宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更新招募说明书摘要

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

日期:二〇一二年四月

重 要 提 示

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资人投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。基金管理人的过往业绩并不代表将来业绩。

投资有风险,投资人购买基金时应认真阅读招募说明书。

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。

本基金基金合同自2005年3月8日起正式生效。

本招募说明书《更新》所载内容截止日为2012年3月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31日。基金托管人中国工商银行对本招募说明书《更新》中的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:深圳市深南路6008号特区报业大厦1501

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:张新元

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、公司高级管理人员

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、稽核法律部总经理,现任中国对外经济贸易信托有限公司董事会秘书兼投资发展部总经理。

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。

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。

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年任厦门市博办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、梅花伞、众和股份独立董事。

汪钦先生,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

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,先后担任办公室财会组副组长、组长、办公室副主任、研究室巡视员。2000年11月退休。

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理财中心总经理。

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。目前,其担任宝盈基金管理有限公司总经理助理兼研究部总监。

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人事法律工作。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、基金经理简历

高峰先生,1971年10月生,北京大学经济学硕士。1995年8月-2000年7月任中国化工进出口总公司财务部财务综合部经理、中国对外经济贸易信托投资有限公司计划财务部任财务科科长和公司发展战略小组成员。2000年8月-2003年8月加入宝盈基金管理有限公司,参加公司的筹备工作,2001年5月公司正式成立后,历任研究发展部高级策略分析师、副总经理。2003年9月-2009年10月,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,任富韬证券投资集合资金信托的投资管理人。2009年10月加入宝盈基金管理有限公司,现任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历任基金经理姓名及管理本基金时间:

夏和平,2009年12月26日至2010年11月19日。

陆万山,2009年3月3日至2010年9月2日。

姚刚,2007年5月9日至2009年5月12日。

祝东升,2005年3月8日至2007年5月9日。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

汪钦先生,宝盈基金管理有限公司总经理。

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。

陈若劲女士:宝盈基金管理有限公司固定收益部总监、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司

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

成立时间:1984年1月1日

批准设立机关及批准设立文号:国务院〔关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发〔1983〕146号)

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币349,018,545,827元

存续期间:持续经营

经营范围:

办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外结算;办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务;代理资金清算;提供信用证服务及担保;代理销售业务;代理发行、代理承销、代理兑付政府债券;代收代付业务;代理证券投资基金清算业务(银证转账);保险代理业务;代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务;保管箱服务;发行金融债券;买卖政府债券、金融债券;证券投资基金、企业年金托管业务;企业年金受托管理服务;年金账户管理服务;开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务;资信调查、咨询、见证业务;贷款承诺;企业、个人财务顾问服务;组织或参加银团贷款;外汇存款;外汇贷款;外币兑换;出口托收及进口代收;外汇票据承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券;自营、代客外汇买卖;外汇金融衍生业务;银行卡业务;电话银行、网上银行、手机银行业务;办理结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

(二)主要人员情况

截至 2011年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工145人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年12月,中国工商银行共托管证券投资基金231只,其中封闭式7只,开放式224只。自2003年以来,本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的28项最佳托管银行大奖;2010年,本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

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:方仲姬

2、代销机构

①中国工商银行

注册地址: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

②中国建设银行

注册地址: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中国农业银行

注册地址:北京市海淀区复兴路甲23号

客户服务电话:95599

公司网址:www.abchina.com

④中国银行

注册地址: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

注册地址: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

注册地址: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

注册地: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中国民生银行

注册地址: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:http://www.cmbc.com.cn/

⑨北京银行

注册地址: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:http://www.bankofbeijing.com.cn

⑩平安银行

注册地址: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:http://www.18ebank.com/

⑪国泰君安证券

注册地址: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

注册地址: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

注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

客户服务电话:95536

公司网址:www.guosen.com.cn

⑭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

客户服务电话:95565

公司网址:www.newone.com.cn

⑮广发证券

注册地址: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

注册地址: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.ecitic.com

⑰中国银河证券

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦c座

客户服务电话:4008888888

公司网址:www.chinastock.com.cn

⑱海通证券

注册地址: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

注册地址: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

注册地址: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

注册地址: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

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

客户服务电话:0755-82825555

公司网址:www.essences.com.cn

(23)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

客户服务电话:023-63786187

公司网址:www.swsc.com.cn

(24)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

客户服务电话:0571-96598

公司网址:www.bigsun.com.cn

(25)万联证券

注册地址:广州市中山二路18号电信广场36-37层

客户服务电话:4008888133

公司网址:www.wlzq.com.cn

(26)国元证券

注册地址: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

注册地址:天津市河西区宾水道3号

客户服务电话:022-28455588

公司网址:www.ewww.com.cn

(28)华泰证券

注册地址:江苏省南京市中山东路90号

客户服务电话:025-84457777

公司网址:http://www.htsc.com.cn

(29)中信万通证券

注册地址: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

(30)东吴证券

注册地址: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

(31)东方证券

注册地址: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

(32)长城证券

注册地址: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

(33)国联证券

注册地址: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

(34)浙商证券

注册地址: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

(35)平安证券

注册地址: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

(36)国海证券

注册地址: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

(37)国都证券

注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层(100007)

客户服务电话:400-818-8118

公司网址:www.guodu.com

(38)东海证券

注册地址: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

(39)国盛证券

注册地址: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

(40)华西证券

注册地址: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

(41)宏源证券

注册地址: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

(42)齐鲁证券

注册地址: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

(43)第一创业证券

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

客户服务电话:0755-25832686

公司网址:www.firstcapital.com.cn

(44)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

客户服务电话:4008888228

公司网址:www.jyzq.com.cn

(45)中航证券

注册地址: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

(46)中投证券

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-21层

客户服务电话:4006008008

公司网址:www.china-invs.cn

(47)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

客户服务电话:0755-3333118-8806

公司网址:www.tyzq.com.cn

(48)厦门证券

注册地址: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

(49)世纪证券

注册地址: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

(50)中金公司

注册地址: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

(51)信达证券

注册地址: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

(52)英大证券

注册地址: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.ysun.com

(53)华福证券

注册地址: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

(54)天相投顾

注册地址: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:010-66045666

公司网址:www.txsec.com

(55)光大证券

注册地址: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

(56)东莞农村商业银行

注册地址:东莞市南城路2号

客户服务电话:961122

公司网址:www.drcbank.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:0755-83275466

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有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

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

传真:021)23238800

联系人:单峰

经办注册会计师:汪棣、单峰

四、基金的名称

本基金名称:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金。

五、基金类别

本基金类型:契约型开放式股票基金。

六、基金的投资目标

本基金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。

七、基金的投资范围和对象

本基金投资对象为国内依法公开上市的股票、债券、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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%;现金或持有期限为1年以内政府债券的投资比例不低于5%。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

本基金非现金资产中,不低于80%的资金将投资于在泛沿海区域注册的上市公司发行的证券。同时,本基金将根据区域经济发展情况、证券市场的阶段性变化,以不超过非现金资产20%的部分投资于泛沿海区域以外地区注册的、具有持续增长潜力的上市公司证券。

八、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。

1、资产配置策略

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。

2、区域资产及行业权重配置策略

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。

3、个股选择策略

在个股选择层面,本基金以PEG、每股经营活动现金流量、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有持续增长潜力的上市公司进行投资。具体选股程序为:

①区域选股

从沪、深两市所有A股中选择注册地在泛沿海区域的上市公司,剔除ST、*ST股票、亏损股票及正在接受监管部门调查的问题股票,构成本基金的泛沿海区域基础股票备选库;

②数量选股

将基础股票备选库中的所有股票,先按每股现金流量排序,选择每股现金流量较高的70%的股票,再从中选择预期PEG低于行业平均水平的股票构成投资股票备选库;投资股票备选库每年在4月30日上市公司年度报告出齐后整体调整一次,日常则可根据股票价格变动情况进行微调。

预期PEG值的计算公式如下:

其中,P为计算日股票的收盘价,EPS为上市公司最新年报的每股收益,@为根据上市公司历史财务数据、实地调研、财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务利润增长率。

对于每年5月至下一年度4月上市的新股,本基金将其作为一个特殊资产分类,由基金管理人根据具体市场情况决定投资。

③基本面选股

由基金管理人的研究人员对投资备选股票库中的股票进行基本面价值评估,选择预期具有持续增长潜力的公司构建最终股票组合。

4、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。

5、产品风险以及管理

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。本基金运用宝盈量化风险管理系统和宝盈基金绩效评估系统进行风险管理。

6、投资决策

1、决策依据

①国内国际宏观经济环境;

②国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策;

③证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况;

④上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势;

⑤上市公司盈利能力、增长能力和创新能力,以及对公司综合价值的评估结论;

⑥国家有关法律、法规和基金契约的有关规定;

2、决策程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,投资决策程序如下:

①在基金合同规定的投资方向、投资理念和投资限制的范围内,基金经理根据公司投资部和外部专业研究机构对宏观经济、政策取向、市场趋势和特点进行的深入研究,在此基础上制定资产配置策略和投资策略建议,经过投资决策委员会讨论通过后作为进行整体资产配置的决策依据;

②公司投资部行业研究员和金融工程部数量分析研究员对上市公司进行详细分析、调研的基础上,构建基金投资备选库,推荐给基金经理。基金经理根据基金契约规定、整体资产配置方案,适当参考外部专业研究机构的投资建议报告,在公司统一的备选股票池中选择合适的投资品种。

③基金经理结合自己对市场的分析和判断制定投资组合草案,提交投资决策委员会审议。投资组合草案包括计划投资股票的清单和数量范围;

④投资决策委员会对基金经理的投资组合草案进行讨论和表决,通过后形成投资组合方案;如草案不获通过,基金经理负责对草案进行修改后,提交投资决策委员会继续讨论;

⑤基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划,构建投资组合;

⑥金融工程部对投资组合进行风险评估,并将评估结果和调整建议向投资决策委员会反馈;

⑦投资决策委员会和基金经理根据市场变化和风险评估结果对基金投资组合进行调整。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

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。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告(截止2011年12月31日)

(一)基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,981,270,391.38	93.97
	其中:股票	1,981,270,391.38	93.97
2	固定收益投资	5,157,118.20	0.24
	其中:债券	5,157,118.20	0.24
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	114,519,767.88	5.43
6	其他资产	7,508,797.32	0.36
7	合计	2,108,456,074.78	100.00

(二)行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,073,197,253.13	51.25
C0	食品、饮料	117,084,390.41	5.59
C1	纺织、服装、皮毛	87,019,205.55	4.16
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	42,412,941.20	2.03
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	177,797,756.12	8.49
C7	机械、设备、仪表	507,557,629.89	24.24
C8	医药、生物制品	85,211,432.12	4.07
C99	其他制造业	56,113,897.84	2.68
D	电力、煤气及水的生产和供应业	17,265,264.94	0.82
E	建筑业	140,608,883.00	6.71
F	交通运输、仓储业	248,986,178.36	11.89
G	信息技术业	173,644,331.40	8.29
H	批发和零售贸易	43,735,824.00	2.09
I	金融、保险业	78,850,800.00	3.77
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	99,186,616.71	4.74
L	传播与文化产业	61,173,740.60	2.92
M	综合类	44,621,499.24	2.13
	合计	1,981,270,391.38	94.61

(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	占基金资产净值比例(%)
1	000400	许继电气	8,408,087	162,696,483.45	7.77
2	601669	中国水电	34,378,700	140,608,883.00	6.71
3	600029	南方航空	23,249,804	110,204,070.96	5.26
4	300187	永清环保	2,088,579	99,186,616.71	4.74
5	300004	南风股份	3,479,890	85,396,500.60	4.08
6	600559	老白干酒	3,942,027	82,112,422.41	3.92
7	002230	科大讯飞	2,053,000	71,855,000.00	3.43
8	600331	宏达股份	7,545,421	62,777,902.72	3.00
9	601111	中国国航	9,700,000	61,789,000.00	2.95
10	600062	双鹤药业	3,900,000	60,840,000.00	2.91

(四)按券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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,157,118.20	0.25
8	其他	-	-
9	合计	5,157,118.20	0.25

(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

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	110017	中海转债	56,190	5,157,118.20	0.25

(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、报告期内本基金所投资的前十名证券的发行主体无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。

3、其他资产明细

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,098,780.49
2	应收证券清算款	5,347,784.85
3	应收股利	-
4	应收利息	39,699.08
5	应收申购款	22,532.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,508,797.32

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	601669	中国水电	140,608,883.00	6.71	网下新股流通受限

6、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

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2005 年3 月8 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:截止2011年12月31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
2005年3月8日-2005年12月31日	3.21%	0.57%	-7.41%	1.10%	10.62%	-0.53%
2006年度	105.78%	1.40%	96.64%	1.08%	9.14%	0.32%
2007年度	97.67%	1.84%	72.93%	1.76%	24.74%	0.08%
2008年度	-54.07%	2.20%	-55.69%	2.28%	1.62%	-0.08%
2009年度	35.43%	1.78%	61.36%	1.52%	-25.93%	0.26%
2010年度	-24.04%	1.49%	-10.83%	1.14%	-13.21%	0.35%
2011年度	-23.03%	1.22%	-16.85%	0.92%	-6.18%	0.30%

十三、基金的费用概览

(一)基金的费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金的证券交易费用;

4、基金合同生效后与本基金相关的信息披露费用;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金合同生效后与本基金相关的会计师费和律师费;

7、银行汇划手续费;

8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二)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按基金资产净值的1.5%年费率计提。

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

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第(一)款第3至第9项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(三)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资产的损失,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。基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。

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、更新了“四、基金托管人”相应内容。

2、在“五、相关服务机构”部分,更新了相关销售机构信息。

3、在“九、基金份额的交易、申购和赎回”部分,更新了《(一)基金的转换》的内容。

4、在“九、基金的投资”部分,更新了本基金投资组合报告的内容。

5、在“十、基金的业绩”章节,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

6、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”的相应内容。

7、在“二十二、其他应披露事项”里,新增基金定投费率优惠公告、新增电子渠道费率优惠公告、新增代销机构公告、停牌股票估值提示性