宝盈策略增长股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014 年 7 月 18 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 2014 年 7 月 17 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 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈策略增长股票
基金主代码	213003
交易代码	213003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年 1 月 19 日
报告期末基金份额总额	3,603,299,345.73 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,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。
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 本基金股票投资策略主要通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的股票构建投资组合。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,根据研究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。 3.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。
业绩比较基准	上证 A 股指数x75%+上证国债指数x20%+同期银行一年定期存款利率x5% 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。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,追求持续、稳定的一致性获利,适于能承担一定风险,追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。
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(2014 年 4 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-8,148,060.71
2.本期利润	276,585,901.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0762
4.期末基金资产净值	3,301,111,656.10
5.期末基金份额净值	0.9161

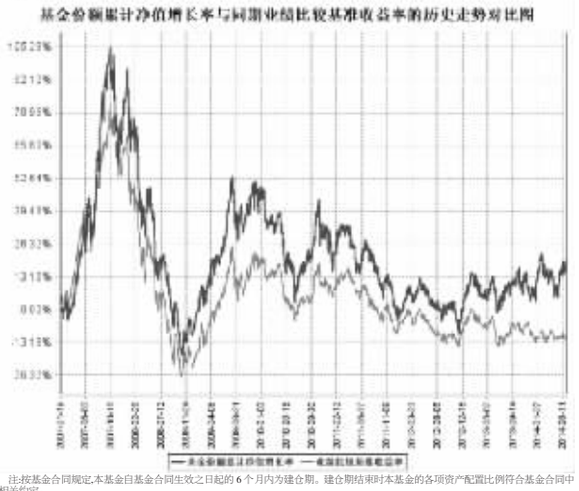
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.05%	1.28%	0.84%	0.58%	8.21%	0.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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		
王茹远	本基金基金经理兼宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年 8 月 1 日	-	6年	王茹远女士,计算机科学硕士。2007 年 12 月至 2011 年 7 月就职于海通证券股份有限公司,担任首席分析师。2011 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司,担任核心研究员。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 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,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;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 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

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

在年初对并购重组概念、触网"概念、新能源汽车、医疗服务、转型概念等主题进行一番较大幅度炒作之后,3-5 月份季报前后,借"世纪证券不达预期"、宏观经济预期较差、再加上 IPO 大规模重启预期,打破了存量资金博弈的弱平衡市场格局,炒作后的成长股进入大幅"挤泡沫"过程,大市值白马成长股也因资金、估值双重压力仍难有表现。本基金在前期成长股大幅上涨时,较大幅度减持了成长股,增加了大盘蓝筹的配置,因此一定幅度抵御了市场下跌。

期间政府稳增长措施持续推出,较好地稳定了市场预期,主板指数稳定在一个较窄区间中波动,因此我们持续底部加仓长期战略性看好的信息安全、军工、互联网以及部分微观景气度很高的个股。在明确 IPO 年内有限发行后,我们持仓的上述板块个股反弹较好,取得了超越基准的回报。

进入 6 月市场再次炒作大题材小市值的成长股,考虑稳增长政策真正起作用需要落实、时间和积累,预计二季度企业盈利仍难言乐观,因此我们对大部分成长股持谨慎态度,认为精选景气行业方向依旧是后续主要策略。

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 9.05%,同期业绩比较基准收益率是 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,稳增长措施将加快推出,宏观经济逐步进入寻底阶段,但在量地产链条仍将继续下滑拖累经济向上,反腐会阶段性影响政策落实效率。依托相对积极的货币和财政政策、通过放松管制增强活力、加大新兴产业扶持力度,我国经济仍有较大回旋余地,经济结构调整将日益明显,逐步摆脱硬着陆和通缩风险,表现出轻微的滞胀,为后续经济上行打基础。

我们认为今年以来市场已经过度追逐"小市值、大题材"的股票,随着上述宏观变化,以及部分关键因素可能会兑现,包括沪港通、混合所有制改革、个股期权等,长线资金偏好的大市值股票有望初步迎来估值修复行情。小市值和大市值股票将在正负面因素强弱变化时交替表现。

综合考虑上述正负面因素随时对比度可能发生变动,我们在操作上会灵活应变,密切关注市场风格切换的可能性。继续看好面向个人用户的互联网、军工和信息安全等国家必需品、供应链和产品结构良好的电子等长期预期好、有想象空间的公司,波段参与,逐步市局消费、高铁等大市值股票。

§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	2,980,477,587.26	90.04
	其中:股票	2,980,477,587.26	90.04
2	固定收益投资	90,162,000.00	2.72
	其中:债券	90,162,000.00	2.72
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	19,500,209.75	0.59
	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	97,013,988.66	2.93
7	其他资产	123,047,918.72	3.72
8	合计	3,310,201,704.39	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	采矿业	31,296,000.00	0.95
C	制造业	1,740,867,312.49	52.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,873,409.60	0.90
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	930,780,865.17	28.20
J	金融业	247,660,000.00	7.50
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,980,477,587.26	90.29

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	300059	东方财富	26,550,000	319,396,500.00	9.68
2	002368	太极股份	9,350,000	313,131,500.00	9.49
3	600518	康美药业	18,000,000	269,100,000.00	8.15
4	601998	中信银行	58,000,000	247,660,000.00	7.50
5	600893	航空动力	9,180,000	236,568,600.00	7.17
6	601766	中国南车	36,000,000	162,000,000.00	4.91
7	300322	硕贝德	10,000,000	158,600,000.00	4.80
8	300288	朗玛信息	2,300,000	147,499,000.00	4.47
9	300115	长盈精密	5,380,000	118,467,600.00	3.59
10	000725	京东方 A	50,000,000	108,500,000.00	3.29

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,162,000.00	2.73
	其中:政策性金融债	90,162,000.00	2.73
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	90,162,000.00	2.73

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	090306	09进出06	900,000	90,162,000.00	2.73

5.6 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序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
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。
5.11.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,018,958.11
2	应收证券清算款	120,392,315.34
3	应收股利	-
4	应收利息	620,713.75
5	应收申购款	15,931.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,047,918.72

5.11.4 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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。
5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	3,773,173,949.79
报告期期间基金总申购份额	81,356,098.95
减:报告期期间基金总赎回份额	251,230,703.01
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,603,299,345.73

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈策略增长股票型证券投资基金设立的文件。
《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》。
《宝盈策略增长股票型证券投资基金托管协议》。
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。
9.2 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:北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
9.3 查阅方式
上述备查文件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
2014 年 7 月 18 日

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014 年 7 月 18 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 7 月 15 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 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈泛沿海增长股票
基金主代码	213002
交易代码	213002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年 3 月 8 日
报告期末基金份额总额	3,534,792,867.04 份
投资目标	通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司,有效分享中国经济快速增长的成果,在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"进行资产配置和行业及类属资产配置,"自下而上"精选个股的积极投资策略。 在整体资产配置层面,本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 在区域资产配置及行业权重层面,本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。 在个股选择层面,本基金以 PEG、每股经营现金流量、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。
业绩比较基准	上证 A 股指数x80%+上证国债指数x20% 当市场出现合适的全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。
风险收益特征	本基金属于区域类增长型股票基金,风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间,适于能承担一定风险,追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2014 年 4 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-387,100,364.66
2.本期利润	95,726,136.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0248
4.期末基金资产净值	1,607,378,545.13
5.期末基金份额净值	0.4547

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	5.77%	0.99%	0.84%	0.62%	4.93%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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		
高峰	本基金基金经理、总经理助理兼投资部总监	2010年 11 月 19 日	2014年 5 月 23 日	14年	高峰先生,北京大学光华管理学院经济学硕士。1995 年 8 月至 2000 年 7 月,就职于中国化工进出口总公司及其所属的中国对外经济贸易信托投资有限公司。2000 年 8 月参加宝盈基金管理有限公司的筹备工作,2001 年 5 月公司正式成立至 2003 年 8 月,历任研究发展部高级策略分析师、副总经理。2003 年 9 月至 2009 年 10 月,历任中国对外经济贸易信托有限公司资产管理部副总经理、证券业务部总经理、资产管理总部执行总经理、高级投资经理、公司投资决策委员会成员及富国证券投资集合资金信托的投资管理人。2009 年 10 月至今,就职于宝盈基金管理有限公司,任总经理助理兼投资部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格及伊朗资格。
盖俊龙	本基金基金经理	2014年 5 月 16 日	-	8年	盖俊龙先生,经济学硕士。2006 年 8 月至 2011 年 5 月,在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011 年 6 月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。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 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,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;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 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

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

2014 年二季度,市场整体以震荡为主,前期演绎的结构(风格)分化行情仍然延续,中小盘股票的涨幅明显好于大盘股。上证指数、沪深 300、深圳成指、中小板指数、创业板指分别上涨 0.74%、0.88%、2.14%、4.35%、5.79%,本基金二季度收益为 5.77%,比较基准收益率为 0.84%,大幅跑赢比较基准。

在上期展望中,基金管理人更看好低估值大盘蓝筹股的表现。主要原因首先是估值足够便宜,有投资价值,其次,市场热炒的板块进一步向上的空间越来越小,整体估值水平难以进一步提升,存在向下的压力,有热点转换的需要;第三,看好国企改革对经营效率提高乃至对股价诉求的提升。所以二季度上半阶段本基金资产组合配置基本以低估值大盘蓝筹股为主。

三季度中后期,本基金更换基金经理后,投资风格有所变化。在对经济需要转型的判断基础上,重点在行业整合和新兴细分子行业两个主题领域选择配置"个股,所以本基金二季度后半阶段持仓以成长股为主。

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 5.77%,同期业绩比较基准收益率是 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金管理人认为,随着中美 PMI 连续企稳经济短期企稳是确定的,但前期银行业分化较大,企业补库存意愿并不强烈,目中小企业指数滞落与汇丰背离,反映经济复苏并不稳定,稳增长政策难以持续转强,加之整体经济去杠杆仍在继续,三季度经济下行风险犹存。

5 月以来,宏观数据显示经济短期企稳且略有反弹,然而,中微观许多行业的需求和价格数据却与宏观数据改善并不匹配,例如,中上游价格整体萎靡不振。预计下半年投资时钟将呈现衰退后期特征,股市从危到机,看好转型方向的成长股。而创业板中大部分公司在经历了 2013 以来的持续大幅上涨后,股价已经大幅透支了未来的业绩增长,这也给选择成长股带来极大的挑战。

基金管理人认为下半年的投资机会,成长仍有望跑赢价值。市场普遍预期,未来 1-2 个季度仍然是经济、企业盈利增速缓步下降,但似乎短期不会大幅下滑。与此经济相关行业盈利限望负面,但估值似乎已经体现下行预期。在经济增速跌破下限的警报消除之后,在长期担忧因素全部消化之前,投资者依然偏好"新经济",估值较为合理且具有转型故事的个股有望获得投资者的青睐。在对经济需要转型的判断基础上,基金管理人下半年将重点在行业整合和新兴细分子行业两个主题领域选择配置个股。行业整合的领域重点关注医药、高端装备制造、军工等;新兴细分子行业重点关注环保、新材料、自动化等。

本基金主要采取自下而上的选股策略,以个股投资价值判断为主。投资管理人将遵循基金合同约定的投资策略,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	1,419,655,895.54	87.93
	其中:股票	1,419,655,895.54	87.93
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	60,000,000.00	3.72
	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	109,713,634.22	6.80
7	其他资产	25,213,170.22	1.56
8	合计	1,614,582,699.98	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	采矿业	55,555,893.10	3.46
C	制造业	1,110,392,291.56	69.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,027,939.50	1.18
F	批发和零售业	43,761.40	0.00
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	234,636,009.98	14.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,419,655,895.54	88.32

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	600967	北方创业	9,589,862	120,352,768.10	7.49
2	600536	中国软件	4,677,648	85,928,393.76	5.35
3	002101	广东鸿图	4,873,567	70,374,307.48	4.38
4	300217	东方电热	3,430,132	69,940,391.48	4.35
5	300258	精锻科技	4,473,375	62,985,120.00	3.92
6	300224	正海磁材	2,700,826	62,281,047.56	3.87
7	002651	利君股份	3,732,411	61,920,698.49	3.85
8	300206	理邦仪器	2,752,607	58,437,846.61	3.64
9	300150	世纪瑞尔	3,648,753	57,796,247.52	3.60
10	300164	通源石油	3,408,337	55,555,893.10	3.46

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序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序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序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除通源石油外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。

深交所发布(2014 年 4 月 30 日)关于对通源石油(300164.SZ)及相关当事人给予通报批评的决定,决定对公司及公司董事会秘书王磊进行通报批评的处分,主要原因是公司连续公司章程违规转让子公司股权,且公告信息不及时、不准确。深交所认定公司及相关当事人的违规行为为:2013 年 6 月 8 日,公司将全资子公司西安通源万信商务信息咨询有限公司 100%股权以 7800 万元的价格转让给陕西蓝海风投资管理有限公司,该交易产生利润 1008.75 万元,占公司 2012 年度净利润的 16.88%。该事项已触及其《公司章程》第一百二十五条规定的董事会决策权限,但是公司未将该事项提交董事会审议。公司对上述事项未及时履行信息披露义务,直至 2013 年 8 月 23 日,才在当天刊登的 2013 年半年度报告中披露上述事项。且公司在半年度报告中所称"按照《公司章程》等相关规定,该处置属总裁权限内"与其《公司章程》的规定不符。2013 年 12 月 20 日,公司才对上述事项进行补充披露,就半年度报告中关于上述事项决策权限的错误披露予以更正。公司关于上述事项的信息披露不及时、不准确。

我们认为公司确实在企业管理的基本环节存在一些问题,但这些问题是任何一家创业板公司在成长过程中都可能会经历。公司已经及时对错误披露予以更正,且我们认为本次行为不会对公司未来的发展战略产生重大影响,因看好公司未来发展,所以基金管理人买入了该公司股票。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,316,991.65
2	应收证券清算款	23,849,657.43
3	应收股利	-
4	应收利息	33,464.46
5	应收申购款	13,056.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,213,170.22

5.11.4 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。
5.11.5 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	600536	中国软件	85,928,393.76	5.35	非公开发行流通受限

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	4,924,332,604.90
报告期期间基金总申购份额	6,245,792.43
减:报告期期间基金总赎回份额	1,395,785,530.29
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,534,792,867.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金设立的文件。
《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》。
《宝盈泛沿海区域增长股票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。
9.2 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:北京市西城区复兴门内大街 55 号
9.3 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
2014 年 7 月 18 日

宝盈资源优选股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:2014 年 7 月 18 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 2014 年 7 月 17 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。