宝盈策略增长股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈策略增长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2006年9月28日证监基金字2006[195]号文批准公开发售。本基金基金合同于2007年1月19日正式生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人保证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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2013年7月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30日。基金托管人中国农业银行对本招募说明书(更新)中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

1、基金管理人基本情况

名称：宝盈基金管理有限公司
注册地址：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
成立时间：2001年5月18日
法定代表人：李建生
总经理：汪钦
办公地址：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
注册资本：10000万元人民币
电话：0755—83276688
传真：0755—83515599
联系人：王中宝

2、基金管理人股权结构及组织结构

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。

公司下设投资部、固定收益部、海外投资部、特定客户资产管理部、研究部、金融工程部、集中交易部、市场部、营销中心、电子商务部、信息技术部、基金事务部、监察稽核部、公司财务部、总经理办公室等15个部室和北京办事处、上海办事处；此外，还设立了投资决策委员会和风险管理委员会。

（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，高级会计师、注册会计师、企业法律顾问。2000年1月至2002年12月任中铁工总会计师，2002年12月至2007年9月任中铁工总会计师、总法律顾问，2005年5月至2009年12月兼任中铁信托有限责任公司董事长，2007年9月至今任中国中铁股份有限公司副总裁、财务总监、总法律顾问，2011年6月至今任安徽昊方机电股份有限公司独立非执行董事。

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、投资发展部总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司董事会秘书。

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，兼任福建星网锐捷公司独立董事。

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、莱宝高科的独立董事。

汪钦先生，董事，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

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金融同业部总经理。

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、研究部总监。目前，其担任宝盈基金管理有限公司总经理助理兼鸿阳证券投资基金基金经理。

（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

余述胜先生：1967年出生，金融学博士，15年基金从业经历。1998年3月至2007年10月就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、投资部副总监、交通运输行业首席分析师。2007年11月加入宝盈基金管理有限公司，历任投资部副总监、研究部执行总监。现任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。

宝盈策略增长股票型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：
盛军锋，2009年7月1日至2011年4月19日。
赵龙，2007年1月19日至2009年6月30日。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

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鸿阳证券投资基金基金经理。
段鹏程先生：宝盈基金管理有限公司研究部总监。
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。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
法定代表人：蒋超良
成立时间：2009年1月15日
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-63201510
传真：010-63201816
联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截至2013年7月19日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共164只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理价值增长股票型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

本基金份额发售机构包括宝盈基金管理有限公司及其委托的代销机构。目前的代销机构为中国农业银行、中国建设银行、中国工商银行、中国银行、交通银行、招商银行、中信银行、民生银行、北京银行、平安银行、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、西南证券、中信金通证券、万联证券、国元证券、渤海证券、中信万通证券、东吴证券、东方证券、长城证券、国联证券、浙商证券、平安证券、国都证券、东海证券、国盛证券、华西证券、宏源证券、齐鲁证券、第一创业证券、金元证券、中航证券、中投证券、天源证券、厦门证券、世纪证券、中金公司、信达证券、英大证券、华福证券、光大证券、天相投顾、华泰证券、东莞农村商业银行、五矿证券、上海长量基金销售、深圳众禄基金销售、数米网、天天基金网、好买基金销售、中期时代基金销售。

宝盈基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

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：陈坤

2、代销机构

（1）中国农业银行
联系地址：北京市东城区建国门内大街69号
客户服务电话：95599
公司网址：www.abchina.com

（2）中国建设银行
联系地址：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

（3）中国工商银行
联系地址：北京市西城区复兴门内大街55号
客户服务电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

（4）中国银行
联系地址：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

（5）交通银行
联系地址：上海市仙霞路18号
客户服务电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（6）招商银行
联系地址：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

（7）中信银行
联系地址：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

（8）民生银行
联系地址：北京市西城区复兴门内大街2号
客户服务电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

（9）北京银行
联系地址：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：www.bankofbeijing.com.cn

（10）平安银行
联系地址：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www.18ebank.com

（11）国泰君安证券
联系地址：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

（12）中信建投证券
联系地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
客户服务电话：4008888108
公司网址：www.csc108.com

（13）国信证券
联系地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
客户服务电话：8008108868
公司网址：www.guosen.com.cn

（14）招商证券
联系地址：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

（15）广发证券
联系地址：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

（16）中信证券
联系地址：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.ectitic.com

（17）银河证券
联系地址：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

（18）海通证券
联系地址：上海市淮海中路98号
客户服务电话：4008888001
公司网址：www.htsec.com

（19）申银万国证券
联系地址：上海市常熟路171号
客户服务电话：021-962505
公司网址：www.sywg.com.cn

（20）兴业证券
联系地址：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

（21）长江证券
联系地址：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

（22）安信证券
联系地址：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

（23）西南证券
联系地址：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

（24）中信金通证券
联系地址：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

（25）万联证券
联系地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
客户服务电话：4008888133
公司网址：www.wlzq.com.cn

（26）国元证券
联系地址：安徽省合肥市寿春路179号
客户服务电话：4008888777
公司网址：www.gyzq.com.cn

（27）渤海证券
联系地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
客户服务电话：4006515988
公司网址：www.bhzq.com

（28）中信万通证券
联系地址：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

（29）东吴证券
联系地址：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

（30）东方证券
联系地址：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

（31）长城证券
联系地址：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

（32）国联证券
联系地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层
客户服务电话：95570
公司网址：www.glsc.com.cn

（33）浙商证券
联系地址：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

（34）平安证券
联系地址：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

（35）国都证券
联系地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
客户服务电话：400-818-8118
公司网址：www.guodu.com

（36）东海证券
联系地址：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

（37）国盛证券
联系地址：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

（38）华西证券
联系地址：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

（39）宏源证券
联系地址：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

（40）第一创业证券
联系地址：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.fcsc.com

（41）金元证券
联系地址：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

（42）中航证券
联系地址：江西省南昌市抚河北路291号
客户服务电话：0791-6768763
公司网址：www.scstock.com

（43）中投证券
联系地址：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-21层
客户服务电话：4006008008
公司网址：www.china-invs.cn

（44）天源证券
联系地址：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

（45）厦门证券
联系地址：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

（46）世纪证券
联系地址：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

（47）中金公司
联系地址：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

（48）信达证券
联系地址：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

（49）齐鲁证券
联系地址：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

（50）英大证券
联系地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
客户服务电话：0755-26982993
公司网址：www.vsun.com

（51）华福证券
联系地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
客户服务电话：0591-96326
公司网址：www.hfzq.com.cn

（52）天相投顾
联系地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701
客户服务电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com

（53）光大证券
联系地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼
客户服务电话：4008888788
公司网址：www.ebscn.com

（54）华泰证券
联系地址：南京市中山东路90号华泰证券大厦
客户服务电话：4008888168
公司网址：www.htsc.com.cn

（55）东莞农村商业银行
联系地址：东莞市南城路2号
客户服务电话：961122
公司网址：www.drcbank.com

（56）五矿证券
联系地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47层
客户服务电话：40018-40028
公司网址：www.wkzq.com.cn

（57）上海长量基金销售
联系地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
客户服务电话：021-58788678
公司网址：www.e-rich.com.cn

（58）深圳众禄基金销售
联系地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25层
客户服务电话：4006788887
公司网址：www.jjmmw.com

（59）上海天天基金销售
联系地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
客户服务电话：4001818188
公司网址：www.1234567.com.cn

（60）杭州数米基金销售
联系地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
客户服务电话：4000766123
公司网址：www.fund123.cn

（61）国海证券
联系地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
客户服务电话：0771-5539032
公司网址：www.ghzq.com.cn

（62）好买基金销售
联系地址：上海市浦东新区浦东南路1118号903-906室
客户服务电话：400-700-9665
公司网站：www.ehowbuy.com

（63）中期时代基金销售
联系地址：北京市 朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
客户服务电话：95162
公司网站：www.cifcofund.com

（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（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
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
经办注册会计师：单峰、张晓艺
联系人：魏佳亮

四、基金的名称

本基金名称：宝盈策略增长股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式股票型基金

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，本基金力求通过综合运用多种投资策略优选股票，分享中国经济和资本市场高速增长的成果，在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续稳健增值，并力争获取超过比较基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金的主要投资范围是基本面良好、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通过综合运用多种投资策略优选出的投资价值较高的上市公司股票。

本基金财产中股票投资比例的变动范围为60%~95%，债券投资比例的变动范围为0~35%；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%。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

本基金为股票型基金，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，其中股票配置比例为60-95%，债券比例0-35%，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%，权证等新的金融工具在法律法规允许的范围内进行投资，不需要召开基金份额持有人大会同意。

（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

本基金股票投资采用股票池制度，各级股票池的产生流程均构建于上市公司评级基础之上，根据上市公司的业绩、规模、行业地位、核心竞争力以及未来发展预期等因素，把上市公司分为“优质公司”、“一般公司”、“劣质公司”以及“问题公司”，在公司评级库基础上按照公司规定的程序经投资决策委员会审核批准产生备选股票池、核心股票池及限制股票池。

1. 公司股票池的构建程序

首先根据对上市公司的评级建立“公司评级库”，在公司评级库的基础上，通过进行全面深入的研究分析，经由投资部开会讨论，就股票的基本面、业绩与成长性、内在价值与潜在风险进行严格的答辩，拟定公司“备选股票池”。备选股票池名单须经投资决策委员会审批同意后方可执行。对进入备选股票池的股票，行业研究员必须确保定期跟踪和维护。定期跟踪的内容包括：至少每半年一次对公司进行深度调研并提交调研简报；每季度、每半年、每年提交相应的季报、中报、年报点评。

在备选股票池的基础上，经过严格的答辩产生“核心股票池”，对进入核心股票池名单的上市公司要求研究员必须定期提交实地调研的深度研究报告。核心股票池名单须经投资决策委员会审批同意后方可执行。

为了更好的控制风险，对于已经进入备选股票池、核心股票池并且纳入基金投资组合的个股，由于已经接近、达到预期估值上限或者基于行业集中度等因素的考虑，投资决策委员会又在备选股票池和核心股票池的基础上设立“限制股票池”。

本基金管理人投资决策委员会规定，基金的投资组合只能从“备选股票池”和“核心股票池”中产生，并制定了相应的投资权限限制。

公司评级库依据以下要素建立：

⑴定性分析。

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。

⑵定量分析。

在选择个股时充分利用上市公司的财务数据，从上市公司的盈利能力、成长能力、运营能力、负债水平等各个方面进行量化筛选。量化指标主要包括以下几类：

A. 盈利能力指标：主要包括净资产收益率、主营业务利润率、资产净利率、新项目的内部收益率。
B. 成长能力指标：主要包括长期主营业务收入增长率、长期利润增长率。
C. 运营能力指标：主要包括总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率。
D. 负债水平指标：主要包括资产负债率、流动比率、速动比率。

（3）估值

根据企业业绩的长期增长趋势以及同类企业的平均估值水平，采用的估值模型包括资产重置价格、市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、经济价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、现金流贴现法（DCF），比较分析方法包括横向比较及纵向比较。

2. 本基金股票池的构建

主题投资策略、价值成长策略和价值反转策略互相配合以构成本基金的整体股票投资策略，三种投资策略的投资权重大致平均分配，在考虑行业大致均衡配置的前提下，重叠的个股加大权重。本基金管理人将根据国际经济、国内经济、经济政策、股市结构、股市政策等方面因素的综合考虑，根据投资部提供并经投资决策委员会批准的投资策略对各投资策略的投资权重进行微调。

通过对成熟市场各种投资风格的研究分析，我们选择了这三种投资策略作为我们主要的股票投资策略。

对于正在走向市场化并日益与国际资本市场接轨的中国证券市场来说，股票投资策略研究还是一个新的课题。关于具体的风格与量化投资策略则可以说是举不胜举。目前在中国的股票市场上，对于投资风格的划分以及具体选股条件方面还没有业内一致认同的标准。不过，在成熟的资本市场，如美国，关于投资风格特性的标准在经过长期的实际跟踪，已经形成比较科学系统的划分。从整体投资策略的角度来看，投资风格大致可以分为四类，分别是价值型、价值成长型、成长型和特殊型。这四种（本质上有代表性的是前三种）不同的投资风格不仅在股票特性上有本质的区别，而且在实际的投资组合管理和业绩回报方面具有各自的典型特征。本基金管理人通过对这些投资策略在收益回报、波动性、风险水平、股票流动性等几个方面的实证业绩分析，选择主题投资策略、价值成长策略和价值反转策略作为我们的主要投资策略。

由于中国经济处于与世界经济接轨的巨大变革中，其制度性变革以及实体经济的结构性变化将带来重大的主题投资机会。

价值成长型策略注重以合理的价格来选择成长性公司进行投资。该策略强调所投资公司盈利及销售收入增长的持续性以及市盈率的相对合理性，总回报水平相对突出，组合收益的波动性基本处于相对合理水平，唯一影响实际操作的是流动性。

价值反转策略强调公司持续的现金创造和周转能力，现金管理和现金制造能力强的公司不仅在经济扩张阶段有较强的发展能力，而且在经济收缩阶段能保存实力以及扩张能力，并在经济进入恢复后迅速提升自身的获利能力。这是这种策略在牛市和熊市都能有较好表现的根本原因。从总体风险回报水平来看，价值反转策略表现出比各类指数更优的标准偏差。

正是由于三种投资策略在股票选择、收益风险等方面具有不同的特征，以及某种程度上的互补性，因此，对三种不同的投资策略进行有效配置，采取优选组合，既可以把风险控制在预算之内，又可以通过对不同的投资策略的风险设定分析，在不增加风险的基础上通过积极的策略优选组合获取超额收益。

在公司股票池的基础上，按三种投资策略筛选出符合本基金投资标准的具有投资价值的股票，组成本基金的各级股票池。

（1）主题投资策略

主题投资策略是通过分析实体经济中结构性、周期性及制度性变动趋势，挖掘出对经济变迁具有大范围影响的潜在因素，对受益于该潜在因素的行业和公司进行投资。

投资主题主要有以下方面：世界经济及国内经济变动趋势、制度变革、产业整合、城市化、消费升级、人民币升值、新农村建设等。

本基金主题投资分析所遵循的步骤如下：

①首先寻找世界经济和国内经济、制度变革等经济和社会结构变动的驱动因素，分析驱动因素即将发生的转变。

②寻找将能够从这种趋势中受惠的公司纳入投资范围：即找出充分代表或体现该投资主题的公司，经过周密调查研究后建立主题投资组合。

（2）价值成长策略

价值成长策略主要投资的对象是成长型股票，但其相对价值被低估，通过长期持有以分享其高成长性所带来的收益。本基金通过定性和定量分析寻找合适的投资对象。

定量选股指标包括净值产收益率和PEG相结合选择股票

净资产收益率（Rate of Retern on Common Stockholders' Equity, 简称ROE）。ROE作为判断上市公司盈利的一项重要指标计算公式为：净资产收益率=净利润／平均股东权益。净资产收益率是衡量上市公司盈利能力的重要指标，是指利润额与平均股东权益的比值，该指标越高，说明投资带来的收益越高。在公司的股票池中选出适用于价值投资的股票，主要判断标准是长期能给股东带来资本回报的公司，这里选取历史ROE(每年不低于6%)作为选择基础指标。

同时结合应用（P/E）/G作为定量标准能够较好的兼顾目前投资价值与未来成长潜力之间的平衡的投资思路。（P/E）/G的基本含义是：相对较高的P/E值只有在足够成长潜力支撑基础上才是可以接受的，即用它可以找出相对于盈利增长率来说市盈率较低的股票。我们的目标是要在市场认识到公司成长潜力而抬高股价之前，能够确认这只股票的盈利增长率，从而以低价买进。

本基金通过历史的和预期的增长率分别计算（P/ E）/G 。选用历史增长率的（P/ E）/G，在给定他们已有的成长性表现下，能够突出那些定价合理的股票。这样可以在较宽的范围内挑选出公司。单纯依赖历史成长性数据得出的结果也有其弱点，因为市场是向前看的，历史上良好的数据并不代表未来能够继续保持良好的成长速度，因此还要选用预期增长率的（P/ E）/G，在给定预期增长率的条件下，能够突出那些拥有合理市盈率的股票。但是由于在对公司长期成长性做预期时容易表现得过于乐观，从而给予股票过高的盈利预期，因此综合考虑历史和预期的（P/ E）/G能够得到更为全面的结果。

在选择股票时，应重视股票目前投资价值与成长潜力之间的平衡，既要有效的规避目前股票价格高企的风险，又要具备高速成长的潜在优势。此类股票，会有潜在的两个收益渠道：没有考虑成长潜力下，价值回归中的投资收益；成长潜力释放带来的价值增长。

②定性分析：宏观环境，行业前景，公司治理结构等因素

分析产业在国民经济中的地位、宏观经济周期所处阶段、宏观政策以及产业政策等因素，判断公司主业成长空间；

在行业前景方面，分析公司所处行业的生命周期以及产业竞争结构，对公司未来盈利成长的关键驱动因素进行考察；

在公司治理结构方面，通过研究管理团队的历史业绩、决策力、开拓性、稳定性确定公司是否具有将未来成长性转化为现实成长性的潜质。

（3）价值反转策略

价值反转策略主要投资的对象为相对价值被低估的价值型股票，待其价值回归后沽出获利。

①定量分析

根据主营业务利润率的变化选出反转投资的股票，构建投资组合。

②定性分析

然后基金管理人将对选出股票的“低价因素”进行合理分析，从中找到基本面素质较好，股价可望在短时间内回归的公司。重点考察以下几个因素：

行业因素：包括行业特性，行业近年来的发展动态，替代产品的发展，国家特殊的行业政策，国际市场的变化情况等。

公司因素：公司在行业中的地位和竞争优势，公司有关经济效益指标与行业平均水平或可比相关公司的比较，在建及计划投资项目的产品市场、收益预测及主要影响因素、未来3 年内新项目的利润贡献预测等。

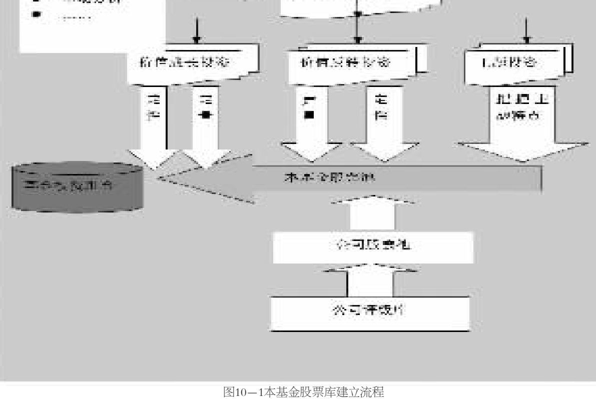

图10—1本基金股票库建立流程

3. 构建股票组合

在各级股票池的基础上，根据投资程序，基金经理小组通过对各投资策略的判断，进行最终的股票组合构建。在构建股票组合时需要做到：

三大投资策略相辅相成，通过对不同的投资策略的风险设定分析，在风险预算范围内对不同策略的进行有效配置组合，力争战胜业绩比较基准，在不增加风险的基础上通过积极的策略优选组合获取超额收益；

对于同时符合三大投资策略的个股，在保持行业比例配置偏离度正常的范围内，可适当增加配置比例，以获取超额收益。

（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。

九、基金的业绩比较基准

上证A股指数×75%＋上证国债指数×20%＋同期银行一年定期存款利率×5%

当作为本基金业绩比较基准的指数因中断编制等原因或市场出现更合适的新指数时，本基金业绩比较基准将做适时调整。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，风险水平和期望收益水平相对较高。

十一、基金投资组合报告（截至2013年6月30日）

（一）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	1,585,394,900.13	87.33
	其中：股票	1,585,394,900.13	87.33
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	59,000,124.50	3.25
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	169,835,555.23	9.35
7	其他各项资产	1,235,039.05	0.07
8	合计	1,815,465,618.91	100.00

（二）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	131,783,368.28	7.50
C	制造业	1,128,849,361.50	64.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,625,147.00	1.34
E	建筑业	35,712,213.12	2.03
F	批发和零售业	114,261,422.72	6.50
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	20,250,438.75	1.15
J	金融业	–	–
K	房地产业	100,636,948.76	5.73
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	30,276,000.00	1.72
S	综合	–	–
	合计	1,585,394,900.13	90.20

（三）基金投资前十名股票明细

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	600518	康美药业	5,500,020	105,765,384.60	6.02
2	600104	上汽集团	6,800,077	89,829,017.17	5.11
3	000423	东阿阿胶	2,300,000	88,964,000.00	5.06
4	600048	保利地产	8,000,022	79,280,218.02	4.51
5	600547	山东黄金	2,900,000	70,470,000.00	4.01
6	600690	青岛海尔	6,000,033	65,460,360.03	3.72
7	600489	中金黄金	6,599,932	61,313,368.28	3.49
8	600059	古越龙山	4,678,249	52,489,953.78	2.99
9	002048	宁波华翔	5,880,000	49,156,800.00	2.80
10	600699	均胜电子	2,850,000	35,967,000.00	2.05

（四）按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）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。

（六）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。

（七）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。

（八）投资组合报告附注

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(元)
1	存出保证金	646,384.73
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	521,670.47
4	应收利息	59,770.43
5	应收申购款	7,213.42
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,235,039.05

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、报告期末前十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	600547	山东黄金	70,470,000.00	4.01	资产重组

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2007年1月19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：(截至2013年6月30日)

阶段	净值增长率①	净值增长标准差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
2007年1月19日至2007年12月31日	83.55%	1.89%	64.02%	1.63%	19.53%	0.26%
2008年度	-51.01%	2.06%	-53.05%	2.14%	2.04%	-0.08%
2009年度	66.06%	1.50%	57.06%	1.42%	9.00%	0.08%
2010年度	-12.96%	1.52%	-9.97%	1.06%	-2.99%	0.46%
2011年度	-22.58%	1.14%	-15.65%	0.87%	-6.93%	0.27%
2012年度	5.73%	1.07%	3.46%	0.82%	2.27%	0.25%
2013年上半年	-6.49%	1.26%	-9.26%	0.93%	2.77%	0.33%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、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）基金交易佣金；
（4）基金证管费、印花税；
（5）基金信息披露费用；
（6）基金持有人大会费用；
（7）与基金相关的会计师费用和律师费用；
（8）按照国家有关规定可以列入的其他费用。
本基金费用由基金托管人从基金财产中支付。

2、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以基金资产净值1.5%的年费率计提。具体计算方法如下：

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

H＝E×1.5%÷当年天数。H为每日应付的基金管理费，E为前一日的基金资产净值。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日），按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的2.5‰ 的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×2.5‰÷当年天数。H为每日应支付的基金托管费，E为前一日的基金资产净值。

基金托管人的托管费每日计算，基金托管费计算逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

（3）其他费用

上述1款中其他费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1.基金认购费用

本基金认购费率不超过1%。

本基金只接受金额认购，认购金额包括认购费用和净认购金额。其中，
认购费用 ＝ 认购金额×认购费率
净认购金额 ＝ 认购金额－认购费用
认购份额 ＝ 净认购金额/基金份额面值

认购的有效份额保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

本基金的认购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2.申购费

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，
净申购金额＝申购金额/(1+申购费率)
申购费用＝申购金额–净申购金额
申购份额＝净申购金额/T日基金份额净值

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购金额（含申购费）	费率
500万元以下	1.5%
500万元—1000万元（含500万元）	0.9%
1000万元以上（含1000万元）	固定费用1000元

本基金的申购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

3.赎回费

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，
赎回总额＝赎回份数×T日基金份额净值
赎回费用＝赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额–赎回费用

赎回费根据持有人持有基金的期限递减，最高不超过赎回总额的0.50%，作为注册登记费。费率表如下：

持有基金份额的期限	费率
1年以内	0.5%
1年—2年（含1年）	0.25%
2年以上（含2年）	免收

在持有期内持有人多次申购基金的，赎回时按照先进先出的原则计算。

赎回费归入基金财产的比例规定为赎回费总额的百分之二十五。余额为注册登记费和其他手续费。

4.转换费

（1）基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

1)基金转换申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费低于转入基金的申购费的，补差费为转入基金的申购费和转出基金的申购费差额。转出基金金额所对应的转出基金申购费高于转入基金的申购费的，补差费为零。

2)转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

（2）转换份额的计算公式

转出金额＝转入金额＝B×C×(1—D) /（1+G）+H
转入份额＝转入金额/E
其中：
B为转出的基金份额；
C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；
D为转出基金的对应赎回费率；
G为对应的申购补差费率；
E为转换申请当日转入基金的基金份额净值；H为转出基金份额对应的未支付收益，若转出基金为非货币市场基金的，则H=0
注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

特别提示：

由宝盈增强收益债券A、宝盈中证100指数增强转入宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈核心优势混合、宝盈资源优选股票时，如果投资者的转入金额在500万(含)到1000万之间，在收取基金转换的申购补差费时，将直接按照转入基金的申购费收取，不再扣减申购原基金时已缴纳的1000元申购费。

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)	宝盈策略增长股票(213003)	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)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0
		100万元≤M<500万元	0.20%
		500万元≤M<1000万元	0.10%
		M≥1000万元	0
宝盈核心优势混合(213006)	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
宝盈增强收益债券A(213007)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0.70%
		100万元≤M<300万元	1.00%
		300万≤M<500万	1.20%
		500万≤M<1000万	0.90%
		1000万≤M	0
宝盈增强收益债券C(213917)	宝盈策略增长股票(213003)	M<500万元	1.50%
		500万元≤M<1000万元	0.90%
		M≥1000万元	固定费用1000元
宝盈资源优选股票(213008)	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
宝盈货币(A类：213009，B类：213909)	宝盈策略增长股票(213003)	M<500万元	1.50%
		500万元≤M<1000万元	0.90%
		M≥1000万元	固定费用1000元
宝盈中证100指数增强(213010)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0.30%
		100万元≤M<300万元	0.70%
		300万≤M<500万	1.20%
		500万≤M<1000万	0.90%
		M≥1000万	0
宝盈策略增长股票(213003)	宝盈鸿利收益混合(213001)	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)	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)	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A(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

本公司网上直销申购补差费率表：

转出基金	转入基金	转换金额	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”
宝盈策略增长(213003)	宝盈鸿利收益(213001)	M≥100份×申请受理当日转出基金的基金份额净值	0	0	0
	宝盈泛沿海(213002)				
	宝盈资源优选(213008)				
	宝盈增强收益(213007)				
	宝盈核心优势(213006)				
	宝盈货币A/B(213009,213909)				
	宝盈中证100指数增强(213010)				
宝盈鸿利收益(213001)	宝盈策略增长(213003)	M<100万元	0	0	0
		100万元≤M<500万元	0.24%	0.21%	0.12%
		500万元≤M<1000万元	0.24%	0.21%	0.12%
		M≥1000万元	0	0	0
宝盈泛沿海(213002)	宝盈策略增长(213003)	M<100万元	0	0	0
		100万元≤M<500万元	0.16%	0.14%	0.08%
		500万元≤M<1000万元	0.08%	0.07%	0.04%
		M≥1000万元	0	0	0
宝盈资源优选(213008)	宝盈策略增长(213003)	M<100万元	0	0	0
		100万元≤M<500万元	0.48%	0.42%	0.24%
		500万元≤M<1000万元	0.48%	0.42%	0.24%
		M≥1000万元	0	0	0
宝盈核心优势(213006)	宝盈策略增长(213003)	M<100万元	0	0	0
		100万元≤M<500万元	0.48%	0.42%	0.24%
		500万元≤M<1000万元	0.48%	0.42%	0.24%
		M≥1000万元	0	0	0
宝盈增强收益A(213007)	宝盈策略增长(213003)	M<100万元	0.56%	0.49%	0.28%
		100万元≤M<300万元	0.80%	0.70%	0.40%
		300万元≤M<500万元	0.96%	0.84%	0.48%
		M≥500万元	0	0	0
宝盈增强收益C(213917)	宝盈策略增长(213003)	M<500万元	1.20%	1.05%	0.60%
		500万元≤M<1000万元	0.72%	0.63%	0.36%
		M≥1000万元	1000元/笔	1000元/笔	1000元/笔
宝盈货币A/B(213009,213909)	宝盈策略增长(213003)	M<500万元	1.20%	1.05%	0.60%
		500万元≤M<1000万元	0.72%	0.63%	0.36%
		M≥1000万元	1000元/笔	1000元/笔	1000元/笔
宝盈中证100指数增强(213010)	宝盈策略增长(213003)	M<100万元	0.24%	0.21%	0.12%
		100万元≤M<300万元	0.56%	0.49%	0.28%
		300万元≤M<500万元	0.96%	0.84%	0.48%
		500万元≤M<1000万元	0.72%	0.63%	0.36%
		M≥1000万元	0	0	0

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“重要提示”部分，更新了本招募说明书所载内容和相关财务数据的截止时间
2、 在“三、基金管理人”部分，更新了“(一)基金管理人概况、(二)证券投资基金管理情况”和“（三）主要人员情况”的相应内容。
3、 在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的信息。
4、 在“五、相关服务机构”部分，更新了“(一)基金份额发售机构”、“(四)会计师事务所和经办注册会计师”的相应内容。
5、 在“十、基金的投资”部分，更新了本基金投资组合报告的内容。
6、 在“十一、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
7、 在“二十三、其他应披露事项”部分，披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司
二〇一三年九月二日