宝盈增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈增强收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2008年3月10日中国证监会证监许可[2008]325号《关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的批复》批准公开发售。本基金基金合同于2008年5月15日正式生效。

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。

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。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预示其未来业绩。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2009年5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：张晖

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理兼董事会秘书。

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开负责销售业务。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

陈若劲女士，1971年6月生，香港中文大学金融MBA，具有5年以上证券从业经历。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作，2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员，现任宝盈增强收益债券型证券投资基金经理。

宝盈增强收益债券型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

刘丰元，2008年5月15日至2008年12月24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。

余述胜先生：宝盈基金管理有限公司研究部执行总监。

杨宏亮先生：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）基金托管人情况

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

罗中涛，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（ODII）、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：方仲姬

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

（3）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

（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）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

（7）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

（8）中国民生银行股份有限公司

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）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

（10）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

（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：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

（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：010－64482828－390

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

（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：陈忠

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

（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：010－85130577

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号万凯庭院商务楼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

（29）东吴证券有限责任公司

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

（30）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

（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：湖北省武汉市江汉区新华路特8号

定代表人：明云成

联系人：李良

电话：021－63219781

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）国盛证券有限责任公司

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）申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

网址：www.sw2000.com.cn

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

（46）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

（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：0755－83515466

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：宝盈增强收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式债券型基金

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，本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会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。

基金的投资组合比例为：债券类金融工具（含可转换债券）占基金资产的比例为80%－95%，投资于股票等权益类金融工具占基金资产的比例为0－15%，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%。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股（含增发）申购以及二级市场股票投资之间的配置：

①基于对利率、信用等因素的分析，预测固定收益品种的风险和收益；

②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断；

③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析，预测新股申购的风险和收益；

④股票市场走势的预测。

2. 固定收益品种投资策略

（1）固定收益品种的配置策略

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

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。

（2）可转换债券的投资策略

着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

本管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

（3）资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

3. 股票投资策略

（1）新股（含增发）的投资策略

在参与股票一级市场投资的过程中，本基金管理人从行业景气度、成长性、核心竞争力等全面深入地把握上市公司基本面，运用宝盈基金的研究平台和股票估值体系，并参考同类公司的估值水平，深入发掘新股内在价值。并根据新股的中签率及上市后股价涨幅的统计，制定新股申购策略。

在新发股票获准上市后，本基金管理人将根据对股票内在价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，在新股上市后选择适当的时机卖出。

（2）股票二级市场的投资策略

在股票二级市场投资方面，本基金根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有核心竞争力、具有资源优势、具有高品牌价值、具有管理优势的龙头企业。本基金将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，应用本基金管理人设计的估值模型，选择价值被市场相对低估的企业进行投资。

4. 权证投资策略

本基金将权证投资作为在严格控制风险前期下提高基金投资组合收益的辅助手段。本基金的权证投资策略包括：

（1）根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；

（2）在产品定价时，主要采用市场公认的多种期权定价模型以及研究人员对公司基本面等因素的分析基础上形成的对权证的合理定价；

（3）本基金权证投资策略包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等等。

5. 投资决策流程

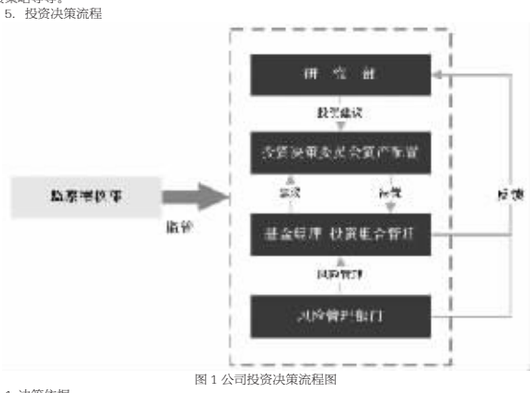

图1 公司投资决策流程图

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，构建各级债券池和股票池，对投资对象进行持续跟踪调研，并提供债券和股票决策支持；

（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、重仓券种投资方案；

（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。

6. 投资组合分析与调整

公司投资组合调整过程如图2。

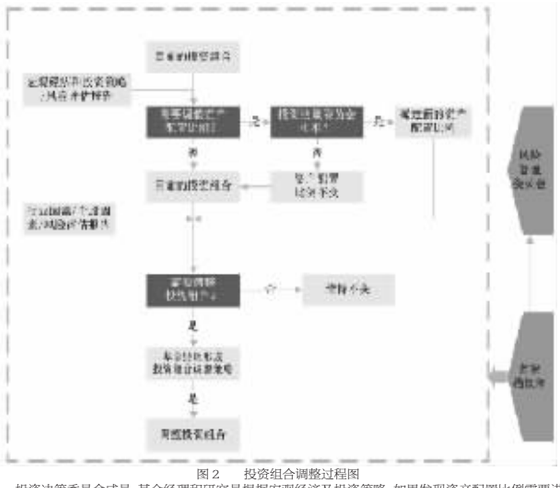

图2 投资组合调整过程图

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不调整资产配置比例，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；

研究员跟踪债券和个股因素，对已有的投资组合和债券池股票池中的证券进行动态评级，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

中信标普全债指数

中信标普全债指数涵盖国债、企业债、金融债、可转债，具有良好的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金，高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告（截止2009年3月31日）

（一）本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	9,116,575.10	0.77
	其中：股票	9,116,575.10	0.77
2	固定收益投资	1,094,339,653.10	92.91
	其中：债券	1,094,339,653.10	92.91
	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	51,886,706.53	4.41
6	其他资产	22,498,815.38	1.91
7	合计	1,177,841,750.11	100.00

（二）本报告期末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	采掘业	－	－
C	制造业	9,116,575.10	0.91
C0	食品、饮料	－	－
C1	纺织、服装、皮毛	－	－
C2	木材、家具	－	－
C3	造纸、印刷	－	－
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,051,145.10	0.91
C5	电子	65,430.00	0.01
C6	金属、非金属	－	－
C7	机械、设备、仪表	－	－
C8	医药、生物制品	－	－
C99	其他制造业	－	－
D	电力、煤气及水的生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	交通运输、仓储