宝盈策略增长股票型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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: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×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

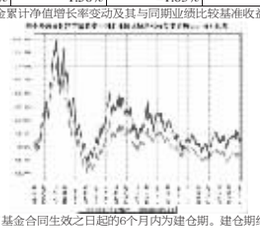
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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



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	2009年7月1日	-	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。
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	-	5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,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。

报告期内,本基金持有中国重工超过规定比例,在第十一个工作日调整完毕。针对该事项,公司制订了措施确保不再出现类似情况。我们将严格遵守相关法律法规的规定,保证基金运作合法合规,维护持有人利益。

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,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

我们在三季报中对四季度展望时曾指出,四季度成长股承压较大,并同时认为优质个股依旧有年度估值切换机会。四季度基本延续思路操作,因此在季初成长股调整后,增持了有业绩支撑可享受年度估值切换的优质个股,基金收益率在季中创出新高。四季度末由于IPO重启、发行制度改革、向注册制逐渐过度、资金紧张等综合负面因素影响下,市场延续了调整态势,大盘蓝筹和小盘成长都出现普跌。尽管在季中重仓股上涨过程中已经小幅减仓,但季末净值还是有一定回撤。

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-2.88%,同期业绩比较基准收益率是-1.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场短期最大的担忧是资金利率高企,流动性不足,对实体经济和股市都不利,因此指数持续低迷,只有创业板为代表的局部性机会。新股发行重启,加剧了对资金分流的担忧。

本基金管理人认为,虽然利率高企及新股发行一时难以改观,但以高铁、电力等具有稳定盈利预期的蓝筹股为例,估值已经相当便宜,已经体现了对GDP骤速、流动性不足的担忧。对于市场担忧的创业板估值较高的问题,我们认为以互联网为代表一些新经济模式,不能单纯的以PE高低来衡量其投资价值。创业板阶段性的泡沫通常市场自身会通过调整来挤压。由于创业板代表了中国当前经济转型的方向,尤其是一些优秀的民营企业已经在向拥有国际竞争力迈进,因此创业板即便在供应不断增加的格局下,景气度持续向上的行业个股依旧能有超越市场的表现。

看好的方向有两端,一个是具高活力的优秀成长领域,一个是具有稳定盈利预期的超低估值蓝筹。具体分四个方向,成长领域两个方向:(1)极具颠覆性的互联网领域,其中会最关注与BAT(Baidu、Alibaba、Tencent)具有潜在合作机会的、以及互联网金融;(2)政策或者改革外因带来巨变化的,主要看好围绕"国家安全"的信息安全领域、军工领域;超低估值蓝筹领域的两个方向:(1)行业本身景气,具有稳定盈利预期的,包括高铁、电力等;(2)过去连续超跌充分反应悲观预期的,有望出现类似2013年商业零售、交运的修复行情的,例如白酒。

对于改革,我们主要会关注本身行业景气向上,且同时兼具改革带来超预期的机会,主要还是军工领域、信息安全领域。对于本身竞争性行业或者产能过剩行业,改革可以带来激励和改善的,不极以过高期望。

§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	2,318,780,516.55	78.56
	其中:股票	2,318,780,516.55	78.56
2	固定收益投资	89,757,000.00	3.04
	其中:债券	89,757,000.00	3.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	226,995,633.50	7.69
	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	298,990,823.74	10.13
6	其他资产	17,003,273.62	0.58
7	合计	2,951,527,247.41	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	-	-
C	制造业	963,810,270.49	33.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	67,770,750.00	2.33
F	批发和零售业	44,778,997.42	1.54
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	1,211,502,307.46	41.62
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	30,918,191.18	1.06
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	2,318,780,516.55	79.66

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	002368	太极股份	8,877,500	289,051,400.00	9.93
2	300059	东方财富	16,964,490	257,520,958.20	8.85
3	600518	康美药业	13,748,929	247,480,722.00	8.50
4	601989	中国重工	39,520,932	221,712,428.52	7.62
5	300182	捷成股份	4,398,906	174,988,480.68	6.01
6	600536	中国软件	3,738,364	140,824,171.88	4.84
7	300322	硕贝德	4,209,518	128,053,537.56	4.40
8	300253	卫宁软件	1,553,000	112,763,330.00	3.87
9	300168	万达信息	3,409,165	95,388,436.70	3.28
10	002230	科大讯飞	1,800,000	86,130,000.00	2.96

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	89,757,000.00	3.08
	其中:政策性金融债	89,757,000.00	3.08
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	89,757,000.00	3.08

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

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	89,757,000.00	3.08

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

5.8.1 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投资股指期货。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1
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。

5.10.2
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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,260,999.41
2	应收证券清算款	14,119,359.15
3	应收股利	-
4	应收利息	605,897.39
5	应收申购款	17,017.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,003,273.62

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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	2,878,131,549.25
报告期期间基金总申购份额	1,336,424,977.04
减:报告期期间基金总赎回份额	653,250,103.26
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	3,561,306,423.03

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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1月22日

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金

【2013】第四季度报告

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: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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1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10月1日起至12月31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	5,452,202,660.47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(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	60,391,230.68
2.本期利润	11,440,866.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0021
4.期末基金资产净值	2,450,375,771.64
5.期末基金份额净值	0.4494

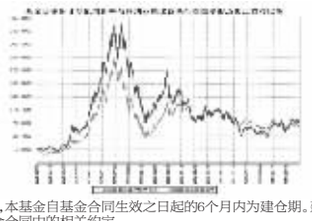
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.74%	1.06%	-2.01%	0.79%	2.75%	0.27%

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	-	13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福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律师资格。

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

第四季度,市场总体呈现震荡整理的格局,以创业板为代表的电子信息、传媒等新兴产业高位震荡,以金融、地产等为代表的大盘低估值指标股低位震荡。在第三季度报告中我们提到,第四季度决定市场走势的主要因素在于三中全会对于经济管理体制及国有企业改革的方向和力度,但对结构性行情之后形成的结构性风险更为关注,因此坚持了下半年以来的一贯策略,在保持较高权益类资产投资比例的同时,更强调组合的结构均衡,强调对医药、消费、商业零售等长期稳定增长行业的配置,同时也坚持配置一定比例的金融、地产、汽车、等低估值蓝筹品种以及化工、航空航运等强周期品种。对于新兴产业,坚持更为严格的标准,综合考虑其核心竞争力、技术门槛、业绩成长的确定性以及估值水平,自下而上进行精选。

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0.74%,同期业绩比较基准收益率是-2.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们一直认为中国经济和社会的长期发展,既有空间,又有动力,三中全会系列文件的公布以及后续改革动作的出台,坚定了我们对中国长期发展的乐观判断,我们认为这是在中国现存各种约束条件下所能期待的、保持中国平稳发展的最好结果。

关于对2014年宏观经济和政策的判断,数据方面我们和市场主流观点并没有大的不一致,但对数字背后的意义却没有那么悲观。市场目前谨慎的最重要的原因,在于对流动性环境和信用风险爆发点担忧,这两者又是密切联系的。我们同意2014年会有一个信用风险比较集中的爆发,其实信用风险一直都存在,2013年爆的主要是超高利率的民间集资,只是市场没有给予足够重视罢了,2014年可能会发展到部分信托或银行理财产品。但和市场观点不同的是,第一,我们认为信用风险是非系统性风险,而不是系统性风险,政府也完全有能力把它控制在非系统性风险的范畴;第二,信用风险的爆发对金融、经济、证券市场都是好事,不是坏事,会有效降低无风险利率,增加市场的流动性。现在市场认为的无风险利率高企,那是把银行、信托理财产品的收益率当成了无风险收益率,只有这些产品的风险暴露,部分产品到期无法全部支付本息的时候,市场才会意识到这些都是风险资产,逐步将无风险收益率的标准调整到一年期国债的收益率,也就是3%到4%的水平,这对于降低政府及实体企业的融资成本无疑是非常有利的,也可以解决实体经济差而利率高企的悖论;第三,市场意识到的无风险利率的下降,会整体增强权益市场、尤其是分红收益率较高的大盘蓝筹股的吸引力。

§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	2,302,573,244.76	90.08
	其中:股票	2,302,573,244.76	90.08
2	固定收益投资	99,426,000.00	3.89
	其中:债券	99,426,000.00	3.89
	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	140,750,312.23	5.51
6	其他资产	13,493,955.22	0.53
7	合计	2,556,243,512.21	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	119,584,622.99	4.88
C	制造业	1,132,643,627.29	46.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,840,000.00	1.50
F	批发和零售业	131,532,789.17	5.37
G	交通运输、仓储和邮政业	203,168,725.91	8.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	192,064,438.96	7.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	424,186,334.44	17.31
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	62,552,706.00	2.55
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	2,302,573,244.76	93.97

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	600162	香江控股	26,376,271	146,388,304.05	5.97
2	000024	招商地产	7,000,000	145,460,000.00	5.94
3	300006	莱美药业	3,900,000	113,022,000.00	4.61
4	600096	云天化	11,508,423	102,424,964.70	4.18
5	600048	保利地产	11,354,826	93,677,314.50	3.82
6	600184	光电股份	4,220,727	90,323,557.80	3.69
7	601989	中国重工	16,000,000	89,760,000.00	3.66
8	601718	际华集团	31,424,660	87,046,308.20	3.55
9	000566	海南海药	7,651,835	85,547,515.30	3.49
10	600809	山西汾酒	4,125,317	79,618,618.10	3.25

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	99,426,000.00	4.06
	其中:政策性金融债	99,426,000.00	4.06
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	99,426,000.00	4.06

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

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	130322	13进出22	800,000	79,552,000.00	3.25
2	130414	13农发14	200,000	19,874,000.00	0.81

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

5.8.1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投资股指期货。

5.8.2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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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投资国债期货。

5.9.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	10,338,487.83
3	应收股利	-
4	应收利息	1,544,437.78
5	应收申购款	87,509.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,493,955.22

5.10.4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。

5.10.5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。

5.10.6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	5,610,873,298.57
报告期期间基金总申购份额	750,329,013.28
减:报告期期间基金总赎回份额	908,999,651.38
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	5,452,202,660.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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1月22日

广发天天红发起式货币市场基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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22日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发天天红
基金主代码	000389
交易代码	000389
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2013年10月22日
报告期末基金份额总额	2,175,459,202.13份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于金融比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。 (一)利率预期策略 影响利率走势的因素很多,影响短期利率变动的因素更多,运行方式也更为复杂。基金管理人将重点考察以下两个因素: 1.中央银行、财政部等国家宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场运行的影响非常深远。国家宏观经济管理部门尤其是中央银行对经济运行形势的判断及采取的应对政策是影响市场利率走势的主要因素之一。 2.短期资金供求变化。短期资金市场参与者的头寸宽紧程度是短期利率变动的重要主导力量。短期利率随短期资金供求变化呈一定的季节波动形态。 具体而言,本基金管理人将持续跟踪国际经济变化的宏观经济指标、对国家经济政策进行深入分析,通应对短期利率的变化走势做出及时反应。重点关注的宏观经济指标包括:国家经济管理部门政策、预期物价指数、相关市场资金供求关系等等。 在分析方法上,本基金管理人坚持定性与定量相结合的分析方法。 (二)期限配置策略 在期利率期限结构分析的基础上,根据对投资对象流动性和收益性的动态考察,构建合理期限结构投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般说来,预期利率上涨时,将