

Disclosure

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2008年半年度报告摘要

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

重要提示: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... 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...

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2008年1月1日至2008年6月30日止期间利息表

Table with columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日. Rows include 一、收入, 1.利息收入, 其中:存款利息收入, 债券利息收入, 公允价值变动收益, 其他收入, 二、费用, 1.管理人报酬, 2.托管费, 3.销售服务费, 4.其他费用.

及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。于2008年6月30日,本基金的金融资产和金融负债的重新定价日或到期日(较早者)的情况如下:

Table with columns: 资产, 2008年6月30日, 1年内到期, 1至3个月, 3个月至1年, 1年以上, 不计量, 合计. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 其他流动资产, 可供出售金融资产, 长期股权投资, 其他资产.

(一)基金名称:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 基金简称:宝盈泛沿海 基金代码: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:5,901,296,443.46份

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。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、国家产业政策及各个区域经济发展政策调整情况、市场环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。

业绩比较基准:上证A股指数×80%+上证国债指数×20% 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,属于中风险品种,追求长期资本增值和长期稳定增值的投资人投资。

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 基金销售机构:中国工商银行股份有限公司 基金注册登记机构:宝盈基金管理有限公司

主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 序号, 主要财务指标和财务指标, 2008年6月30日. Rows include 1.本期利润, 2.本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值, 6.加权平均基金份额本期利润, 7.期末基金份额净值, 8.报告期基金份额净值增长率, 9.本期基金份额净值增长率, 10.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差.

Table with columns: 序号, 主要财务指标和财务指标, 2007年12月31日. Rows include 1.本期利润, 2.本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值, 6.加权平均基金份额本期利润, 7.期末基金份额净值, 8.报告期基金份额净值增长率, 9.本期基金份额净值增长率, 10.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差.

Table with columns: 序号, 主要财务指标和财务指标, 2008年1-6月累计, 2007年1-6月累计. Rows include 1.本期利润, 2.本期利润扣除公允价值变动损益后的净额, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值, 6.加权平均基金份额本期利润, 7.期末基金份额净值, 8.报告期基金份额净值增长率, 9.本期基金份额净值增长率, 10.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差.

本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及各项基金法规,《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,严格控制投资风险,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,基金运作规范,投资比例、投资组合符合有关规定及基金合同的约定。

本基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人按照前一日的基础资产净值1.5%的年费率计提,自2007年11月起,其计算方式为:日基金资产管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金 2008年1-6月累计 2007年1-6月累计 2008年6月30日 2007年6月30日

Table with columns: 项目, 2008年1-6月累计, 2007年1-6月累计, 2008年6月30日, 2007年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 二、本期经营活动产生的基金净值变动额(本期净收益), 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动额, 四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动额, 五、期末所有者权益(基金净值).

本基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人按照前一日的基础资产净值1.5%的年费率计提,自2007年11月起,其计算方式为:日基金资产管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬38,350,773.96元(2007年同期:3,907,279.96元),本基金托管费支付基金托管人中国工商银行的托管费前一日的基础资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额(元), 占期初资产净值比例(%). Rows include 14 600005 武钢股份, 15 600061 安泰铝业, 16 000854 美利纸业, 17 600009 烟台万华, 18 600066 上海机场, 19 600009 上海机场, 20 000001 深发展A, 21 601919 中信海洋, 22 000085 双汇发展, 23 000026 金鹰药业, 24 600132 重庆啤酒, 25 601006 大秦铁路, 26 000017 广电网络.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额(元), 占期初资产净值比例(%). Rows include 2 001939 建研股份, 2 000002 万科A, 3 002146 荣泰股份, 4 600000 浦发银行, 5 601987 中国石药, 6 600764 江铃股份, 7 600050 中国联通, 8 000025 大冢动物, 9 000042 金鹰药业, 10 600006 武钢股份, 11 000025 安泰铝业, 12 600119 宝钢股份, 13 601919 中信海洋, 14 601118 中国平安, 15 600009 烟台万华, 16 600006 武钢股份, 17 000056 广联达, 18 600028 中国石化, 19 600006 武钢股份, 20 000001 深发展A.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额(元), 占期初资产净值比例(%). Rows include 1 600000 浦发银行, 2 000002 万科A, 3 002146 荣泰股份, 4 600000 浦发银行, 5 601987 中国石药, 6 600764 江铃股份, 7 600050 中国联通, 8 000025 大冢动物, 9 000042 金鹰药业, 10 600006 武钢股份, 11 000025 安泰铝业, 12 600119 宝钢股份, 13 601919 中信海洋, 14 601118 中国平安, 15 600009 烟台万华, 16 600006 武钢股份, 17 000056 广联达, 18 600028 中国石化, 19 600006 武钢股份, 20 000001 深发展A.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额(元), 占期初资产净值比例(%). Rows include 1 600000 浦发银行, 2 000002 万科A, 3 002146 荣泰股份, 4 600000 浦发银行, 5 601987 中国石药, 6 600764 江铃股份, 7 600050 中国联通, 8 000025 大冢动物, 9 000042 金鹰药业, 10 600006 武钢股份, 11 000025 安泰铝业, 12 600119 宝钢股份, 13 601919 中信海洋, 14 601118 中国平安, 15 600009 烟台万华, 16 600006 武钢股份, 17 000056 广联达, 18 600028 中国石化, 19 600006 武钢股份, 20 000001 深发展A.

其他价格风险:本基金投资于股指期货工具,其公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资相关,也可能与投资组合整体相关。对本基金而言,其他价格风险来自于交叉货币金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金通过量化投资组合,定期跟踪和评估参数,跟踪与业绩基准的差异,及时调整资产配置比例,行业配置比例等方式来降低其他价格风险。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日,本基金投资组合的资产配置列示如下: 2008年6月30日 2007年12月31日

Table with columns: 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Rows include 交易性金融资产, 货币资金, 可供出售金融资产, 其他流动资产, 其他资产.

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

Table with columns: 基准指数变化, 5.00%, -5.00%, 5.00%, -5.00%. Rows include 基准指数变化, 基准资产净值变动, 基准资产净值变动.

信用风险:本基金投资于债券类资产,其公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资相关,也可能与投资组合整体相关。对本基金而言,其他价格风险来自于交叉货币金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金通过量化投资组合,定期跟踪和评估参数,跟踪与业绩基准的差异,及时调整资产配置比例,行业配置比例等方式来降低其他价格风险。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。

本基金在2008年6月30日和2007年12月31日两个时点上,受利率风险和汇率风险以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(1)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(2)、本基金业绩比较基准收益率以外的其他风险影响的基金资产净值变动的数据。上述分析假定(3)、对于没有新发行或股票的价格波动没有超过3个月股票,波动幅度选取基准指数的波动幅度。