

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

重要提示
基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人的过往业绩并不代表其未来业绩。
投资有风险,投资人购买基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件,基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读本基金的基金合同。
基金管理人保证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。
本基金合同自2005年3月8日正式生效。
本招募说明书(更新)所载内容截止日为2008年9月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年6月30日。基金托管人中国工商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
1.基金管理基本情况
名称:宝盈基金管理有限公司
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦1501
办公时间:2001年5月18日
法定代表人:李建生
总经理:陆金海
办公地址:深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
注册资本:10000万元人民币
电话:0755-83276688
传真:0755-83515699
联系人:张晖

2.基金管理人股权结构及组织架构
本基金管理人经国务院批准,由宝盈基金字[2001]9号文批准发起设立。现有股东包括南方信托有限责任公司、成都工投控股集团有限公司、中国对外经济贸易信托有限公司,其中南方信托有限责任公司持有本公司49%的股权,成都工投控股集团有限公司持有28%的股权,中国对外经济贸易信托有限公司持有25%的股权。
公司下设五个部室,分别是投资部、海外投资部、金融工程部、集中交易室、特定客户资产管理部、市场部、华东营销中心、华东营销中心、华南营销中心、基金运营部、监察稽核部、公司财务部、总经理办公室、战略发展部和北京办事处;此外,还设立了投资决策委员会和风险控制中心。
公司秉承“规范管理求效益、诚信创新谋发展、回报服务创品牌”为经营理念,坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神,立足专业,追求卓越,致力于开拓基金及证券市场业务,为基金份额持有人和资产委托人谋求最大利益。

(二)主要人员情况

1.公司高级管理人员

(1)董事长:
曹建生,女士,董事长,1954年出生,中共党员,本科。曾在黑龙江建设银行总行、铁道部基建总局工作,1989年初调入中铁技工工程总公司任副经理、高级会计师、副总会计师,现任南方信托有限责任公司董事长、中国中铁股份有限公司副总裁、财务总监兼风险控制顾问。
(2)副董事长:董惠,硕士研究生,高级会计师,1985年7月至1989年10月在中铁二局机其公司广州、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月在中铁二局机其公司财务科任职,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务总监,中铁二局集团专家委员会财务组组长;2003年11月至2006年10月在中铁八局集团公司任财务总监,中铁法律顾问,集团公司专家委员会成员;现任南方信托有限责任公司总经理。
(3)财务总监:董惠,中共党员,硕士研究生。1988年7月至1998年6月任西南财经大学公共管理与行政管理学院教研室主任;1998年5月至1999年3月在四川置信信托投资公司人事部主任;1999年3月至2000年10月在四川省信托投资公司峨边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月开始任南方信托投资有限责任公司总裁助理兼发展部总经理,现任南方信托有限责任公司副总经理。

(4)副总经理:董惠,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。现任成都工投控股集团有限公司副总经理。

(5)高级管理人员:董惠,1971年10月生,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管理材料经理;1999年10月起在中国化工进出口总公司财务管理综合部经理;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。
(6)督察长:董惠,1938年生,中共党员,西南财经大学教授。1961年至1966年,在四川省泸县税务局工作;1966年至1980年,在西南财经大学学习;1980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。

(7)副总经理:董惠,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、副教授、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。

(8)副总经理:董惠,1947年1月,清华大学汽车工程专业博士。1985年至1990年在清华大学经济管理学院任党委书记、副院长、院长助理;1990年至1992年,在加拿大西安大略大学商学院任教;1992年至今,在清华大学经济管理学院任职,历任院长助理、副院长、财务与金融研究中心主任、副院长、会计系主任、教授、博士生导师,其中2000年8月至2007年1月曾任清华大学会计学研究所所长;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。

(9)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学系开展博士后研究工作。2001年10月起就职于南方基金管理有限公司,历任金融工程部总监、信息技术部总监、投资部副总监兼风险控制部副总监。2006年4月起任宝盈基金管理有限公司董事兼总经理。

(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任负责销售业务。1997年6月至2001年9月在成都托普有限公司工作,任办公室主任、资产经营管理部经理、副总经理。2001年9月至今在成都工投投资管理有限公司担任财务总监。
王淑洲先生,独立董事。1939年生,副研究员,1964年至1983年,在中国人民银行任职工作,曾担任计划统计处副处长;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,先后担任办公室财务组组长、组长、办公室副主任、研究室巡视员。2000年11月退休。
杨光亮先生,独立董事。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,先后担任市场部副经理、市场部副总监。2008年4月16日,经股东大会通过《关于宝盈基金管理有限公司监事会组成情况的报告》后,杨光亮当选为监事会监事。

(3)其他高级管理人员

王志先生,副总经理。1963年11月出生,中共党员,硕士。1988年至1990年,中国化工集团总公司储运部;1990年至1991年,新加坡海皇船务公司租船部高级行政人员;1991年至1994年,中国中化集团有限公司投资管理部门经理;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2006年,香港中汇汇资产管理公司副总经理;2006年至2008年,中国对外经济贸易信托投资公司证券部副经理。2006年10月加入宝盈基金管理有限公司,现任公司副总经理。

刘秀亮先生,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,中国人民银行佛山市支行干管、团委书记;1994年5月—1997年10月,深圳证券期货交易所稽核部、研究部副处;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所长;2002年10月—2004年5月,长信基金研究总监、市场发展部副总监;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、首席稽核兼监察稽核部副总监;2007年5月起担任宝盈基金管理有限公司督察长。

二、基金投资范围

魏刚先生,男,1977年生,金融学硕士。历任深圳新德利财经资讯公司软件开发工程师、南方基金管理有限公司投资研究部高级研究员、养老金业务部高级经理。2007年4月加入宝盈基金管理有限公司从事研究工作,宝盈基金管理有限公司于2007年5月9日刊登公告聘任魏刚担任宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间:
祝光平,2005年3月8日至2007年5月9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。
王志先生:宝盈基金管理有限公司副总经理。
刘丰先生:宝盈基金管理有限公司投资总监。
余述强先生:宝盈基金管理有限公司投资部副总监。
杨光亮先生:宝盈基金管理有限公司金融工程部副总监。

三、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
基金托管人名称: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56号

法定代表人:姜建清
办公时间:1984年1月1日
信息披露义务机关及批准设立文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)

组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币334,018,850,026元
存续期间:持续经营
经营范围:

办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外汇结算;办理票据承兑、贴现、转贴现;各类汇兑业务;代理资金清算;提供信用证服务及担保;代理销售业务;代理发行、代理承销、代理兑付政府债券;代收代付业务;代理证券投资基金清算业务(银证转账);保险兼业代理业务(有效期至2008年9月4日);代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务;保管箱服务;发行金融债券;发行证券投资基金、金融债券;证券投资基金托管业务;企业年金受托管理服务;年金账户管理服务;开放式基金的注册登记、认购、申购赎回服务和清算业务;咨询、见证业务;黄金存放;黄金、个人理财业务服务;组织承销团成员投标;外汇存单;外汇贷款;外汇担保;发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券;自营、代客外汇买卖;外汇贵金属业务;银行卡业务;提供网上银行、网上银行业务;办理银行卡、代收水、电、燃气费;经营国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

(二)主要人员情况

截至2008年6月末,中国工商银行托管资产托管部共有员工101人,平均年龄30岁,90%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则,严格履行受托管理人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2008年6月,托管证券投资基金95只,其中封闭式10只,开放式85只。托管资产规模年均增幅超过100%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、契约类资产、OFII资产、QDII资产等资产在内的托管业务体系。2008年初,中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财富》、《证券时报》和《上海证券报》等国内权威媒体评选为2007年度“中国最佳托管银行”,自2004年以来,工商银行托管服务获得的该类奖项合计已经达到12项。

四、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:方梅珊

2.代销机构

(2)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:董建群
客户服务电话:96588
联系人:中国工商银行客户服务中心
(2)中国建设银行
注册地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:郭树清

客户服务热线:96533
联系人:中国建设银行客户服务中心

(3)招商银行

注册地址:深圳市福田区委南路27088号
法定代表人:秦晓
客户服务热线:96555
联系人:招商银行客户服务中心
(4)深圳平安银行
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:黄立贤
客户服务热线:40066-99999
网址:htp://www.18bank.com/
(5)中国民生银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文亮
客户服务热线:96568
公司网址:htp://www.cmbc.com.cn/
(6)中信银行
注册地址:北京市东城区朝阳门内大街8号新华大厦C座
法定代表人:孔丹
客户服务热线:96568
公司网址:htp://bank.ecitic.com/
(7)北京银行
注册地址: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
客户服务热线:010-66442000
021-63899888(上海)
公司网址:htp://www.bankofbj.com.cn

(8)交通银行
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
客服电话:96569

(9)华泰证券有限责任公司
注册地址:南京市江东中路228号
法定代表人:吴万善
电话:021-62569118-213
传真:021-62569400
联系人:芮爽
(10)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:0755-82943111
传真:0755-82943237
联系人:黄健

(11)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:王洪涛
电话:021-52303030
021-52303496-4125
传真:021-52308549
联系人:金芸、杨薇
(12)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际金融中心C座
法定代表人:朱利
电话:010-66568887
传真:010-66568836
联系人:郭京华

(13)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝内大街2号
办公地址:北京市朝内大街188号
法定代表人:黎晓峰
电话:010-65171758
传真:010-65182161
联系人:宋晨
(14)联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道5047号中国深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马国强
电话:0755-82493641
传真:0755-82492187
联系人:梁宗波

(15)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:魏庆华
电话:0755-83516094
传真:0755-83616199
联系人:魏斌
(16)华泰证券有限责任公司
注册地址:南京市江东中路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-8447777-721
传真:025-84579879
联系人:薛峰
(17)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州市十梓街298号
电话:0756-83276688
传真:0756-83515699
联系人:陈静波
(18)律师事务所有限公司
注册地址:南京市玄武区珠江路29号
电话:025-85230778
传真:010-85181218
联系人:郭新华
经办注册会计师:曹光富 郭新华

四、基金的投资

(一)基金的投资目标
本基金名称:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金。
本基金类别:契约型开放式股票基金。

(二)基金的投资目标
本基金通过投资于泛沿海地区具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增值。

(三)基金的投资范围和对象
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地区注册上市公司发行的证券。同时,本基金将根据区域经济发展情况、证券市场的阶段性变化,以不超过非现金资产20%的部分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资产配置,“自下而上”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,本基金将根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各地区经济发展状况调整策略,市场整体环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。

2.区域板块及行业配置策略
在区域板块及行业配置层面,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行业间的权重。

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)区域选股
从沪、深两市所有A股中选择注册地在泛沿海地区的上市公司,剔除ST、*ST股票及正在接受监管部门调查的问题股票,构成本基金的投资范围内的基础股票库;

(2)数量选股
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备选股票库;按股票库股票每年在4月30日上市首日年度报出后为整体调整一次,日常则可依据股票价格变动情况进行调整。

预期PEG值的计算公式如下:
$$PEG = \frac{P}{EPS} \times \frac{EPS}{E} \times 100\%$$

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,E为根据上市公司历史财务数据,3年移动平均,财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务净利润增长率。
对于每年在4月30日之前年度4月上旬的新股,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情况决定投资。

(3)基本面选股
由基金管理人根据《中华人民共和国证券基金法》、《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思路,对本基金的拟招募说明书进行了更新,主要更新后的内容如下:

1.在“三、基金管理人(二)证券投资基金管理情况”部分,进行了修订;对(二)主要人员情况中公司高级管理人员部分进行了更新。

2.2.更新了“四、基金管理人”相应内容。

3.在“五、相关服务机构”部分,增加了深圳平安银行、中国民生银行、中信银行、北京银行、交通银行、万联证券有限责任公司、华信证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司等为代销机构。

4.在“九、基金份额的发售、申购和赎回”部分,更新了“十一)基金的投资”部分,更新了“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、基金的投资”部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

6.在“十一、其他应披露事项”部分,增加了定投业务优惠公告、网上交易业务优惠公告、增加代购机构公告、子基金定投业务公告、新增代理基金转换业务公告、新增一非交易对账单公告、网站及网上交易系统暂停服务通知公告、寻找地震灾区持有人公告、开通网上直销转换业务公告等内容。

(6)国家有关法律、法规和基金契约的有关规定;

十二、基金的费用

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,投资决策程序如下:
(1)在基金合同规定的投资方向、投资理念和投资限制的前提下,基金经理根据公司投资策略和外部专业研究机构对宏观经济、政策取向、市场趋势和特点进行的深入研究,在此基础上制定资产配置策略和投资策略建议,经过投资决策委员会讨论通过后作为进行整体资产配置的依据;
(2)公司投资管理部研究员和基金金融工程数据量分析研究员对上市公司进行初步分析、调研的基础上,构建基金投资组合,推荐基金治理、基金治理和基金契约规定、整体资产配置方案,适当参考外部专业研究机构的投资建议报告,在公司统一的备选股票池中选择合适的投资品种;

(3)基金经理结合自己对市场的分析和判断制定投资组合草案,提交投资决策委员会审议。投资组合草案包括计划投资股票清单和数量范围;
(4)投资决策委员会对基金经理的投资组合草案进行讨论和表决,通过后形成投资决策组合方案;如草案不获通过,基金经理负责对投资组合进行修改后,提交投资决策委员会继续讨论;

(5)金融工程根据投资组合方案制定具体的操作计划,构建投资组合;
(6)金融工程对投资组合进行风险评估,并将评估结果和调整建议向投资决策委员会反馈;
(7)风险评估委员会和基金经理根据市场变化和风险评估结果对基金投资组合进行调整。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:
上证A股指数×80%+上证国债指数×20%
当市场出现合适的全市指数一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市统一指数。

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券
本基金本报告期末未持有可转换债券。
(五)报告期末前十名股票中流通受限情况的说明

(六)投资组合报告附注
1.本报告期末基金持有的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查;在本报告编制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.其他投资明细

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,815,410.27
2	应收申购款	---
3	应收利息	1,704,621.43
4	应收股利	125,104.60
5	其他应收款	4,534,188.64
6	其他流动资产	---
7	待摊费用	---
8	合计	10,179,324.76

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.报告期末前十名股票中流通受限情况的说明

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	3,383,973,071.91	86.64
2	固定收益类投资	3,383,973,071.91	86.64
3	金融资产投资	---	---
4	买入返售金融资产	---	---
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	---	---
6	银行存款和结算备付金合计	508,374,565.06	13.00
7	其他资产	10,179,324.76	0.27
7	合计	3,882,528,962.62	100.00

代码	行业分类	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	---	---
B	采掘业	60,749,330.10	1.31
C	制造业	1,509,316,094.79	49.86
CO	食品饮料	601,467,660.68	15.54
C1	纺织、服装、皮毛	11,137,400.00	0.29
C2	木材、家具	---	---
C3	造纸、印刷	16,525,302.00	0.43
C4	化学、石化、塑胶、塑料	462,465,710.01	10.49
C5	电子	150,367,372.78	3.82
C6	金属、非金属	210,498,006.29	5.44
C7	机械、设备、仪表	235,780,119.72	6.09
C8	医药、生物制品	263,323,151.79	6.80
C90	其他制造业	37,740,566.02	0.98
D	电力、煤气及水的生产和供应业	269,887,850.25	6.72
R	建筑业	---	---
F	交通运输、仓储业	175,051,674.40	4.52
G	信息技术业	146,741,500.36	3.84
H	批发和零售贸易	225,243.08	0.01
J	金融、保险业	467,327,863.11	11.60
K	房地产业	41,924,082.78	1.08
L	传播服务业	---	---
N	通信与互联网	190,649,312.14	4.93
M	综合类	---	---
合计		3,383,973,071.91	86.59

代码	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	600000	长江电力	17,739,788	259,887,850.25	6.72
2	600619	贵州茅台	1,851,745	256,614,822.10	6.63
3	000017	世纪传媒	11,783,023	190,649,312.14	4.93
4	600036	招商银行	7,300,000	170,966,000.00	4.42
5	002007	华信生物	3,531,323	146,060,326.28	3.77
6	600029	海信电器	5,989,769	143,513,038.29	3.71
7	000086	兴发集团	3,091,988	135,326,676.49	3.58
8	600143	金发科技	6,775,743	115,323,148.86	2.98
9	000668	五粮液	6,234,977	113,051,280.94	2.94
10	000025	苏宁环球	9,994,383	108,239,167.89	2.80

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券
本基金本报告期末未持有可转换债券。
(五)报告期末前十名股票中流通受限情况的说明

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例%
1	存出保证金	3,815,410.27	---
2	应收申购款	---	---
3	应收利息	1,704,621.43	---
4	应收股利	125,104.60	---
5	其他应收款	4,534,188.64	---
6	其他流动资产	---	---
7	待摊费用	---	---
8	合计	10,179,324.76	---

代码	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	600000	长江电力	17,739,788	259,887,850.25	6.72
2	600619	贵州茅台	1,851,745	256,614,822.10	6.63
3	000017	世纪传媒	11,783,023	190,649,312.14	4.93
4	600036	招商银行	7,300,000	170,966,000.00	4.42
5	002007	华信生物	3,531,323	146,060,326.28	3.77
6	600029	海信电器	5,989,769	143,513,038.29	3.71
7	000086	兴发集团	3,091,988	135,326,676.49	2.98
8	600143	金发科技	6,775,743	115,323,148.86	2.98
9	000668	五粮液	6,234,977	113,051,280.94	2.94
10	000025	苏宁环球	9,994,383	108,239,167.89	2.80

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券
本基金本报告期末未持有可转换债券。
(五)报告期末前十名股票中流通受限情况的说明

代码	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	600000	长江电力	17,739,788	259,887,850.25	6.72