安信现金管理货币市场基金

【2013】第二季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年07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2013年7月16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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信现金管理货币	
基金主代码	750006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年02月05日	
报告期末基金份额总额	197,292,424.25份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资组合,力求为投资者获得超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	1.宏观策略。通过对宏观经济指标的跟踪和分析,并结合央行公开市场操作等情况,合理预测货币市场利率趋势变化,决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。 2.个券选择策略。考虑安全性因素,优先选择国债等高信用等级债券以规避信用风险。在满足信用评级要求的前提下,根据我公司债券评分标准对信用债券进行评分筛选,重点关注低估值品种。 3.套利策略。在保证安全性和流动性的前提下,本基金将在充分验证套利机会可行性的基础上,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会。 4.回购策略。密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异,在精确投资收益测算的基础上,积极采取回购杠杆操作,为基金资产增加收益。 5.流动性管理策略。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,确保基金资产的变现能力。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
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	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
下属两级基金的交易代码	750006	750007
报告期末下属两级基金的份额总额	88,594,561.25份	108,697,863.00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(2013年04月01日-2013年06月30日)	
	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
1.本期已实现收益	1,120,752.43	726,627.29
2.本期利润	1,120,752.43	726,627.29
3.期末基金资产净值	88,594,561.25	108,697,863.00

注: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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,所以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。

3.2 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、安信现金管理货币A

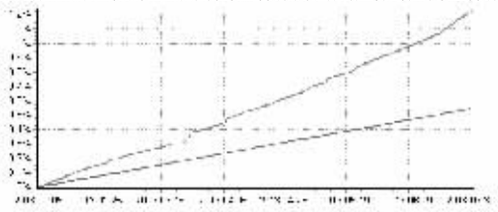
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8261%	0.0045%	0.3366%	0.0000%	0.4895%	0.0045%

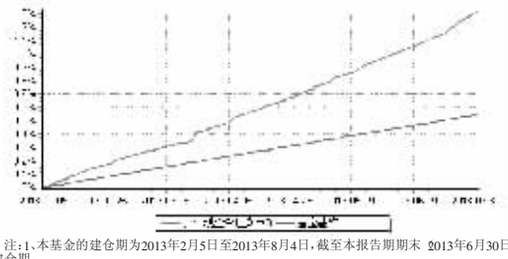
2、安信现金管理货币B

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	0.8871%	0.0045%	0.3366%	0.0000%	0.5505%	0.0045%

注:1、本基金收益分配为按日结转份额;
2、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

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





注:1、本基金的建仓期为2013年2月5日至2013年8月4日,截至本报告期期末(2013年6月30日),本基金尚在建仓期。
2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2013年2月5日至2013年6月30日。

§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		
李勇	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2013年02月05日	-	7	李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。2012年9月25日至今,任安信目标收益债券型证券投资基金的基金经理;2012年12月18日至今,任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;2013年2月5日至今,任安信现金管理货币市场基金的基金经理。

注:1、此处的任职日期为本基金合同生效日。
2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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运作分析

2013年2季度,前期债券市场流动性充裕,呈迅速上涨态势,中债总财富(总值)指数从季初的144.47上升至4月16日的145.86。4月下旬的债市监管风波引发了二季度第一次明显的波动,指数一度下探至145.09,之后逐步恢复并平稳上升至5月底的146.19的高点。6月起,流动性逐步抽紧,央行推动市场去杠杆的态度逐步明确。至6月20号前后,市场资金紧张引起市场恐慌,隔夜回购一度高达30%,7天回购最高达28%,中债总财富(总值)指数急速下跌至144.36点,之后随着央行逐步释放流动性,市场迅速好转,至6月28号,指数回升至145.66,收复了前期跌幅的2/3以上。

2季度,我们保持了稳健运作的作风,并前瞻性预测到6月流动性紧缩态势,提前布局了充足的到期资金,准确抓住市场机会,借流动性紧缩之际配置了高收益品种,6月末7日年化收益率快速攀升至5%以上,同业排名明显提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,2季度本基金A类份额净值收益率为0.8261%,B类份额净值收益率为0.8871%,同期比较基准份额收益率均为0.3366%,本基金A类和B类净值收益率分别超过同期业绩比较基准0.4895%和0.5505%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年3季度,宏观经济增速长期放缓趋势日渐明朗,PPI长期负增长的背景下,CPI也将受到一定的抑制,甚至面临一定的通缩风险,这将对债券市场形成较强的支撑。另一方面,央行为控制货币供应量增长过快,也会强化流动性的调节力度,预计下半年资金不会太宽松。总体来看,债券市场和货币市场将呈现震荡格局,资金利率中枢上移。对于货币基金来说,将出现阶段性的配置机会。在投资策略上,我们将前瞻性做好市场的研究工作,灵活调整组合,科学摆布流动性,注意防范风险,为投资者创造更为平稳和较快增长的业绩回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	100,087,508.41	45.99
	其中:债券	100,087,508.41	45.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	49,600,284.40	22.79
	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	66,141,905.53	30.39
4	其他资产	1,790,272.10	0.82
5	合计	217,619,970.44	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	1.45
	其中:买断式回购融资	0.00%
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2013年05月08日	20.28	基金赎回	2个交易日
2	2013年05月09日	20.60	基金赎回	1个交易日

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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2013年05月03日	123	由于持有的浮动利率债券调息导致该债券剩余期限重新计算	2个交易日
2	2013年05月06日	123	由于持有的浮动利率债券调息导致该债券剩余期限重新计算	1个交易日

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金基金合同的约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120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	68.90	10.14
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	25.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	15.25	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	15.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.40	10.14

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,089,192.38	15.25
	其中:政策性金融债	30,089,192.38	15.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	69,998,316.03	35.48
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	100,087,508.41	50.73
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,089,192.38	15.25

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

金额单位:人民币元

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	130211	13国开11	300,000	30,089,192.38	15.25
2	011316002	13华电股SCP002	200,000	20,000,107.17	10.14
3	071314001	13银河CP001	200,000	19,999,442.63	10.14
4	041359025	13三江化工CP001	100,000	10,000,355.38	5.07
5	041359039	13镇城投CP001	100,000	10,000,066.57	5.07
6	041360033	13青国信CP002	100,000	9,998,344.28	5.07

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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	6
报告期内偏离度的最高值	0.0663%
报告期内偏离度的最低值	-0.3967%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0727%

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,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于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20%的情况

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例	原因	调整期
1	2013年05月07日	22.19	大额赎回	8个交易日
2	2013年05月30日	20.01	大额赎回	2个交易日
3	2013年06月04日	20.13	大额赎回	10个交易日

5.8.3 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	903,017.93
4	应收申购款	887,254.17
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,790,272.10

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
报告期期初基金份额总额	224,018,537.48	44,230,324.94
报告期期间基金总申购份额	43,646,860.46	129,257,385.71
报告期期间基金总赎回份额	179,070,836.69	64,789,847.65
报告期期末基金份额总额	88,594,561.25	108,697,863.00

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信现金管理货币市场基金募集的文件;
2、《安信现金管理货币市场基金基金合同》;
3、《安信现金管理货币市场基金托管协议》;
4、《安信现金管理货币市场基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司
地址:中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

7.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。
客户服务电话:4008-088-088
网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
二〇一三年七月十八日

宝盈策略增长股票型证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§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2013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2013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	2,330,002,078.92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×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。
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4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	34,254,355.02
2.本期利润	-114,760,922.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0486
4.期末基金资产净值	1,757,651,810.42
5.期末基金份额净值	0.7544

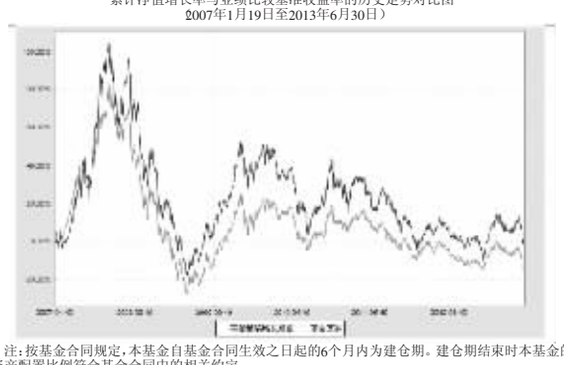
3.2 基金净值表现

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	-6.19%	1.21%	-8.51%	0.90%	2.32%	0.31%

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

宝盈策略增长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
(2007年1月19日至2013年6月30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		
余述胜	本基金基金经理兼宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理	2009-7-1	-	15年	余述胜先生,金融学博士。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、研究部总监。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运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在2013年二季度初我们认为,宏观经济仍将稳健运行,各种政策会如期推出,市场估值在2月中旬开始的下降后仍处于合理水平。总体来看,市场面临的积极因素仍存在。从风险来看,新股发行、解禁股上市仍是市场主要担心所在。预计市场在完成估值全面修复后将震荡整理,个股将出现分化。但从二季度的实际情况看,由于政策不及预期,加上央行对流动性的态度改变,市场在6月份出现了恐慌性下跌,并创出了四年来的新低。由于市场出现意外下跌,本基金原来制定的二季度投资策略与市场匹配性较差,虽然报告期内及时地调整了组合结构但业绩仍较差。业绩较差的具体原因一是保持了较重的仓位,在市场统统性下跌时净值下降较快,二是较少配置市场表现非常好的新兴产业,三是较多配置了市场表现很差的传统周期性行业如有色等。因此,报告期末基金业绩排名相对靠后。

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-6.19%,同期业绩比较基准收益率是-8.51%。

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,我们认为,宏观经济在调整经济结构和实现有质量的增长要求下将保持稳定态势,由于政府对刺激经济态度的转变投资者对政策的预期不能太乐观,即使有政策出台也是着眼于中长期的经济发展,短期对经济和市场影响有限。从市场来看,由于市场在创出新低后很多公司估值处于合理水平,具有长期投资价值,但结构性泡沫明显存在。因此预计三季度市场将保持振荡态势,个股将有较多的表现机会。市场的风险仍主要来自大小非的减持和创业板的估值泡沫局部破裂。根据目前点位和对未来市场的分析,我们三季度投资策略如下:一是保持较高仓位,并根据市场变化灵活调整仓位,争取获得短期系统性和结构性机会带来的投资收益。二是根据新的经济和市场特点配置大消费和成长股。由于传统周期性行业仍难以短期内好转,而一些消费行业仍值得长期看好,一些成长性行业发展空间巨大,故加大对消费股和成长股配置比例,减少传统性行业配置比例。消费股看好医药及大众消费品,成长性股主要从新兴产业或政策支持行业中寻找。三是对看好的个股做重点投资,为基金带来超额收益。从组合的构建中,在目前较低点位下,从仓位、行业配置和个股选择、时机选择等方面综合把握组合风险,实现净值的稳定增长。

§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	1,585,394,900.13	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

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	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

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	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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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未受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

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

5.9.4 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。

5.9.5 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

5.9.6 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	2,393,222,851.89
本报告期基金总申购份额	3,493,521.01
减:本报告期基金总赎回份额	66,714,293.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,330,002,078.92

§7 备查文件目录

7.1 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。

7.2 存放地点

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。
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

7.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间内到基金管理人和基金托管人的办公场所及网站免费查阅备查文件。

宝盈基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§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2013年7月16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	5,709,568,248.12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×80%+上证国债指数×20% 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	本基金属于股票型基金,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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	105,069,198.31
2.本期利润	-231,126,917.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0406
4.期末基金资产净值	2,169,481,311.75
5.期末基金份额净值	0.3800

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。

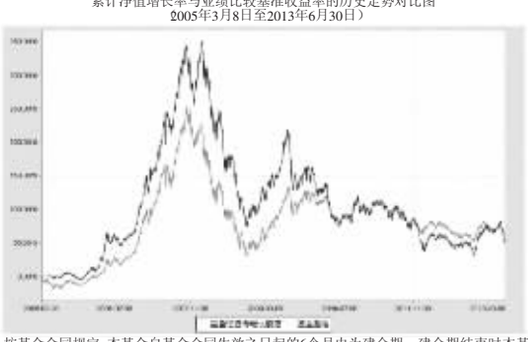
3.2 基金净值表现

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	-9.65%	1.33%	-9.11%	0.96%	-0.54%	0.37%

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

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金
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
(2005年3月8日至2013年6月30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