-66045666

注册地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701

（51）光大证券

公司网址：www.ebscn.com

客户服务电话：4008888788

注册地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼

（52）华泰证券

公司网址：www.htsc.com.cn

客户服务电话：4008888168

注册地址：南京市中山东路90号华泰证券大厦

（53）东莞农村商业银行

公司网址：www.drcbank.com

客户服务电话：961122

注册地址：东莞市南城路2号

（二）注册登记机构：

注册登记人名称：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层

法定代表人：李建生

电话：0755-83276688

传真：0755-83515466

联系人：陈静瑜

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所名称：广东华瀚律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路宝安广场A座16楼G、H室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路宝安广场A座16楼G、H室

法定代表人：李兆良

经办律师：杨忠、戴瑞冬

电话：0755-82687860

传真：0755-82687861

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：汪棣、单峰

## 四、基金的名称

本基金名称：宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式灵活配置混合型基金

## 六、基金的投资目标

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，?本基金以根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业，建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上，对于景气度提高的行业给予适当倾斜，以构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，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。

## 七、基金的投资范围

本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票，以及债券、权证和其他证监会允许基金投资的金融工具。

本基金股票投资对象是各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业。

本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的30-80%，债券为15-65%，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%。其中投资于具有核心优势的股票不低于本基金股票资产的80%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，具体投资比例和限制等将另行公告。

## 八、基金的投资策略

本基金为灵活配置混合型基金，投资范围包括股票、债券、权证和中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中股票投资比例为基金总资产的30-80%，其它为15-65%，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%。其中投资于具有核心优势的股票不低于本基金股票资产的80%。

（一）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。

1.宏观经济环境

本基金分析宏观经济运行状况主要参考以下指标：

季度GDP及其增长速度；

月度工业增加值及其增长率；

月度固定资产投资完成情况及其增长速度；

月度社会消费品零售总额及其增长速度；

月度居民消费价格指数、工业品价格指数以及主要行业价格指数；

月度进出口数据以及外汇储备等数据；

货币供应量M0、M1、M2的增长率以及贷款增速。

2.政策环境

主要指国家财政政策、货币政策、产业政策及证券市场监管政策。

3.市场资金环境

本基金主要参考以下指标分析判断市场资金环境：

居民储蓄进行证券投资的增量；

货币市场利率；

基金新增投资规模；

券商自营规模变动额；

QFII新增投资额；

新股扩容；

增发、配股所需资金；

可转债所需资金；

印花税和佣金；

其他投资资金变动额等。

（二）股票投资策略

1.公司股票池的构建程序

首先，根据公司的基本面情况，根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业，建立股票池。具体包括：

A.良好的公司治理结构，诚信、优秀的公司管理层；企业管理层诚信尽职，融洽稳定，重视股东利益，管理水平能充分适应企业规模的不断扩大；企业能不断制定和调整发展战略，把握住正确的发展方向，以保证企业资源的最佳配置和自身优势的发挥。

B.财务透明、清晰，资产质量及财务状况较好，良好的历史盈利记录。

C.较好的行业集中度及行业地位，具备独特的核心竞争优势企业在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势。

D.具备中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力，企业的主营产品或服务具有良好的市场前景，在产品/服务提供方面具有成本优势，拥有出色的销售机制、体系及团队等；此外，应具备较强的技术创新能力，并保持足够的研发投入，以推动企业的持续发展等。

其次，本基金在构建投资组合时，强调两端投资，价值与成长性能平衡，兼顾价值与成长型股票，以均衡资产混合策略建立动力资产组合，努力克服单一风格投资所带来的局限性，这样可以较好控制组合市场适应性，一定程度上能够排除对景气误判概率，以求多空环境中都能创造主动管理回报。

其中，价值型股票是在寻找具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业的基础上，根据PB、PE综合排序，得到价值特征的股票排序，按照顺序由高到低，在100分到0分之间打分。成长型股票是主要根据公司的PEG、ROE进行评价并打分。按照排序情况，从高到低的依次打分，在100分和0分之间打分。

对上述股票池中的企业进行价值型和成长型的评价，由行业研究员根据所研究的行业，对覆盖的个股进行评价。

最后，对于所评价的个股的价值型特征和成长型特征进行排序，在对每个公司的价值属性和成长属性进行打分的基础上，将每个企业的两种属性进行综合考虑，取两者的平均打分作为该公司的投资价值属性的打分，即投资价值打分=（成长属性打分+价值属性打分）/2，得到每个公司的投资价值的排序，选取投资价值在前300以内的公司作为本基金的股票池。建立基金组合时，根据每个月的基金资产配置要求，按照行业配置的需要，在风险预算的基础下，在每个行业中选取投资价值打分居前的公司进行选择并择时介入。同时，在每个季度后，根据最新的股票价格进行股票池的更新，包括优势企业的更新、价值型和成长型的评价更新，再根据基金资产配置要求，进行再平衡。

2.构建股票组合

本基金在构建股票组合时体现三大特点：

（1）兼顾价值成长组合平衡的优化资产组合

本基金在构建投资组合时，强调两端投资，价值与成长性能平衡，兼顾价值与成长型股票，以均衡资产混合策略建立动力资产组合，努力克服单一风格投资所带来的局限性，这样可以较好控制组合市场适应性，一定程度上能够排除对景气误判概率，以求多空环境中都能创造主动管理回报。

（2）进行投资组合风险预算，实现积极控制风险为前提的积极投资管理

本基金追求超越业绩基准的相对收益，对投资组合进行风险预算的方法是采用行业偏离度和VaR体系。行业偏离度是衡量基金组合的整体配置的均衡程度，适度的行业偏离度有助于提高收益率，但同时要避免过重的行业偏离度，追求长期稳定的净值增长；VaR体系则是从基金组合整体上对组合进行量化风险预算，对于组合整体风险暴露程度较大的，要求基金经理根据边际VaR进行调整。

本基金借助宝盈客观化投研平台，在积极运用先进的资产配置、组合管理和风险管理的基础上，更为强调择时择股的主动管理能力，更多地关注具有价值成长意义的个股，以提高投资组合管理的效率。同时，另一方面坚决控制风险暴露，优化投资组合的风险收益结构。在管理投资组合时，既要重视精选个股，同时更应该运用数量分析方法，时时了解该组合的风险暴露情况，通过适时调整投资组合的配置，来优化投资组合的风险收益结构。

（3）以稳健正收益为目标的长期投资管理

中国经济未来十年的稳定增长是中国证券市场发展的基石，本基金属于较高风险较高收益品种，旨在通过构建均衡资产混合策略建立动力资产组合，提高资产配置的效率，实现持续跑赢基准一定比例的投资目标，从而将中国经济长期增长的潜力最大程度地转换为投资者的累计正收益。证券市场的周期波动性恰恰凸显了长期投资的重要性，长期持有具有稳定收益特征的投资产品将帮助投资者最终取得丰厚的投资回报，充分享受中国经济稳健增长的收益。

（三）债券投资策略

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。

（1）利率预期策略下的债券选择

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益，例如预期利率下调时适当加大长久期债券的投资比例，为债券组合赢得价格收益；预期利率上升时减少长久期债券的投资，降低基金债券组合的久期，以控制利率风险。

（2）收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。基金管理人通过预测收益率曲线形状的变化，调整长久期债券组合内部品种的比例获得投资收益。

（3）信用度分析

信用度分析是企业债的投资策略。基金管理人通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行更细致的调研，准确评价债券的违约概率和提早预测债券评级的改变，从而取得价格优势或进行套利。

（4）收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下，比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

（5）相对价值评估

基金管理人运用该种策略的目的在于识别被市场错误定价的债券，并采取适当的交易以期获利。一方面基金管理人通过利率期限结构，评估处于同一风险层次的多只债券中，究竟哪些更具投资价值，另一方面，通过综合考察债券等级、息票率、所属行业、可赎回条款等因素对率差的影响，评估风险溢价。

（三）投资决策程序

见图9-2。

1.决策依据

（1）国内国际宏观经济环境；

（2）国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策；

（3）证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况；

（4）上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势；

（5）上市公司盈利能力、增长能力和创新能力，以及对公司综合价值的评估结论；

（6）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2.决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略；

（2）研究部根据自身或者其他研究机构的研究成果，构建各级股票池，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持；

（3）基金管理部根据投资决策委员会的投资战略，在研究支持下，结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟订所辖基金的具体投资计划，包括：资产配置、策略配置、行业配置、重仓个股投资方案；

（4）投资决策委员会对基金管理部提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；

（5）金融工程研究中心定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

3.投资操作程序

（1）在确定基金投资组合方案后，基金经理在投资组合方案和授权范围内，进行具体买卖决策，并向集中交易室下达统一规范、标准化的交易指令，实现证券品种的日常买卖；

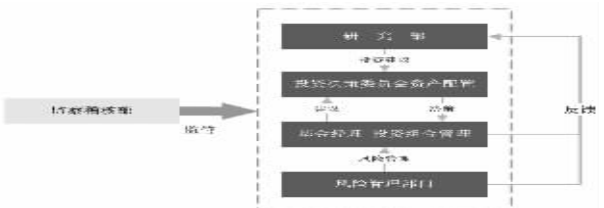
（2）基金经理可以采用书面方式、电脑方式或电话录音方式下达委托交易指令，并采用书面方式或电子化方式记录，存档备案；基金经理不可以直接进行证券品种的交易；

（3）集中交易室的集中接单员接到基金经理的交易指令后，对其是否符合基金经理的权限和公司投资限制性指标进行审核；如符合，则分发到交易员执行，如不符合，则拒绝执行，并向风险控制执行官汇报审核；

（4）交易员执行经审核的交易指令，并将执行结果反馈基金经理；基金经理根据市场情况可以对投资指令进行调整；

（5）本基金管理人根据有关法律、法规、监管机构要求和公司内部管理制度，制定了一系列投资限制性指标，这些指标通过参数设置到投资管理系统，如果买卖指令与指标冲突，系统自动拒绝执行。

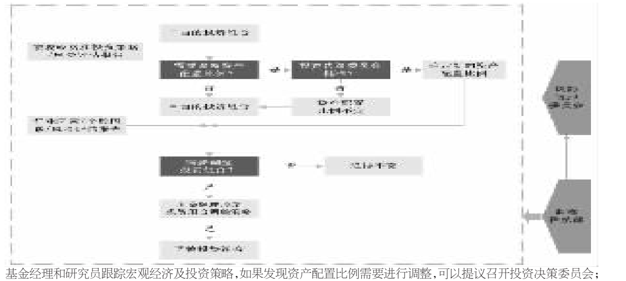
图9-2 公司投资决策流程图



（四）投资组合分析与调整

公司投资组合调整过程如图9-3。

图9-3 投资组合调整过程图



基金经理和研究员跟踪宏观经济及投资策略，如果发现资产配置比例需要进行调整，可以提议召开投资决策委员会；

投资决策委员会集体决策是否调整资产配置比例；

如果投资决策委员会不调整资产配置比例，基金经理只能在原来规定的资产配置比例内考虑是否调整投资组合；如果投资决策委员会调整资产配置比例，基金经理根据调整后的比例考虑调整投资组合；

行业研究员跟踪行业和个股因素，对已有的投资组合和股票池中股票进行动态评级，提出投资建议；基金经理对投资组合进行跟踪，参考研究员的投资建议，作出投资组合调整策略；

监察稽核部对投资组合调整的合规性和组合调整是否严格执行相应的流程进行实时监控。

## 九、基金的业绩比较基准

沪深300指数×65%+上证国债指数×35%

如果今后市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的复合指数权重比例，本基金将根据实际情况对业绩比较基准予以调整。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，并在更新的招募说明书中列示。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是一只灵活配置混合型基金，属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险预算范围内追求收益最大化。。

## 十一、基金投资组合报告（截止2011年6月30日）

1.期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 56,179,600.00 | 54.81 |
|  | 其中：股票 | 56,179,600.00 | 54.81 |
| 2 | 固定收益投资 | 17,779,550.00 | 17.35 |
|  | 其中：债券 | 17,779,550.00 | 17.35 |
|  | 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 | 27,539,550.79 | 26.87 |
| 6 | 其他资产 | 1,003,154.63 | 0.98 |
| 7 | 合计 | 102,501,855.42 | 100.00 |

2.期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 1,918,800.00 | 1.90 |
| B | 采掘业 | 3,935,000.00 | 3.90 |
| C | 制造业 | 13,631,100.00 | 13.50 |
| C0 | 食品、饮料 | 2,180,000.00 | 2.16 |
| 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 | 2,185,000.00 | 2.16 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 9,266,100.00 | 9.18 |
| 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 | 5,768,000.00 | 5.71 |
| E | 建筑业 | 7,166,000.00 | 7.10 |
| F | 交通运输、仓储业 | – | – |
| G | 信息技术业 | 11,937,700.00 | 11.82 |
| H | 批发和零售贸易 | – | – |
| I | 金融、保险业 | 11,823,000.00 | 11.71 |
| 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 | 56,179,600.00 | 55.63 |

3.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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600050 | 中国联通 | 1,180,000 | 6,195,000.00 | 6.13 |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 800,000 | 5,768,000.00 | 5.71 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 100,000 | 4,827,000.00 | 4.78 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 1,100,000 | 4,433,000.00 | 4.39 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 300,000 | 4,044,000.00 | 4.00 |
| 6 | 000680 | 山推股份 | 200,000 | 3,518,000.00 | 3.48 |
| 7 | 600198 | 大唐电信 | 210,000 | 2,984,100.00 | 2.95 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 300,000 | 2,952,000.00 | 2.92 |
| 9 | 600970 | 中材国际 | 100,000 | 2,733,000.00 | 2.71 |
| 10 | 600348 | 阳泉煤业 | 100,000 | 2,414,000.00 | 2.39 |

4.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 | 17,779,550.00 | 17.60 |
| 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 | – | – |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 17,779,550.00 | 17.60 |

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

| 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 | 010203 | 02国债(3) | 90,000 | 8,898,300.00 | 8.81 |
| 2 | 010110 | 21国债(10) | 50,000 | 4,991,000.00 | 4.94 |
| 3 | 010112 | 21国债(12) | 39,000 | 3,890,250.00 | 3.85 |

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.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。

8.投资组合报告附注

（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、处罚的情形。

（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。

（3）其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 750,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 243,074.09 |
| 5 | 应收申购款 | 10,080.54 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,003,154.63 |

（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。

（5）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。

（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。

## 十二、基金的业绩

本基金合同生效日为2009年3月17日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：（截止2011年6月30日）：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2009年3月17日-2009年12月31日 | 20.44% | 1.22% | 37.17% | 1.27% | -16.73% | -0.05% |
| 2010年度 | -5.19% | 1.34% | -6.64% | 1.03% | 1.45% | 0.31% |
| 2011年上半年 | -7.67% | 0.87% | -0.94% | 0.80% | -6.73% | 0.07% |
| 过去三个月 | -6.81% | 0.68% | -3.32% | 0.71% | -3.49% | -0.03% |
| 自基金成立至今 | 5.44% | 1.21% | 26.85% | 1.08% | -21.41% | 0.13% |

## 十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

4、基金合同生效以后的信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

7、基金的资金汇划费用；

8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times1.5\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times0.25\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第3至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

（二）与基金销售有关的费用

1.申购费

| 费 用 | 费率（设申购金额为M） |  |
|---|---|---|
| 申购费 | M<100万元 | 1.5% |
|  | 100万元≤M<500万元 | 0.9% |
|  | 500万元≤M<1000万元 | 0.3% |
|  | M≥1000万元 | 固定费用1000元 |

基金管理人有权规定投资者在赎回基金份额时收取该部分基金份额的申购费用，具体办理规则和费率由基金管理人届时在公告或更新的招募说明书中明确后执行。

2.赎回费

本基金的赎回费用按持有期递减，最高不超过赎回总金额的0.50%。赎回费用的75%作为注册登记费，剩余25%留作基金资产。具体费率如下：

| 费 用 | 费率 |  |
|---|---|---|
| 赎回费 | 持有年限为1年以内 | 0.5% |
|  | 持有年限满1年不满2年 | 0.25% |
|  | 持有年限满2年及以上 | 0 |
|  | 赎回费用总额的25%留作基金资产 |  |

3.转换费

本公司直销柜台及代销机构申购补差费率表：

| 转出基金 | 转入基金 | 转换金额 | 申购补差费率 |
|---|---|---|---|
| 宝盈鸿利收益混合（213001） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0 |
|  |  | 500万元≤M<<1000万元 | 0 |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
| 宝盈泛沿海增长股票（213002） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0 |
|  |  | 500万元≤M<<1000万元 | 0 |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
| 宝盈策略增长股票（213003） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0 |
|  |  | 500万元≤M<<1000万元 | 0 |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
| 宝盈资源优选股票（213008） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0 |
|  |  | 500万元≤M<<1000万元 | 0 |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
| 宝盈核心优势混合（213006） | 宝盈鸿利收益混合（213001） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0.30% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.30% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
|  | 宝盈泛沿海增长股票（213002） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0.40% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.50% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
|  | 宝盈策略增长股票（213003） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0.60% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.60% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
|  | 宝盈资源优选股票（213008） | M<100万元 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0 |
|  |  | 500万元≤M<<1000万元 | 0 |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |
|  | 宝盈增强收益债券（213007） | M<100万 | 0 |
|  |  | 100万≤M<300万 | 0 |
|  |  | 300万≤M<500万 | 0 |
|  |  | M≥500万元 | 0 |
|  | 宝盈增强收益债券C（213917） | M≥100份×申请受理当日转出基金的基金份额净值 | 0 |
|  | 宝盈货币（A类：213009，B类：213909） | M≥100份×申请受理当日转出基金的基金份额净值 | 0 |
|  | 宝盈中证100指数增强（213010） | M<100万 | 0 |
|  |  | 100万≤M<300万 | 0 |
|  |  | 300万≤M<500万 | 0 |
|  |  | M≥500万元 | 0 |
| 宝盈增强收益债券（213007） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万 | 0.70% |
|  |  | 100万≤M<300万 | 0.40% |
|  |  | 300万≤M<500万 | 0.60% |
|  |  | 500万≤M<1000万 | 0.30% |
|  |  | 1000万≤M | 0 |
| 宝盈增强收益债券C（213917） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万 | 1.50% |
|  |  | 100万≤M<500万 | 0.90% |
|  |  | 500万≤M<1000万 | 0.30% |
|  |  | M≥1000万 | 固定费用1000元 |
| 宝盈货币（A类：213009，B类：213909） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万 | 1.50% |
|  |  | 100万≤M<500万 | 0.90% |
|  |  | 500万≤M<1000万 | 0.30% |
|  |  | M≥1000万 | 固定费用1000元 |
| 宝盈中证100指数增强（213010） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万 | 0.30% |
|  |  | 100万≤M<300万 | 0.1% |
|  |  | 300万≤M<500万 | 0.6% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.3% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 |

本公司爱宝网网上直销申购补差费率表：

| 转出基金 | 转入基金 | 转换金额 | 爱宝网网上直销转换补差 |  |  |
|---|---|---|---|---|---|
|  |  |  | 工行卡/建行卡/招行卡 | 农行卡 | 银联通［1］/好易联［2］/平安银行卡/汇付"天天盈" |
| 宝盈鸿利收益混合（213001）<br>宝盈泛沿海增长股票（213002）<br>宝盈策略增长股票（213003）<br>宝盈资源优选股票（213008） | 宝盈核心优势混合（213006） | M≥100份×申请受理当日转出基金的基金份额净值 | 0 | 0 | 0 |
| 宝盈核心优势混合（213006） | 宝盈鸿利收益混合（213001） | M<100万元 | 0 | 0 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<1000万元 | 0.24% | 0.21% | 0.12% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 | 0 | 0 |
|  | 宝盈泛沿海增长股票（213002） | M<100万元 | 0 | 0 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0.32% | 0.28% | 0.16% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.40% | 0.35% | 0.20% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 | 0 | 0 |
|  | 宝盈策略增长股票（213003） | M<100万元 | 0 | 0 | 0 |
|  |  | 100万元≤M<1000万元 | 0.48% | 0.42% | 0.24% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 | 0 | 0 |
|  | 宝盈资源优选股票（213008）<br>宝盈增强收益债券A/C类（213007，213917）<br>宝盈货币A/B（213009，213909）<br>宝盈中证100指数增强（213010） | M≥100份×申请受理当日转出基金的基金份额净值 | 0 | 0 | 0 |
| 宝盈增强收益增强A（213007） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 0.56% | 0.49% | 0.28% |
|  |  | 100万元≤M<300万元 | 0.32% | 0.28% | 0.16% |
|  |  | 300万元≤M<500万元 | 0.48% | 0.42% | 0.24% |
|  |  | M≥500万元 | 0 | 0 | 0 |
| 宝盈货币A/B（213009，213909） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 1.20% | 1.05% | 0.60% |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0.72% | 0.63% | 0.36% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.24% | 0.21% | 0.12% |
|  |  | M≥1000万元 | 1000元/笔 | 1000元/笔 | 1000元/笔 |
| 宝盈中证100指数增强（213010） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 0.24% | 0.21% | 0.12% |
|  |  | 100万元≤M<300万元 | 0.08% | 0.07% | 0.04% |
|  |  | 300万元≤M<500万元 | 0.48% | 0.42% | 0.24% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.24% | 0.21% | 0.12% |
|  |  | M≥1000万元 | 0 | 0 | 0 |
| 宝盈增强收益债券C（213917） | 宝盈核心优势混合（213006） | M<100万元 | 1.20% | 1.05% | 0.60% |
|  |  | 100万元≤M<500万元 | 0.72% | 0.63% | 0.36% |
|  |  | 500万元≤M<1000万元 | 0.24% | 0.21% | 0.12% |
|  |  | M≥1000万元 | 1000元/笔 | 1000元/笔 | 1000元/笔 |

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"三、基金管理人（一）基金管理人概况（三）主要人员情况"部分，更新了公司高级管理人员等相关内容；对"（六）基金管理人的内部控制制度"部分进行了更新。

2、更新了"四、基金托管人"相应内容。

3、在"五、相关服务机构"部分，更新了各代销机构的相应内容，新增东莞农村商业银行为代销机构。

4、在"八、基金份额的申购和赎回"部分，更新了基金转换费率的相应内容。

5、在"九、基金的投资"部分，更新了本基金投资组合报告的内容。

6、在"十、基金的业绩"章节，更新了基金合同生效以来的投资业绩。

7、在"二十二、其他应披露事项"里，增加新增电子渠道费率优惠公告、新增代销机构及费率优惠公告、停牌股票估值提示性公告、新增直销渠道费率优惠公告、新增代销机构转换及定投业务公告。

**宝盈基金管理有限公司**
**二〇一一年十一月一日**