宝盈策略增长股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:2014年1月22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2013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	3,561,306,423.03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(2013年10月1日－2013年12月31日)
1.本期已实现收益	8,785,670.08
2.本期利润	-99,549,774.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0295
4.期末基金资产净值	2,910,789,495.98
5.期末基金份额净值	0.8173

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。

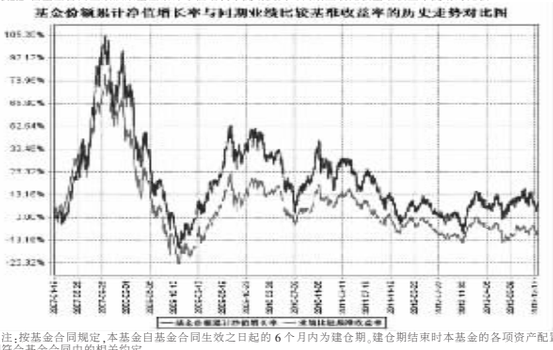
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.88%	1.58%	-1.83%	0.74%	-1.05%	0.84%

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


基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
105.20%
97.17%
73.96%
65.92%
62.64%
32.48%
7.37%
-13.16%
-1.06%
-23.32%
2014-06-27
2014-07-22
2014-08-20
2014-09-26
2014-10-31
2014-11-26
2014-12-31
2015-02-06
2015-03-11
2015-04-07
2015-05-12
2015-06-08
2015-07-02
2015-08-07
2015-09-11
2015-10-16
2015-11-11
2015-12-07
2016-01-11
2016-02-17
2016-03-11
2016-04-06
2016-05-11
2016-06-07
2016-07-12
2016-08-17
2016-09-21
2016-10-26
2016-11-30
2016-12-28
2017-01-12
2017-02-07
2017-03-14
2017-04-10
2017-05-16
2017-06-12
2017-07-17
2017-08-22
2017-09-26
2017-10-31
2017-11-29
2017-12-27
2018-01-31
2018-02-28
2018-03-27
2018-04-26
2018-05-31
2018-06-29
2018-07-30
2018-08-27
2018-09-28
2018-10-31
2018-11-30
2018-12-28
2019-01-31
2019-02-28
2019-03-27
2019-04-26
2019-05-31
2019-06-28
2019-07-31
2019-08-30
2019-09-27
2019-10-31
2019-11-29
2019-12-27
2020-01-31
2020-02-28
2020-03-27
2020-04-26
2020-05-31
2020-06-29
2020-07-31
2020-08-28
2020-09-27
2020-10-30
2020-11-27
2020-12-31
2021-01-29
2021-02-26
2021-03-31
2021-04-30
2021-05-28
2021-06-30
2021-07-30
2021-08-31
2021-09-30
2021-10-29
2021-11-30
2021-12-31
2022-01-28
2022-02-28
2022-03-31
2022-04-29
2022-05-31
2022-06-30
2022-07-29
2022-08-31
2022-09-30
2022-10-31
2022-11-30
2022-12-31
2023-01-31
2023-02-28
2023-03-31
2023-04-28
2023-05-31
2023-06-30
2023-07-31
2023-08-31
2023-09-30
2023-10-31
2023-11-30
2023-12-31
2024-01-31
2024-02-29
2024-03-31
2024-04-30
2024-05-31
2024-06-30
2024-07-31
2024-08-31
2024-09-30
2024-10-31
2024-11-30
2024-12-31
2025-01-31
2025-02-28
2025-03-31
2025-04-30
2025-05-31
2025-06-30
2025-07-31
2025-08-31
2025-09-30
2025-10-31
2025-11-30
2025-12-31
2026-01-31
2026-02-28
2026-03-31
2026-04-30
2026-05-31
2026-06-30
2026-07-31
2026-08-31
2026-09-30
2026-10-31
2026-11-30
2026-12-31
2027-01-31
2027-02-28