

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

年金、产业基金、QDPI 资产、履约产品等十大类 14 项产品的托管业务体系。继 2004 年先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号后,2005 年,又分别获得《财资》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号。

三、相关服务机构

(一) 基金发售机构
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:0756-83276688
传真:0756-83615689
联系人:方冲敏

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
法定代表人:姜建清
客户服务电话:96588
联系人:中国工商银行客户服务中心
(2) 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:杨幼一
电话:021-62580818-213
传真:021-62569400
联系人:芮敏祺

(3) 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:贾波
电话:010-65663857
传真:010-65663861
联系人:李斌

(4) 华泰证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:021-53694666-4125
传真:021-53858549
联系人:姜颖、杨芸

(5) 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:010-66568857
联系人:张茜

(6) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝内大街 68 号
办公地址:北京朝内大街 188 号
法定代表人:黎晓刚
电话:010-65186758
传真:010-65182261
联系人:唐静

(7) 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:马国强
电话:0755-82492187
联系人:高源

(8) 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:魏云松
电话:0755-83510094
传真:0755-83616199
联系人:高峰

(9) 华泰证券有限责任公司
注册地址:南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-84457777-721
传真:025-84657879
联系人:袁虹彬

(10) 东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州干将路 298 号
法定代表人:吴永波
电话:0512-65681136
传真:0512-65688021
联系人:方晓丹

(11) 北京证券有限责任公司
注册地址:北京海淀区车公庄西路乙 19 号华通大厦 B 座 10 层
法定代表人:汲波源
电话:010-68431166-8009
传真:010-88018657
联系人:白源

(12) 天同证券有限责任公司
注册地址:山东省济南市泉城路 180 号齐鲁国际大厦 5 层
法定代表人:段琦
电话:0531-66896900
传真:0531-66899000
联系人:罗海峰

(13) 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:方云松
电话:0571-87901908
传真:0571-87901973
联系人:刘虹

(14) 国海证券有限责任公司
注册地址:中国广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人:张强
电话:0771-981100, 0756-82485852
传真:0756-82485852
联系人:张建新

(15) 兴业证券有限责任公司
注册地址:福建省福州市湖东路 99 号力大厦
资产管理总部:上海市陆家嘴东源路 166 号中厦大厦 18 层
法定代表人:兰志杰
电话:021-68419974
传真:021-68419867
联系人:杨盛芳

(16) 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:范劲
电话:(0510)82588168
传真:(0510)82331589
联系人:袁勇

(17) 第一创业证券股份有限公司
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

(18) 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:0755-83026695
传真:0755-83026225
联系人:金睿

(二) 注册登记机构
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:0756-83276688
传真:0756-83615609
联系人:陈静瑜

(三) 律师事务所和经办律师
律师事务所名称:北京市天元律师事务所
注册地址:北京市西城区阜成门北大街 17 号 8 层
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 11 层
法定代表人:王彦华

经办律师:刘路、周世君
电话:010-89092188
传真:010-89092150
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区东昌路 568 号
办公地址:上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法人代表:杨建生
经办注册会计师:汪敏、卓峰
电话:021-61238888
传真:021-61238900
联系人:蔡青

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就,在严格控制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 and 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的从其规定。

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和证券市场阶段性变化,以不超过非现金资产 20%的比例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,“自上而下”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状况、市场环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。2. 区域资产配置策略
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资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备持续增长潜力的上市公司进行投资。具体选股程序为:(1) 区域优选
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库。(2) 数量优选
将基础股票库中的所有股票,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公告出齐后调整一次,日常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:
$$PEG = \frac{P/E}{\rho}$$

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,ρ 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 月下旬下一年度 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) 基本面优选
由基金管理人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投资组合。4. 债券投资策略
本基金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、收益利率策略、套利交易策略以及利用正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. 衍生品投资策略
本基金限于以套期保值为目的进行股指期货交易,以对冲投资组合股票资产的系统性风险。6. 风险管理
本基金投资于区域增长型股票基金,风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间,适于能承受一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资者投资。本基金采用宝盈量化风险管理系统和汇盈基金绩效评价系统进行风险管理。

9. 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:上证 A 股指数×90%+上证国债指数×10%

当市场出现适合于全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将按照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,适于能承受一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资者投资。

十一、基金投资组合报告(截止 2006 年 6 月 30 日)

(一) 基金资产组合情况

| 项目名称 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|------------|----------------|--------------|
| 银行存款和清算备付金 | 36,705,563.48 | 22.22 |
| 股票 | 105,578,135.56 | 63.91 |
| 债券 | - | - |
| 权证 | - | - |
| 其他资产 | 22,904,665.37 | 13.87 |
| 合计 | 165,188,364.80 | 100.00 |

(二) 行业分类的股票投资组合

| 序号 | 分类 | 市值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|---------------|--------------|
| 1 | A 农林牧渔业 | 1,808,000.00 | 1.29 |
| 2 | B 采掘业 | 14,055,005.00 | 10.02 |
| 3 | C 制造业 | 45,889,596.93 | 32.73 |

| | | |
|----------------|---------------|-------|
| 其中:C0 食品饮料 | 17,460,682.40 | 12.45 |
| C1 纺织服装业 | - | - |
| C2 木材家具 | - | - |
| C3 造纸印刷 | - | - |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 电子 | 3,001,500.00 | 2.14 |
| C6 金属、非金属 | 16,994,531.53 | 12.12 |
| C7 机械、设备、仪表 | 2,040,000.00 | 1.46 |
| C8 医药、生物制品 | 6,332,883.00 | 4.56 |
| C9 其他制造业 | - | - |

| | | | |
|----|------------------|---------------|-------|
| 4 | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| 5 | E 建筑业 | 1,610,400.00 | 1.15 |
| 6 | F 交通运输、仓储业 | - | - |
| 7 | G 信息技术业 | 16,294,834.40 | 11.62 |
| 8 | H 批发和零售贸易 | 8,934,300.00 | 6.37 |
| 9 | I 金融、保险业 | 8,575,240.00 | 6.12 |
| 10 | J 房地产业 | 2,571,000.00 | 1.83 |
| 11 | K 社会服务业 | 3,060,000.00 | 2.18 |
| 12 | L 传播和文化产业 | 441,654.62 | 0.32 |
| 13 | M 综合类 | 2,338,025.00 | 1.67 |
| 合计 | 106,578,135.56 | 76.31 | |

(三) 基金投资前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 库存数量(股) | 期末市值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000063 | 中兴 | 250,000 | 7,152,500.00 | 5.10 |
| 2 | 600036 | 中信行 | 750,000 | 5,782,500.00 | 4.12 |
| 3 | 000839 | 国货安 | 290,000 | 5,655,000.00 | 4.03 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 800,000 | 5,000,000.00 | 3.57 |
| 5 | 600887 | G 伊莉 | 210,000 | 4,785,300.00 | 3.41 |
| 6 | 000858 | G 五洲 | 320,000 | 4,652,800.00 | 3.32 |
| 7 | 600519 | G 茅台 | 90,400 | 4,288,576.00 | 3.06 |
| 8 | 000039 | G 中集 | 258,400 | 4,160,240.00 | 2.97 |
| 9 | 600535 | G 天士力 | 247,700 | 4,158,883.00 | 2.97 |
| 10 | 600683 | G 海工 | 171,700 | 3,931,930.00 | 2.80 |

(四) 按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券名称 | 市值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|-------|--------------|
| 1 | 国债 | - | - |
| 2 | 可转债 | - | - |
| | 合计 | - | - |

(五) 投资组合内基金附注

1. 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未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。

2. 本基金投资的前十名股票中未有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 其他资产附注

| 项目名称 | 金额(元) |
|-------|---------------|
| 应收利息 | 3,993.97 |
| 应收申购款 | 22,551,220.00 |
| 保证金 | 349,451.40 |
| 合计 | 22,904,665.37 |

4. 本报告报告期内权证投资明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 股数(股) | 成本(元) | 类别(被动持有/主动投资) |
|----|--------|---------|-----------|--------------|---------------|
| 1 | 580001 | 武钢 JTB1 | 500,000 | 376,303.58 | 主动投资 |
| 2 | 580003 | 邯钢 JTB1 | 480,000 | 561,493.72 | 主动投资 |
| 3 | 030001 | 鞍钢 JTC1 | 230,000 | 777,163.62 | 主动投资 |
| 4 | 030002 | 五钢 YGC1 | 245,000 | 1,968,960.83 | 主动投资 |
| 5 | 580090 | 茅台 JCP1 | 32,000 | - | 被动持有 |
| 6 | 580997 | 招行 CMP1 | 660,000 | - | 被动持有 |
| 7 | 038003 | 华夏 JTP1 | 287,682 | - | 被动持有 |
| 合计 | | | 2,434,682 | 3,683,921.75 | |

十二、基金的业绩

本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。

本基金合同生效以来截至 2006 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 2006 年 6 月 30 日)

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率基准差② | 业绩比较基准③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------|--------|-----------|---------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 32.96% | 2.06% | 22.51% | 1.35% | 10.45% | 0.71% |
| 过去六个月 | 54.91% | 1.67% | 34.25% | 1.11% | 20.66% | 0.56% |
| 过去一年 | 61.42% | 1.25% | 43.50% | 1.02% | 17.96% | 0.23% |
| 自基金成立至今 | 59.89% | 1.11% | 24.30% | 1.10% | 35.59% | 0.01% |

十三、基金的费用概貌

(一) 基金的费用种类
1. 基金管理人的管理费;

2. 基金托管人的托管费;

3. 基金的销售交易费用;

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. 按照国家有关规定以列人的其他费用。

(二) 基金费用的计提方法、计提标准和支付方式
基金管理人的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:
$$H = E \times 1.5\% \times \text{当年天数}$$
$$H$$
 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:
$$H = E \times 0.25\% \times \text{当年天数}$$
$$H$$
 为每日应计提的基金托管费E 为前一日基金资产净值
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) 与本基金费用有关的事项
基金管理人和本基金托管人因未履行或未完全履行义务导致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、对招募说明书更新的说明

本管理人依据《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,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1. 在“二、基金管理人(三)主要人员情况”部分,修订了(1)公司高级管理人员的相关内容;并对投资决策委员会成员的职务进行了更新。

2. 更新了“四、基金托管人”相应内容。

3. 在“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构海通证券、中信建投证券和浙商证券的相关内容,增加了兴业证券、国联证券和第一创业证券为代销机构。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. 在“二十一、其他应披露事项”里,增加了变更董事长公告、聘任公司总经理公告、更换公司董事公告、增加代销机构公告,以及分红公告等内容。

宝盈基金管理有限公司
二零零六年十月二十三日

长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益基金收益分配的提示性公告

(2006 年第 10 号)

长信利息收益开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)自 2006 年 09 月 21 日至 2006 年 10 月 22 日,本基金每万份基金份额累计分配收益 17.3549 元,折算的年化收益率为 1.999%。本基金管理人现将有关基金收益的具体事宜公告如下:

一、收益分配说明

本基金以每万份基金单位为收益分配基准,每日为投资者计算当日应分配的收益,经托管人中国农业银行复核后进行收益分配。
投资者当日分配的收益 = 投资者当日持有的基金份额/10000 × 当日每万份基金单位分配收益。投资者当日分配收益的精度为 0.01 元,第三位采用截位方式,因截位形成的余额计入基金资产进行再次分配。

投资者每日分红收益以红利再投资的方式转为基金份额,该基金份额享有同等收益分配权。

投资者累计收益 = Σ 以投资者前一日基金份额为基数分配的当日收益(即投资者日分配收益逐日累加)

二、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税字[2002]128 号),对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

2、本基金收益分配免收分红手续费和再投资手续费。

三、重要提示

1、投资者当日申购的基金份额不享有当日分配的收益,当日赎回的基金份额享有当日分配的收益。

2、节假日的收益并入节假日前一日工作日进行收益分配。

四、查询办法

1、长信基金管理有限责任公司网站: http://www.cxfund.com.cn;

2、长信基金管理有限责任公司客服热线:(021)33074848;

3、中国农业银行、长江证券等代销网点。

特此公告。

长信基金管理有限责任公司
2006 年 10 月 23 日

益民红利成长混合型证券投资基金增加代销机构公告

根据我公司与南京证券有限责任公司(以下简称“南京证券”)签署的《益民红利成长混合型证券投资基金销售服务协议》,南京证券自即日起代理

益民红利成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金代码为:560002)的销售及相关业务。

本基金的认购期为 2006 年 10 月 23 日至 2006 年 11 月 17 日,投资者欲了解本基金的详细信息,请仔细阅读 2006 年 10 月 19 日刊登于《上海证券报》的《益民红利成长混合型证券投资基金招募说明书》,也可登录我公司网站(www.yimfund.com)查询上述文件或拨打我公司客户服务热线

010-(63)105559 咨询有关本基金详情。

南京证券在以下 8 个城市 17 家营业网点办理对所有投资者的销售业务:南京、上海、镇江、连云港、南通、江阴、常熟、张家港。销售期间,投资者可以拨打南京证券各城市营业网点咨询电话。

南京证券有限责任公司联系方式如下:
注册地址:江苏省南京市大钟亭 8 号法人代表:张华东
联系电话:025-83367888-4101
联系人:傅春阳南京证券网址:www.njzq.com.cn
特此公告。益民基金管理有限公
2006 年 10 月 23 日