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2009年7月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年6月30日(财务数据未经审计)。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:陆金海

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:葛俊杰

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。

公司下设十六个部室,分别是投资部、研究部、海外投资部、金融工程部、集中交易室、特定客户资产管理部、市场部、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心、华南营销中心、基金运营部、监察稽核部、公司财务部、总经理办公室、北京办事处和上海办事处;此外,还设立了投资决策委员会、风险控制委员会和信息技术治理委员会。

公司以“规范管理求效益,诚信创新谋发展,回报服务创品牌”为经营理念,坚持“诚实信用,勤勉尽责”的企业精神,立足专业,追求卓越,致力于开拓基金及证券市场业务,为基金份额持有人和资产委托人谋取更大利益。

(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,现任中铁信托有限责任公司董事长,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。

陈亦先生,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兼董事会秘书。

钟鸣先生,董事,1974年生,MBA毕业。曾任中山新艺电子有限公司总经理特别助理、成都电子研究所研究室主任。现任成都工业投资集团有限公司副总经理。

高峰先生,董事,1971年生,中共党员,北京大学光华管理学院硕士。1995年8月,中国对外经济贸易信托投资公司计划财务部财务科经理;1999年10月起在中国化工进出口总公司财务部任综合部经理;2000年8月至2003年8月参与宝盈基金管理有限公司筹建,并先后任宏观策略分析师、研究发展部副总经理;2003年9月至今,在中国对外经济贸易信托有限公司任证券业务部总经理,兼任交易部总经理。

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。

陈雨露先生,独立董事,1966年生,中共党员,中国人民大学博士,教授。1989年起,历任中国人民大学教师、副教授,教授,财政金融系主任助理、副系主任、财政金融学院常务副院长、院长,现任中国人民大学副校长。

陈小悦先生,独立董事,1947年生,清华大学汽车工程专业博士。1988年至1990年在清华大学经济管理学院任党委副书记、讲师、院长助理;1990年至1992年,在加拿大西安大略大学商学院进修;1992年至今,在清华大学经济管理学院任职,历任院长助理、副教授、财务与金融研究组主任、副院长、会计系系主任、教授、博士生导师,其中2000年8月至2007年1月兼任清华大学会计研究所所长;1999年5月至2007年1月在北京国家会计学院,历任副院长、院长;2007年1月至今任清华大学会计研究所所长。

陆金海先生,董事,总经理,1970年生,中共党员,厦门大学金融专业经济学博士。1999年9月至2001年10月,在清华大学经济管理学院会计系开展博士后研究工作。2001年10月起就职于南方基金管理公司,历任金融工程部总监、信息技术部总监、投资策略与风险控制部总监。2006年4月起任宝盈基金管理有限公司总经理。

(2)监事会

王慧女士,监事长,1965年生,MBA。1986年8月至1990年6月在四川师范大学化学系任教。1990年6月至1997年6月在蜀都大厦股份公司并负责销售业务。1997年6月至2001年9月在成都托管有限公司工作,担任办公室主任、资产经营部经理、副总经理。2001年9月至今在成都工业投资集团有限公司工作并担任常务副总经理。

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。

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监助理,市场部总监。目前,其担任宝盈基金管理有限公司总经理助理、市场部总监,特定客户资产管理部总监。

(3)其他高级管理人员

于志先生,副总经理,1963年生,中共党员,硕士。1988年至1990年,中国中化集团总公司储运部;1990年至1991年,新加坡海皇船务公司租船部高级执行人员;1991年至1994年,中国中化集团石油投资部部门经理;1994年至2000年,中化巴哈马石油有限公司副总经理;2000年至2002年,宝盈基金管理有限公司基金经理助理;2002年至2005年,香港中化汇富资产管理公司副总经理;2005年至2006年,中国对外经济贸易信托投资公司证券部副总经理。2006年10月加入宝盈基金管理有限公司,2007年1月起任公司副总经理。

胡东良先生,副总经理,1963年生,中共党员,硕士。1988年7月至1994年2月,在北京农业大学农业经济与管理学院任教;1994年2月至2003年6月,历任南方证券投资银行业务部北京分部项目经理、上海分公司投资银行部副经理、投资银行业务总部总经理助理、投资银行业务总部副总经理兼北京部总经理;2003年6月至2007年3月,汉唐证券有限公司副总裁;2007年4月加入宝盈基金管理有限公司任总经理助理。2009年1月起任公司副总经理。

刘传葵先生,督察长,1968年生,民革党员,经济学博士,高级经济师,深圳市政府特殊津贴专家。1990年7月—1992年8月,中国人民银行赣州市支行干部,团支书;1994年5月—1997年10月,深圳投资基金管理公司总裁秘书、研究部总监;1997年11月—2000年5月,广发证券发展研究中心(深圳)负责人;2000年5月—2002年3月,平安证券综合研究所副所长;2002年10月—2004年5月,长信基金研究总监、市场发展总部总监;2004年5月至今,历任宝盈基金管理有限公司首席经济师兼研究部总监、首席经济师兼监察稽核部总监;2007年5月起代为履行宝盈基金管理有限公司督察长职责;2007年7月起担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,11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。2009年7月1日起担任宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理。

盛军锋先生,1976年出生,经济学博士,3年基金从业经历。2004年1月至2006年6月就任于中国人民银行深圳市中心支行货币信贷管理处。2006年6月加入宝盈基金管理有限公司,从事宏观策略研究工作。2009年7月1日起担任宝盈策略增长股票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:

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:

陆金海先生:宝盈基金管理有限公司总经理。

于志先生:宝盈基金管理有限公司副总经理。

陆万山先生:宝盈基金管理有限公司投资执行总监、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。

余述胜先生:宝盈基金管理有限公司研究部总监、宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理。

杨宏亮先生:宝盈基金管理有限公司金融工程部总监、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈资源优选股票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:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

法定代表人:项俊波

成立时间:2009年1月15日

注册资本:2600亿元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-68424199

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。2009年1月15日,中国农业银行股份有限公司正式成立,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。

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。股份公司于2009年1月15日依法成立。股份公司自成立之日起,将完整承继中国农业银行的资产、负债和所有业务,并将继续从事原经营范围和业务许可文件上批准/核准的业务。中国农业银行已有的营业机构、商标、互联网域名和咨询服务电话等保持不变,由股份公司继续使用,各项业务照常进行。客户毋需因改制而办理任何变更手续。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工93名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师10余名,服务团队成员都具有高素质高学历的托管业务能力,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

截止2009年6月30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67只,包括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、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、天华证券投资基金、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、富国天源平衡混合型证券投资基金、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、新世纪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、泰达荷银货币市场基金、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、景顺长城内需增长式号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银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、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、大治稳健双盈债券型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、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。

(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

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。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,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

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、平安银行、北京银行、中信银行、民生银行、国泰君安证券、海通证券、国联证券、兴业证券、长江证券、国盛证券、东方证券、招商证券、国信证券、金元证券、第一创业证券、广发证券、中信建投证券、中国银河证券、国元证券、国都证券、中信证券、华西证券、渤海证券、联合证券、长城证券、中信万通证券、中信金通证券、东海证券、齐鲁证券、安信证券、西南证券、平安证券、浙商证券、万联证券、中银万国、东吴证券、中国建银投资证券、天源证券、宏源证券、江南证券、厦门证券、世纪证券。

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、26层

法定代表人:李建生

电话:0755-83276688

传真:0755-83515989

联系人:方仲姬

2、代销机构

(1)中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:项俊波

客户服务电话:95599

联系人:中国农业银行客户服务中心

(2)中国建设银行

注册地址:北京市西城区金融大街25号

法定代表人:郭树清

客户服务电话:95533

联系人:中国建设银行客户服务中心

(3)中国工商银行

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客户服务电话:95588

联系人:中国工商银行客户服务中心

(4)中国银行

地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

客户服务电话:95566

(5)交通银行股份有限公司

注册地:上海市仙霞路18号

客户服务电话:95559

公司网址:http://www.bankcomm.com

(6)招商银行

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人:秦晓

客户服务电话:95555

联系人:招商银行客户服务中心

(7)平安银行

注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:黄立哲

客户服务电话:40066-99999

网址:http://www.18ebank.com/

(8)中国民生银行

注册地:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

客户服务电话:95568

公司网址:http://www.cmbc.com.cn/

(9)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

法定代表人:孔丹

客户服务电话:95558

公司网址:http://bank.ecitic.com/

(10)北京银行

注册地:北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

邮编:100032

法定代表人:阎冰竹

客户服务电话:010-96169(北京) 022-96269(天津) 021-53599688(上海)

公司网址:http://www.bankofbeijing.com.cn

(11)国泰君安

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:祝幼一

电话:021-62580818-213

传真:021-62569400

联系人:芮敏祺

(12)海通证券

注册地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:021-53594566-4125

传真:021-53858549

联系人:金芸、杨薇

(13)国联证券

注册地址:无锡市县前东街8号

法定代表人:范炎

电话:0510-82588168

传真:0510-82831589

联系人:袁丽萍

(14)兴业证券

注册地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦

营业管理总部:上海市陆家嘴东路166号中保大厦18层

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

传真:021-68419867

联系人:杨盛芳

(15)长江证券

注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人:明云成

联系人:李良

电话:021-63219781

传真:021-51062920

(16)国盛证券

注册地址:江西省南昌市永叔路15号

法定代表人:管荣升

电话:0791-6289771

联系人:万齐志

(17)东方证券

注册地址:上海市浦东大道720号20楼

法定代表人:王益民

电话:021-62476600-3019

传真:021-50366868

联系人:盛云

(18)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

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943511

传真:0755-82943237

联系人:黄健

(19)国信证券

注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

法人代表:胡继之

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼

联系人:齐晓燕

电话:0755-82133066

(20)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

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼

法定代表人:郑辉

电话:0755-83025695

传真:0755-83025625

联系人:金春

(21)第一创业

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

法定代表人:刘学民

电话:0755-25832686

传真:0755-25831718

联系人:杨柳

(22)广发证券

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼

法定代表人:王志伟

联系人:肖中梅

电话:95575或致电各地营业网点

传真:020-87555305

(23)中信建投

注册地址:北京市新中街68号

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:黎晓宏

电话:010-85130577

传真:010-65182261

联系人:权唐

(24)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

法定代表人:朱利

电话:010-66568587

传真:010-66568536

联系人:郭京华

(25)国元证券

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

电话:010-64402757.0551-2207939

联系人:赵康、李蔡

(26)国都证券

注册地址:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

办公地址:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

法定代表人:王少华

电话:010-64482828-390

传真:010-64482090

联系人:马泽承

(27)中信证券

注册地址:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84588266

传真:010-84865560

联系人:陈忠

(28)华西证券

注册地址:四川省成都市陕西街239号

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)

法人代表:张慎修

电话:0755-83025430

传真:0755-83025991

联系人:杨玲

(29)渤海证券

注册地址:天津市河西区宾水道3号

法人代表:张志军

电话:022-28451883

传真:022-28451892

联系人:徐焕强

(30)联合证券

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10层

电话:;0755-25125666

(31)长城证券

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16层

电话:0755-82288968

(32)中信万通证券

注册地址:青岛市崂山区香港东路316号

电话:0532-96577

(33)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

电话:96598

(34)东海证券

注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

法人代表:顾森贤

电话:021-50588876

传真:021-50586660-8880

联系人:龙涛

(35)齐鲁证券

注册地址:济南市经十路128号

法人代表:李玮

电话:95538

公司网站:www.qlzq.com.cn

(36)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

法定代表人:杨池生

联系人:余江@ 联系电话:4008001001、020-96210

(37)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

办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦22-25层

法定代表人:蒋辉

联系人:杨琪颖

联系电话:(023)63786397

传真:(023)63786312

(38)平安证券

注册地址:深圳市福田区八卦岭三路平安大厦3楼

办公地址:深圳市福田区八卦岭三路平安大厦3楼

法定代表人:叶黎成

联系人:余江

电话:0755-82440136@客服电话:95511

公司网址:www.pa18.com

(39)万联证券

地址:广州市中山二路18号电信广场36-37层

法定代表人:李酌金

网站:WWW.WLZQ.COM.CN

咨询电话:020-37865026

(40)浙商证券

地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人:吴承根

网址:www.stocke.com

客户咨询电话:0571-87902079

(41)中银万国

地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

网址:www.sw2000.com.cn

客户咨询电话:021-962505

(42)东吴证券

注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

法定代表人:吴永敏

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

联系人:方晓丹

(43)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

法定代表人:杨小阳

公司网站:http://www.cjis.cn/

客户咨询电话:4006-008-008

(44)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

法定代表人:裴东平

公司网站:http://www.tyzq.com.cn/

客户咨询电话:400-654321-8

(45)宏源证券

注册地址:新疆乌鲁木齐建设路2号

法定代表人:汤世生

网址:http://www.hysec.com

客户服务电话:4008-000-562

(46)江南证券

注册地址:江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人:姚江涛

公司网站:www.scstock.com

客户咨询电话:0791-6781119

(47)厦门证券有限公司

注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人:傅毅辉

公司网站:www.xmzq.cn

客户咨询电话:0592-5163588

(48)世纪证券

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦41层

法定代表人:卢长才

公司网站:www.csco.com.cn

客户咨询电话:0755-83199511

(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:0755-83515509

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

会计师事务所名称:德勤华永会计师事务所有限公司

注册 地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼

办公地址:中国北京市东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层

法定代表人:谢英峰

电话:+86 10 85207788

传真:+86 10 85181218

联系人:郭新华

经办注册会计师:景宜青 郭新华

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:

(1)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。

(2)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(PE)、市净率法(PB)、经济价值息税折旧摊销前利润法(EVAEBITDA)、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、成长型和持续型。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