宝盈资源优选股票型证券投资基金

更新招募说明书摘要

宝盈资源优选股票型证券投资基金由鸿飞证券投资基金转型而成。依据中国证监会2008年3月31日证监许可[2008]392号文核准的鸿飞证券投资基金基金份额持有人大会决议，鸿飞证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“宝盈资源优选股票型证券投资基金”，自2008年4月15日起，由《鸿飞证券投资基金基金合同》修订而成的《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》生效。

重要提示

基金管理人保证本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募集的核准，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。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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4月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日。基金托管人中国建设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

名称：宝盈基金管理有限公司

注册及办公地址：广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第15层

法定代表人：李建生

总经理：陆金海

组织形式：有限责任公司

成立时间：2001年5月18日

注册资本：1亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：（0755）83276688

传真：（0755）83515599

联系人：张晰

股权结构：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。

（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职公司副总裁，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。

郭鸣先生，董事，1974年生，MBA毕业，曾任中山新北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，在中国人民银行印刷局工作，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。

杨渊先生，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。目前，其担任宝盈基金管理有限公司市场部总监兼任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粗船部高级执行人员；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9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、研究部总助；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

欧阳东华先生，45岁，中南工业大学工学硕士，具有12年证券从业经历。曾在深圳蓝天基金管理公司从事证券研究工作，2002年5月加入宝盈基金管理有限公司从事行业研究工作。现任宝盈基金管理有限公司宝盈资源优选股票型证券投资基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金经理。

中国证券业协会于5月25日审核完成对杨宗亮担任宝盈资源优选基金经理的注册登记。

杨宗亮先生，35岁，经济学博士，具有6年金融从业经历。曾在国家开发银行综合计划局、深圳国信证券综合研究所和中再资产管理股份有限公司从事统计模型与方法研究、宏观研究、证券市场投资策略构建、产品设计和风险管理等工作。2007年10月加入宝盈基金管理有限公司，现任宝盈基金管理有限公司金融工程部副总监、宝盈资源优选股票型证券投资基金经理。

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。

余述胜先生：宝盈基金管理有限公司研究部执行总监。

杨宗亮先生：宝盈基金管理有限公司金融工程部副总监。

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

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一，中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号：HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。

2008年，中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先，截止2008年12月31日，中国建设银行实现净利润926.4亿元，较上年增长34%；平均资产回报率为1.3%，平均股东权益回报率为20.7%，分别较上年提高0.16个百分点和1.18个百分点，居全球银行业最好水平；每股盈利为0.4元，比上年增长0.10元；总资产达到75,554.52亿元，较上年增长14.51%；资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为2.21%，较上年下降0.39个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为131.58%，较上年提升27.17个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约、悉尼设有代表处，纽约分行、伦敦子银行正式获颁营业执照。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）31,896台，居全球银行业首位。

2008年，中国建设银行在英国《金融时报》公布的「全球500强」中列第20位；在美国《财富》杂志公布的全球企业500强中由上年的第230位上升至第171位；被《福布斯(亚太版)》评为“亚太地区最佳上市公司50强”；被《银行家》杂志评为“中国商业银行竞争力(财务指标)第一名”和“最佳商业银行”；被美国《环球金融》杂志 评为“最佳公司贷款银行”和“最佳按揭贷款银行”；荣获香港上市公司商会“公司管治卓越奖”、《亚洲银行家》杂志“零售风险管理卓越奖”、中国民政部颁发的“中华慈善奖－最具爱心内资企业奖”和香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队，涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计，安永会计师事务为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

（二）主要人员情况

罗中冷，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行，中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

截止到2008年12月31日，中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等7只封闭式证券投资基金，以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华－道琼斯88指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票（LOF）、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合（LOF）、华夏中小板ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票（LOF）、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票（LOF）、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票（QDII）、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票（QDII）、海富通中国海外股票（QDII）、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信2026周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票（QDII）、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票（LOF）、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合等89只开放式证券投资基金。

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：方仲妮

2、代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司

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

（2）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

客户服务电话：95588

（3）中国银行股份有限公司

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

（4）中国农业银行

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

法人代表：项俊波

办公地址：北京市西三环北路100号金玉大厦

信息披露负责人：李芳菲

电话：010－68424199

（5）中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市宣武门西大街131号

法定代表权人：刘安东

客户服务电话：11185

（6）招商银行股份有限公司

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

（7）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

（8）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

（9）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

（10）交通银行

注册地：上海市仙霞路18号

客户服务电话：95559

（11）西南证券有限责任公司

住所：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

电话：023－63786397

传真：023－63786312

联系人：杨卓颖

网址：www.swsc.com.cn

客户服务电话：023－63786633

（12）安信证券股份有限公司

注册地址：广州市解放南路123号金汇大厦

法定代表人：杨池生

开放式基金咨询电话：020－96210

开放式基金业务传真：020－83270505

网址：www.stock2000.com.cn

（13）国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格广场45层

法定代表人：王少华

联系人：马泽承

电话：010－64482829－390

传真：010－64482090

客户服务热线：800－810－8809

（14）国联证券有限责任公司

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

（15）万联证券

住所：广州市中山二路18号电信广场36－37层

法定代表人：李舫金

基金业务咨询电话：020－37865026

联系人：李俊

（16）平安证券有限责任公司

住所：深圳市八卦三路平安大厦三楼

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法人代表：叶黎成

电话：0755－82450826

传真：0755－82400862

联系人：袁月

网址：www.pa18.com

客户服务电话：95511

（17）招商证券股份有限公司

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

（18）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

（19）中国银河证券有限责任公司

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

（20）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：魏云鹏

电话：0755－83516094

传真：0755－83516199

联系人：高峰

（21）兴业证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦

营业理层高：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

（22）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈思

电话：010－84588888

传真：010－84865560

（23）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东大道720号20楼

法定代表人：王益民

联系人：盛云

电话：021－62476600*3019

传真：021－62474651

客户服务热线：021－962506

（24）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：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

联系人：齐晓燕

电话：0755－82130833－2149

（25）中信建投证券股份有限公司

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：010－65186758

传真：010－65182261

联系人：权唐

（26）中信万通证券有限责任公司

总部地址：青岛市崂山区香港东路316号

邮编：266000

联系人：丁韶燕

电话：0532－85022026

（27）中信金通证券

注册地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯匯院商务楼A座

电话：96598

（28）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：020－87555888转各营业网点

传真：020－87557987

（29）东吴证券有限责任公司

注册地址：苏州市十梓街298号

法定代表人：吴水泉

电话：0512－65581136

传真：0512－65588021

联系人：方晓丹

（30）华西证券

注册地址：四川省成都市洗面街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

（31）东海证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人：朱科敏

联系人：邵一明

电话：021－50586660

（32）长江证券有限责任公司

注册地址：武汉市新华路特8号

法定代表人：胡运钊

联系人：甘露

电话：021－63296362

传真：021－51062920

客户服务热线：4008－888－999

（33）浙商证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路1号

法定代表人：方云梯

电话：0571－87901908

传真：0571－87901973

联系人：刘虹

（34）国泰君安证券股份有限公司

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

（35）海通证券股份有限公司

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

（36）第一创业证券有限责任公司

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

（37）金元证券有限责任公司

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

（38）国元证券有限责任公司

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

传真：010－64402809

联系人：赵康、李蔡

（39）联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马昭明

电话：0755－82493561

传真：0755－82492962

联系人：盛宗凌

（40）国元证券有限责任公司

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

传真：0791－6289395

联系人：万齐志

（41）中银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

客户咨询电话：021－962505

（42）中国建银投资证券有限责任公司

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

（43）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

（44）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

（45）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

（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：广东华商律师事务所

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

法人代表：谢英峰

经办注册会计师：景宜青 郭新华

电话：+86 10 85207788

传真：+86 10 85181218

联系人：郭新华

四、基金的名称

本基金名称：宝盈资源优选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，处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值，相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型，优选各个行业中具有资源优势的上市公司，建立股票池。在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。

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；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，在履行适当程序后，基金管理人可相应调整本基金的投资比例规定。

基金的投资组合比例为：股票投资的比例范围为基金资产的60%－95%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为0－40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有资源优势的股票。

八、基金的投资策略

本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合，并注重资产在各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。

（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。

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。

（2）股票配置策略

本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。

在个股选择层面，本基金以净资产收益率、预期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备持续增长潜力的上市公司进行投资。

1）形成投资股票备选库

根据上市公司资源的类别、数量、与主营业务的密切程度判断公司是否属于资源类公司，所有资源类公司形成资源类基础股票备选库；

对基础股票备选库中的所有股票，综合考虑净资产收益率、预期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选出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：

$$PEG=\frac{P/EPS}{g^e}$$

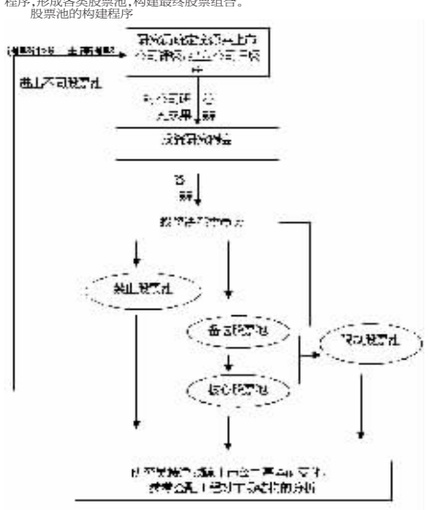
其中：P为计算日股票的收盘价，EPS为上市公司最新年报的每股收益，g^e为根据上市公司历史财务数据、实地调研、财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务利润增长率。

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，由基金管理人根据公司基本面及具体市场情况决定投资。

2）建立各类股票池

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，通过公司股票池的构建程序，形成各类股票池，构建最终股票组合。

股票池的构建程序



如图1，首先根据对资源类上市公司的评级建立“公司评级库”。各行业研究员按影响其相关行业上市公司投价值和投资风险的主要因素，就行业、核心竞争力、公司成长性、投资风险、市场估值这五个方面，分别制定进一步细化的定性和定量分析指标，形成分行业的《上市公司投资评级指标体系》。以此作为各行业股票进行投资评级管理的依据，并进而精选出具备持续增长或阶段性高速增长能力、且价值被低估的优势企业形成公司的股票池。如研究员要调整股票的投资评级，须及时提交股票投资评级调整报告，投资评级调整报告需附上《上市公司投资评级表》，并就调整的原因做出说明。各行业研究员应将其所负责行业的《上市公司投资评级指标体系》及其每次重大调整报研究部总监备案。

在公司评级库的基础上，通过进行全面深入的研究分析，经有投资部、研究部共同参加的投资研究联席会议集中讨论，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。

（3）债券及短期金融工具投资策略

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。

1）利率预期策略下的债券选择

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益，例如预期利率下调时适当加大长久期债券的投资比例，为债券组合赢得价格收益；预期利率上升时减少长久期债券的投资，降低基金债券组合的久期，以控制利率风险。

2）收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。基金管理人通过预测收益率曲线形状的变化，调整长久期债券组合内部品种的比例获得投资收益。

3）信用度分析

信用度分析是企业债的投资策略。基金管理人通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行更细致的调研，准确评价债券的违约概率和提早预测债券评级的改变，从而取得价格优势或进行套利。

4）收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下，比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

5）相对价值评估

基金管理人运用该种策略的目的在于识别被市场错误定价的债券，并采取适当的交易以期获利。一方面基金管理人通过利率期限结构，评估处于同一风险层次的多只债券中，究竟哪些更具投资价值，另一方面，通过综合考察债券等级、息票率、所属行业、可赎回条款等因素对率差的影响，评估风险溢价。

4）权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

5、投资决策程序及依据

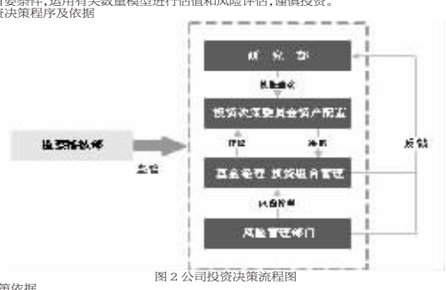


图2 公司投资决策流程图

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、法规和基金合同的有关规定。

2. 决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略；

（2）研究部根据自身或者其他研究机构的研究成果，构建各级股票池，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持；

（3）基金管理部根据投资决策委员会的投资战略，在研究支持下，结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟定基金的具体投资计划，包括：资产配置、策略配置、行业配置、重仓个股投资方案；

（4）投资决策委员会对基金管理部各基金提交的方案进行讨论论证分析，并形成决策纪要；

（5）金融工程研究中心定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

3. 投资操作程序

（1）在确定基金投资组合方案后，基金经理在投资组合方案和授权范围内，进行具体买卖决策，并向集中交易室下达统一规范、标准化的交易指令，实现证券品种的日常买卖；

（2）基金经理可以采用书面方式、电脑方式或电话录音方式下达委托交易指令，并采用书面方式或电子化方式记录，存档备案；基金经理不可以直接进行证券品种的交易；

（3）集中交易室的集中接单员接到基金经理的交易指令后，对其是否符合基金经理的权限和公司投资限制性指标进行审核；如符合，则分发到交易员执行，如不符合，则拒绝执行，并向风险控制执行官汇报审核；

（4）交易员执行经审核的交易指令，并将执行结果反馈基金经理；基金经理根据市场情况可以对投资指令进行调整；

（5）本基金管理人根据有关法律、法规、监管机构要求和公司内部管理制度，制定了一系列投资限制性指标，这些指标通过参数设置到投资管理系统，如果买卖指令与指标冲突，系统自动拒绝执行。

3. 投资组合分析与调整

公司投资组合调整过程如图3。

图3 投资组合调整过程图

投资决策委员会成员、基金经理和研究员根据宏观经济及投资策略，如果发现资产配置比例需要进行调整，可以提议召开投资决策委员会；

投资决策委员会集体决策是否调整资产配置比例；

如果投资决策委员会决定调整资产配置比例，基金经理只能在原来规定的资产配置比例内根据强度指标考虑是否调整投资组合；如果投资决策委员会调整资产配置比例，基金经理根据调整后的比例考虑调整投资组合；

行业研究员跟踪行业和个股因素，对已有的投资组合和股票池中股票进行动态评级，提出投资建议；基金经理对投资组合进行跟踪，参考研究员的投资建议，作出投资组合调整策略；

监察稽核部对投资组合调整的合规性和组合调整是否严格执行相应的流程进行实时监控。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

沪深300指数×75%＋上证国债指数×25%

沪深300指数由市