
宝盈策略增长股票型证券投资基金

2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|--------------------------------------|----|
| § 1 | 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 | 重要提示 | 1 |
| § 2 | 基金简介 | 4 |
| 2.1 | 基金基本情况 | 4 |
| 2.2 | 基金产品说明 | 4 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 | 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 | 其他相关资料 | 5 |
| § 3 | 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况..... | 6 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 6 |
| 3.3 | 过去三年基金的利润分配情况..... | 8 |
| § 4 | 管理人报告 | 8 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 9 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 9 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 10 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 4.6 | 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 11 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| § 5 | 托管人报告 | 12 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明... | 13 |
| 5.3 | 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| § 6 | 审计报告 | 13 |
| 6.1 | 管理层对财务报表的责任..... | 13 |
| 6.2 | 注册会计师的责任 | 14 |
| 6.3 | 审计意见 | 14 |
| § 7 | 年度财务报表 | 14 |
| 7.1 | 资产负债表 | 14 |
| 7.2 | 利润表 | 16 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |
| 7.4 | 报表附注 | 18 |
| § 8 | 投资组合报告 | 34 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况 | 34 |
| 8.2 | 期末按行业分类的股票投资组合..... | 34 |
| 8.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 35 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 36 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 39 |
| 8.6 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细..... | 39 |
| 8.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细... | 40 |
| 8.8 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细..... | 40 |

| | | |
|------|----------------------------------|----|
| 8.9 | 投资组合报告附注 | 40 |
| § 9 | 基金份额持有人信息 | 41 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 41 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况..... | 41 |
| § 10 | 开放式基金份额变动 | 41 |
| § 11 | 重大事件揭示 | 41 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 41 |
| 11.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 41 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 42 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 42 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 43 |
| 11.8 | 其他重大事件 | 44 |
| § 12 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 45 |
| § 13 | 备查文件目录 | 46 |
| 13.1 | 备查文件目录 | 46 |
| 13.2 | 存放地点 | 46 |
| 13.3 | 查阅方式 | 46 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 宝盈策略增长股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 宝盈策略增长股票 |
| 基金主代码 | 213003 |
| 交易代码 | 213003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007 年 1 月 19 日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,436,767,878.18 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 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，本基金力求通过综合运用多种投资策略优选股票，分享中国经济和资本市场高速增长成果，在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续稳健增值，并力争获取超过比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>1. 资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2. 股票投资策略</p> <p>本基金股票投资策略主要通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的股票构建投资组合。主题投资策略、价值成长策略和价值反转策略互相配合以构成本基金的整体投资策略。三种投资策略的投资权重大致平均分配，在考虑行业大致均衡配置的前提下，重叠的个股加大权重。本基金管理人将根据国际经济、国内经济、经济政策、股市结构、股市政策等方面因素的综合考虑，根据研究部提供并经投资决策委员会批准的投资策略对各投资策略的投资权重进行微调。</p> <p>(1) 主题投资策略：通过分析实体经济中结构性、周期性及制度性变动趋势，挖掘出对经济变迁具有大范围影响的潜在因素，对受益于该潜在因素的行业和公司进行投资。投资主题主要有以下方面：世界经济及国内经济变动趋势、制度变革、产业整合、城市化、消费升级、人民币升值、新农村建设等。</p> <p>(2) 价值成长策略：我国目前证券市场以基金为代表的机构投资者最主要的投资策略。主要投资的对象是成长型股票，但其相对价值被低估，通过长期持有以分享其高成长性所带来的收益。本基金通过定性和定量分析寻找合适的投资对象。定量的方法主要是在公司的股票池中选出适用于价值投资的股票，主要判断标准是长期能给股东带来资本回报的公司，选取历史 ROE(每年不低于 6%)作为选择基础指标，同时结合应用 (P/E) /G 作为定量标准兼顾目前投资价值与未来成长潜力作为价值成长</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>策略的组合。定性的方法主要是通过宏观环境，行业前景，公司治理结构等因素的分析选择适合的上市公司股票。</p> <p>(3) 价值反转策略：主要投资的对象为相对价值被低估的价值型股票，待其价值回归后沽出获利；根据主营业务利润率的变化并结合行业和公司情况选出反转投资的股票，构建投资组合。</p> <p>3. 债券投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>上证 A 股指数×75%+上证国债指数×20%+同期银行一年定期存款利率×5%</p> <p>当作为本基金业绩比较基准的指数因中断编制等原因或市场出现更合适的新指数时，本基金业绩比较基准将做适时调整。</p> |
| 风险收益特征 | 较高期望收益和风险水平 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|-----------------------|---------------------------|
| 名称 | | 宝盈基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 孙胜华 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 | 010-68424199 |
| | 电子邮箱 | sunsh@byfunds.com | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-8888-300 | 95599 |
| 传真 | | 0755-83515599 | 010-68424181 |
| 注册地址 | | 深圳市深南路6008号特区报业大厦1501 | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 办公地址 | | 深圳市深南路6008号特区报业大厦1501 | 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码 | | 518034 | 100036 |
| 法定代表人 | | 李建生 | 项俊波 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|-----------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 上海湖滨路202号普华永道中心11楼 |
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司 | 深圳市深南路6008号特区报业大厦1501 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2010 年 | 2009 年 | 2008 年 |
|---------------|------------------|------------------|-------------------|
| 本期已实现收益 | -364,806,862.14 | 1,308,583,851.87 | -1,653,449,985.13 |
| 本期利润 | -434,589,009.69 | 1,779,642,296.71 | -3,414,530,021.69 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1591 | 0.5342 | -0.8661 |
| 本期加权平均净值利润率 | -16.46% | 50.39% | -75.64% |
| 本期基金份额净值增长率 | -12.96% | 66.06% | -51.01% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2010 年末 | 2009 年末 | 2008 年末 |
| 期末可供分配利润 | -35,048,461.28 | 400,541,575.42 | -698,818,803.62 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0144 | 0.1323 | -0.1957 |
| 期末基金资产净值 | 2,401,719,416.90 | 3,428,850,179.81 | 2,872,443,017.34 |
| 期末基金份额净值 | 0.9856 | 1.1323 | 0.8043 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2010 年末 | 2009 年末 | 2008 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 29.97% | 49.32% | -10.08% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

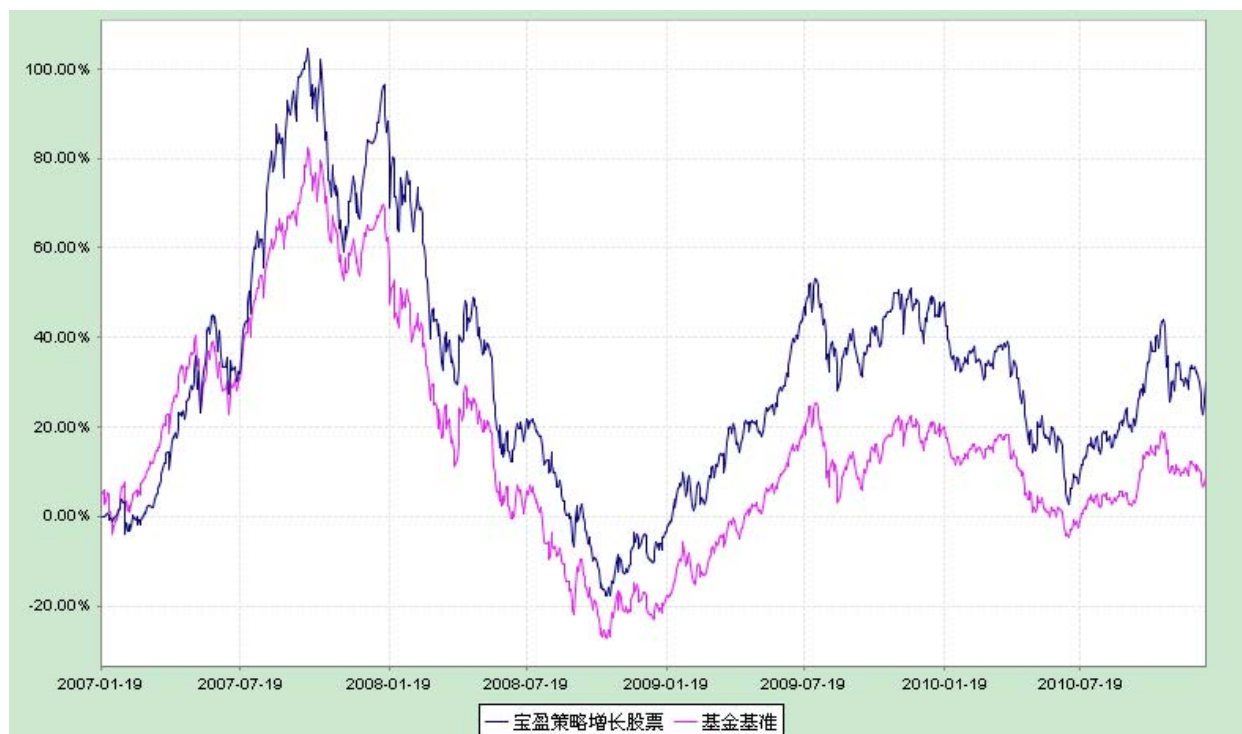
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 6.25% | 1.82% | 4.35% | 1.17% | 1.90% | 0.65% |
| 过去六个月 | 20.70% | 1.55% | 12.88% | 1.03% | 7.82% | 0.52% |
| 过去一年 | -12.96% | 1.52% | -9.97% | 1.06% | -2.99% | 0.46% |
| 过去三年 | -29.19% | 1.73% | -33.62% | 1.62% | 4.43% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.97% | 1.77% | 8.88% | 1.62% | 21.09% | 0.15% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

宝盈策略增长股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007 年 1 月 19 日至 2010 年 12 月 31 日)

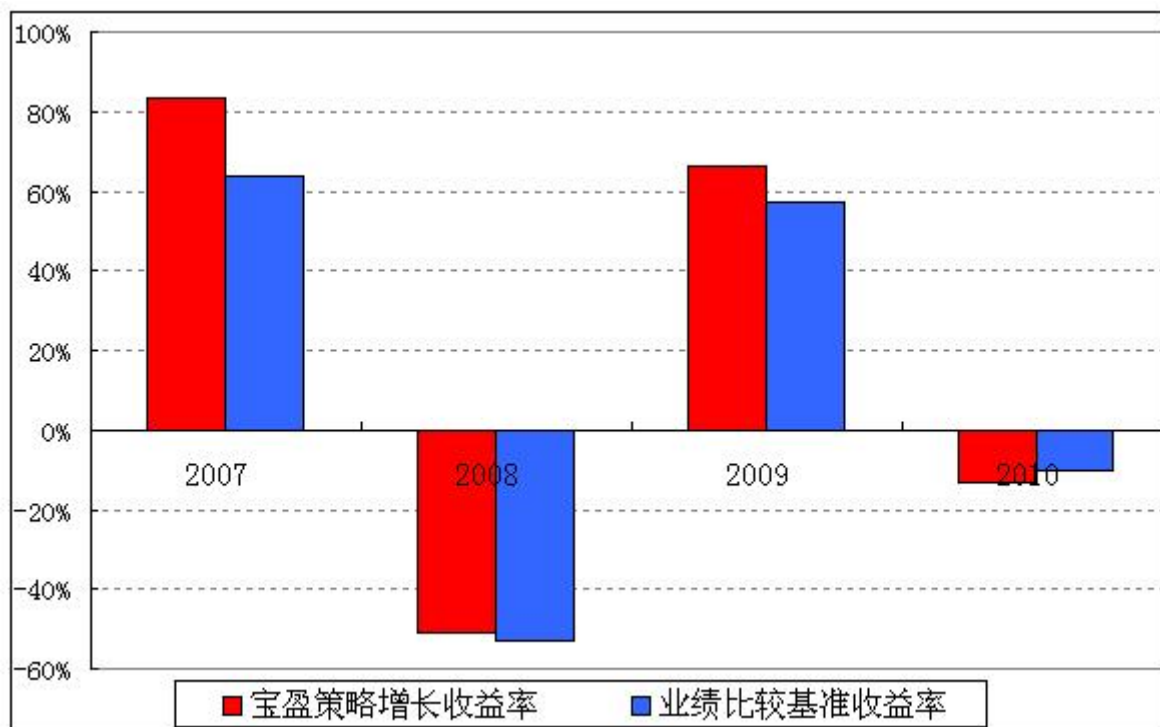


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈策略增长股票型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金合同生效日为 2007 年 1 月 19 日，本基金自合同生效日至本报告期末不足五年，本柱状图中显示的 2007 年宝盈策略增长收益率和业绩比较基准收益率是从 2007 年 1 月 19 日到 2007 年 12 月 31 日之间的收益率。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|------|-------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 2010 | - | - | - | - | - |
| 2009 | 2.000 | 329,041,136.23 | 323,701,878.68 | 652,743,014.91 | - |
| 2008 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 2.000 | 329,041,136.23 | 323,701,878.68 | 652,743,014.91 | - |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长、宝盈增强收益、宝盈资源优选、

宝盈核心优势、宝盈货币、宝盈中证 100 九只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理) 期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 余述胜 | 本基金基金经理 | 2009-07-01 | - | 13 年 | 余述胜先生，1967 年出生，金融学博士。1998 年 3 月至 2007 年 10 月就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、投资部副总监、交通运输行业首席分析师。2007 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司，历任投资部副总监、研究部总监。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
| 盛军锋 | 本基金基金经理 | 2009-07-01 | - | 5 年 | 盛军锋先生，1976 年出生，经济学博士。2004 年 1 月至 2006 年 6 月就任于中国人民银行深圳市中心支行货币信贷管理处。2006 年 6 月加入宝盈基金管理有限公司，从事宏观策略研究工作。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。经检查，在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为开放式基金。本基金的投资风格与管理人旗下其它投资组合的投资风格存在较大差异。由于投资风格的差异，本基金投资组合的业绩与管理人旗下其它组合的投资业绩不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金与管理人旗下的其他基金和组合不存在有利益输送嫌疑的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2010 年初，我们认为随着延续 2009 年下半年以来的信贷政策边际调整，政策基调已经发生较大变化，市场预期有所转变，进入震荡整理格局。我们认为宏观经济仍将继续复苏，但政策趋势的转变将有可能导致市场乐观情绪受到影响，政策和经济面博弈、市场估值等待业绩回升这一态势将在中期内左右市场趋势和市场结构。据此，我们判断中小盘高估值板块和低估价值的大盘股之间可能存在着转换的可能，特别是预期股指期货的推出有利于大盘股的市场表现，因此，在上半年增加了大盘股的配置比重，并平衡、灵活配置周期性行业和消费类行业，精选个股，动态调整仓位。总体看，上半年的阶段性高仓位和蓝筹股的滞涨造成阶段性业绩表现不理想，特别是第一季度业绩表现较差。

2010 年下半年，我们认为随着货币政策和财政政策的逐步收缩，流动性收紧、市场预期极度悲观导致的大幅调整，在一定程度上反映了对经济的悲观预期，同时，上市公司业绩增速的逐步下滑可能导致盈利预测的下调仍制约周期性板块的市场表现，市场结构转换较难发生，前期涨幅较大的业绩持续性好、景气延续的消费类板块仍有望继续引领市场。结合宏观基本面和政策态势，我们着重降低了部分受损于政策调控和经济回落的行业配置，比如地产、钢铁等，加强组合的进攻性，加大了消费类个股、军工板块、景气预期反转的化工行业的配置；重点挖掘并增加了并购重组类组合的比重。在此策略下下半年特别是第四季度基金业绩有明显提升，但是由于上半年业绩较差的原因，全年仍没有改变业绩较差的情况。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是-12.96%，同期业绩比较基准收益率是-9.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年，我们认为宏观经济仍将保持复苏态势，通胀高位维持，基于控制通胀的紧缩政策在相当时间内持续，在通胀未出现明显回落之前，政策面仍趋于收缩，这仍将压制市场向上趋势。通胀导致的成本上涨将明显压制工业制造盈利的超预期，市场整体估值水平也难有大的下降。从股票供给

来看，新股上市及存量解禁不容小视。但从整体市场估值来看，很多行业和公司估值处于底部，市场也不会有大幅下跌的可能。从海外看，欧美经济已经度过最低点，呈现显著复苏态势，这对市场形成正面支持。预计 2011 全年市场仍将是一个震荡的市场，市场波动的幅度和节奏取决于政策松紧和调控频率。市场目前估值处于底部附近，如果市场大幅下跌，市场情绪阶段性悲观化，则提供买入良机。我们将根据政策的变化，灵活调整仓位，合理配置周期与消费行业，并着重挖掘景气向好行业中的优质个股，力争为投资者实现好的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组，估值工作小组由本基金管理人的总经理任小组长，由投资部、研究部、金融工程部、基金事务部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；金融工程部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金事务部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定：

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按权益登记日除息后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资者不选择，本基金默认投资者选择获取现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

5、当期基金收益分配的比例不低于当期基金已实现收益的 60%；

6、在符合有关基金收益分配条件的前提下，基金收益分配每年至少分配 1 次，每年不超过 12 次，法规或监管机构另有规定的从其规定。

本报告期末可供分配利润-35,048,461.28 元，基金份额净值 0.9856 元，不符合利润分配条件，因此本报告期末无法实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管宝盈策略增长股票型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》、《宝盈策略增长股票型证券投资基金托管协议》的约定，对宝盈策略增长股票型证券投资基金管理人—宝盈基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司在宝盈策略增长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，宝盈基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的宝盈策略增长股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20252 号

宝盈策略增长股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的宝盈策略增长股票型证券投资基金(以下简称“宝盈策略增长基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是宝盈策略增长基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会允发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了宝盈策略增长基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册会计师 单 峰

张振波

上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2011-03-24

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈策略增长股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2010年12月31日 | 上年度末 2009年12月31日 |
|-----|-----|--------------------|---------------------|
|-----|-----|--------------------|---------------------|

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 229,563,259.47 | 355,710,156.81 |
| 结算备付金 | | 12,424,944.78 | 8,867,165.50 |
| 存出保证金 | | 1,773,819.25 | 2,628,164.84 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 2,076,850,289.30 | 2,890,279,650.70 |
| 其中：股票投资 | | 2,076,850,289.30 | 2,890,279,650.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 92,795,152.08 | 197,521,894.41 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 60,854.65 | 76,196.82 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 120,211.34 | 725,502.36 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,413,588,530.87 | 3,455,808,731.44 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2010年12月31日 | 上年度末 2009年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 595,656.64 | 14,214,827.46 |
| 应付管理人报酬 | | 3,081,436.35 | 4,320,864.51 |
| 应付托管费 | | 513,572.75 | 720,144.09 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 6,078,315.02 | 6,056,771.10 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 1,600,133.21 | 1,645,944.47 |
| 负债合计 | | 11,869,113.97 | 26,958,551.63 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,436,767,878.18 | 3,028,308,604.39 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -35,048,461.28 | 400,541,575.42 |
| 所有者权益合计 | | 2,401,719,416.90 | 3,428,850,179.81 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,413,588,530.87 | 3,455,808,731.44 |

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9856 元，基金份额总额 2,436,767,878.18

份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈策略增长股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2010年1月1日至 2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日 |
|------------------------|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入 | | -353,937,676.29 | 1,892,077,214.87 |
| 1. 利息收入 | | 2,482,369.93 | 5,629,961.08 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 2,482,369.93 | 5,629,961.08 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -286,838,522.57 | 1,414,555,650.10 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -299,414,448.96 | 1,379,363,681.31 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 12,575,926.39 | 35,191,968.79 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -69,782,147.55 | 471,058,444.84 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 200,623.90 | 833,158.85 |
| 减：二、费用 | | 80,651,333.40 | 112,434,918.16 |
| 1. 管理人报酬 | | 39,669,572.11 | 52,712,873.73 |
| 2. 托管费 | | 6,611,595.36 | 8,785,479.01 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 33,930,898.78 | 50,490,862.60 |
| 5. 利息支出 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|------------------------|-------------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 439,267.15 | 445,702.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -434,589,009.69 | 1,779,642,296.71 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -434,589,009.69 | 1,779,642,296.71 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈策略增长股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | | |
|--|----------------------------------|------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 3,028,308,604.39 | 400,541,575.42 | 3,428,850,179.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -434,589,009.69 | -434,589,009.69 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -591,540,726.21 | -1,001,027.01 | -592,541,753.22 |
| 其中：1. 基金申购款 | 43,022,106.49 | -870,819.36 | 42,151,287.13 |
| 2. 基金赎回款 | -634,562,832.70 | -130,207.65 | -634,693,040.35 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,436,767,878.18 | -35,048,461.28 | 2,401,719,416.90 |
| 项目 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 3,571,261,820.96 | -698,818,803.62 | 2,872,443,017.34 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,779,642,296.71 | 1,779,642,296.71 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -542,953,216.57 | -27,538,902.76 | -570,492,119.33 |
| 其中：1. 基金申购款 | 802,311,842.65 | 129,369,736.81 | 931,681,579.46 |
| 2. 基金赎回款 | -1,345,265,059.22 | -156,908,639.57 | -1,502,173,698.79 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -652,743,014.91 | -652,743,014.91 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,028,308,604.39 | 400,541,575.42 | 3,428,850,179.81 |

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：汪钦，主管会计工作负责人：汪钦，会计机构负责人：何瑜

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

宝盈策略增长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字 2006]第 195 号《关于同意宝盈策略增长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 9,566,621,346.92 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,568,309,032.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,687,685.50 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的主要投资范围是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票,以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金股票投资对象是通过综合运用多种投资策略优选出的投资价值较高的上市公司股票。其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%。本基金的业绩比较基准为:上证 A 股指数 X75%+上证国债指数 X20%+同期银行一年定期存款利率 X5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交

易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金对于特殊事项停牌股票根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2010 年 12 月 31 日 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 229,563,259.47 | 355,710,156.81 |
| 定期存款 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 229,563,259.47 | 355,710,156.81 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2010 年 12 月 31 日 | | |
|-------|-------------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,968,157,721.34 | 2,076,850,289.30 | 108,692,567.96 |
| 债券 | - | - | - |
| 交易所市场 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|---------------------|------------------|----------------|
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,968,157,721.34 | 2,076,850,289.30 | 108,692,567.96 |
| 项目 | | 上年度末 2009年12月31日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 2,711,804,935.19 | 2,890,279,650.70 | 178,474,715.51 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,711,804,935.19 | 2,890,279,650.70 | 178,474,715.51 |

注：于 2010 年 12 月 31 日，股票投资余额中无按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票（2009 年 12 月 31 日：同）。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2010年12月31日 | 上年度末 2009年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 56,071.08 | 67,121.97 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 4,783.57 | 3,413.85 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | 5,661.00 |
| 其他 | - | - |

| | | |
|----|-----------|-----------|
| 合计 | 60,854.65 | 76,196.82 |
|----|-----------|-----------|

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2010年12月31日 | 上年度末 2009年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 6,078,315.02 | 6,056,771.10 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 6,078,315.02 | 6,056,771.10 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2010年12月31日 | 上年度末 2009年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 1,500,000.00 | 1,500,000.00 |
| 应付赎回费 | 132.99 | 35,904.21 |
| 预提费用 | 100,000.00 | 110,000.00 |
| 应付转出费 | 0.22 | 40.26 |
| 合计 | 1,600,133.21 | 1,645,944.47 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,028,308,604.39 | 3,028,308,604.39 |
| 本期申购 | 43,022,106.49 | 43,022,106.49 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -634,562,832.70 | -634,562,832.70 |
| 本期末 | 2,436,767,878.18 | 2,436,767,878.18 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 636,473,423.02 | -235,931,847.60 | 400,541,575.42 |
| 本期利润 | -364,806,862.14 | -69,782,147.55 | -434,589,009.69 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -68,050,901.02 | 67,049,874.01 | -1,001,027.01 |
| 其中：基金申购款 | 5,526,135.85 | -6,396,955.21 | -870,819.36 |

| | | | |
|---------|----------------|-----------------|----------------|
| 基金赎回款 | -73,577,036.87 | 73,446,829.22 | -130,207.65 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 203,615,659.86 | -238,664,121.14 | -35,048,461.28 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,362,958.08 | 5,472,205.83 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 119,397.02 | 152,067.53 |
| 其他 | 14.83 | 5,687.72 |
| 合计 | 2,482,369.93 | 5,629,961.08 |

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 11,304,044,282.49 | 16,737,915,636.86 |
| 减：卖出股票成本总额 | 11,603,458,731.45 | 15,358,551,955.55 |
| 买卖股票差价收入 | -299,414,448.96 | 1,379,363,681.31 |

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 12,575,926.39 | 35,191,968.79 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 12,575,926.39 | 35,191,968.79 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|------|-----------------------------|----------------------------------|
|------|-----------------------------|----------------------------------|

| | | |
|------------|----------------|----------------|
| 1. 交易性金融资产 | -69,782,147.55 | 471,058,444.84 |
| ——股票投资 | -69,782,147.55 | 471,058,444.84 |
| ——债券投资 | - | - |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——基金投资 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 合计 | -69,782,147.55 | 471,058,444.84 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 153,997.76 | 807,421.38 |
| 转换费 | 3,431.17 | 9,624.13 |
| 印花税返还 | 43,194.97 | 16,113.34 |
| 合计 | 200,623.90 | 833,158.85 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 33,930,898.78 | 50,490,862.60 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 33,930,898.78 | 50,490,862.60 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 100,000.00 | 110,000.00 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 300,000.00 |
| 债券帐户维护费 | 18,000.00 | 18,000.00 |
| 银行汇划费用 | 21,267.15 | 17,702.82 |
| 合计 | 439,267.15 | 445,702.82 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|---------------------|
| 宝盈基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中国对外经济贸易信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中铁信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 成都工业投资集团有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 39,669,572.11 | 52,712,873.73 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,407,303.95 | 7,846,562.61 |

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,611,595.36 | 8,785,479.01 |

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易(上年度可比期间本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易)。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金（上年度可比期间本基金基金管理人未运用自有资金投资本基金）。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金（上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金）。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|--------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 229,563,259.47 | 2,362,958.08 | 355,710,156.81 | 5,472,205.83 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销的证券（上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的）。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002488 | 金固股份 | 2010-10-13 | 2011-01-21 | 网下申购 | 22.00 | 24.41 | 147,601 | 3,247,222.00 | 3,602,940.41 | - |
| 002530 | 丰东股份 | 2010-12-24 | 2011-03-31 | 网下申购 | 12.00 | 22.00 | 2,250,000 | 27,000,000.00 | 49,500,000.00 | - |
| 601118 | 海南橡胶 | 2010-12-30 | 2011-04-07 | 网下申购 | 5.99 | 5.99 | 307,886 | 1,844,237.14 | 1,844,237.14 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，从新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股

上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 600664 | 哈药股份 | 2010-12-29 | 重大资产重组 | 22.57 | 2011-02-16 | 24.83 | 2,500,000 | 46,052,217.12 | 56,425,000.00 | - |

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2010年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 229,563,259.47 | - | - | - | 229,563,259.47 |
| 结算备付金 | 12,424,944.78 | - | - | - | 12,424,944.78 |
| 存出保证金 | - | - | - | 1,773,819.25 | 1,773,819.25 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 2,076,850,289.30 | 2,076,850,289.30 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 92,795,152.08 | 92,795,152.08 |
| 应收利息 | - | - | - | 60,854.65 | 60,854.65 |
| 应收申购款 | - | - | - | 120,211.34 | 120,211.34 |
| 资产总计 | 241,988,204.25 | - | - | 2,171,600,326.62 | 2,413,588,530.87 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 595,656.64 | 595,656.64 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 3,081,436.35 | 3,081,436.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | 513,572.75 | 513,572.75 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 6,078,315.02 | 6,078,315.02 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,600,133.21 | 1,600,133.21 |
| 负债总计 | - | - | - | 11,869,113.97 | 11,869,113.97 |
| 利率敏感度缺口 | 241,988,204.25 | - | - | 2,159,731,212.65 | 2,401,719,416.90 |
| 上年度末 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|-------------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 2009年12月31日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 355,710,156.81 | - | - | - | 355,710,156.81 |
| 结算备付金 | 8,867,165.50 | - | - | - | 8,867,165.50 |
| 存出保证金 | - | - | - | 2,628,164.84 | 2,628,164.84 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 2,890,279,650.70 | 2,890,279,650.70 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 197,521,894.41 | 197,521,894.41 |
| 应收利息 | - | - | - | 76,196.82 | 76,196.82 |
| 应收申购款 | 9,881.42 | - | - | 715,620.94 | 725,502.36 |
| 资产总计 | 364,587,203.73 | - | - | 3,091,221,527.71 | 3,455,808,731.44 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 14,214,827.46 | 14,214,827.46 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,320,864.51 | 4,320,864.51 |
| 应付托管费 | - | - | - | 720,144.09 | 720,144.09 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 6,056,771.10 | 6,056,771.10 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,645,944.47 | 1,645,944.47 |
| 负债总计 | - | - | - | 26,958,551.63 | 26,958,551.63 |
| 利率敏感度缺口 | 364,587,203.73 | - | - | 3,064,262,976.08 | 3,428,850,179.81 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2009 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2009 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2010 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 | |
|--------------|-------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 2,076,850,289.30 | 86.47 | 2,890,279,650.70 | 84.29 |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,076,850,289.30 | 86.47 | 2,890,279,650.70 | 84.29 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除上证 A 股指数外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|-----------------------|-----------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2010 年 12 月 31 日 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
| | 1. 上证 A 股指数上升 5% | 103,880,000.00 | 143,270,000.00 |
| | 2. 上证 A 股指数下降 5% | -103,880,000.00 | -143,270,000.00 |

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,020,425,289.30 元，属于第二层级的余额为 56,425,000.00，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 2,890,279,650.70 元，无第二层级和第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 2,076,850,289.30 | 86.05 |
| | 其中：股票 | 2,076,850,289.30 | 86.05 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 241,988,204.25 | 10.03 |
| 6 | 其他各项资产 | 94,750,037.32 | 3.93 |
| 7 | 合计 | 2,413,588,530.87 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|------|---------------|
|----|------|------|---------------|

| | | | |
|-----|----------------|------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 44,579,237.14 | 1.86 |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,341,491,589.44 | 55.86 |
| C0 | 食品、饮料 | 222,814,189.24 | 9.28 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 3,030,000.00 | 0.13 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 22,703,500.00 | 0.95 |
| C5 | 电子 | 190,589,653.72 | 7.94 |
| C6 | 金属、非金属 | 148,773,800.16 | 6.19 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 529,939,127.81 | 22.06 |
| C8 | 医药、生物制品 | 223,641,318.51 | 9.31 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 95,659,200.00 | 3.98 |
| F | 交通运输、仓储业 | 297,558,462.72 | 12.39 |
| G | 信息技术业 | 265,188,800.00 | 11.04 |
| H | 批发和零售贸易 | 32,373,000.00 | 1.35 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 2,076,850,289.30 | 86.47 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 600406 | 国电南瑞 | 1,550,000 | 111,693,000.00 | 4.65 |
| 2 | 600819 | 耀皮玻璃 | 8,000,000 | 104,480,000.00 | 4.35 |
| 3 | 600029 | 南方航空 | 10,000,000 | 97,400,000.00 | 4.06 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 2,800,000 | 96,964,000.00 | 4.04 |
| 5 | 601111 | 中国国航 | 7,000,079 | 95,761,080.72 | 3.99 |
| 6 | 002375 | 亚厦股份 | 1,040,000 | 95,659,200.00 | 3.98 |
| 7 | 600085 | 同仁堂 | 2,700,000 | 92,556,000.00 | 3.85 |
| 8 | 000799 | 酒鬼酒 | 3,750,051 | 81,751,111.80 | 3.40 |
| 9 | 600118 | 中国卫星 | 3,200,000 | 79,424,000.00 | 3.31 |
| 10 | 600125 | 铁龙物流 | 5,000,000 | 72,100,000.00 | 3.00 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 11 | 600312 | 平高电气 | 5,000,000 | 68,150,000.00 | 2.84 |
| 12 | 600594 | 益佰制药 | 3,350,057 | 66,029,623.47 | 2.75 |
| 13 | 002179 | 中航光电 | 3,350,082 | 61,842,513.72 | 2.57 |
| 14 | 601989 | 中国重工 | 5,000,260 | 58,953,065.40 | 2.45 |
| 15 | 600664 | 哈药股份 | 2,500,000 | 56,425,000.00 | 2.35 |
| 16 | 000063 | 中兴通讯 | 2,000,000 | 54,600,000.00 | 2.27 |
| 17 | 000559 | 万向钱潮 | 3,750,000 | 51,937,500.00 | 2.16 |
| 18 | 002106 | 莱宝高科 | 750,000 | 49,687,500.00 | 2.07 |
| 19 | 002530 | 丰东股份 | 2,250,000 | 49,500,000.00 | 2.06 |
| 20 | 002241 | 歌尔声学 | 892,000 | 48,765,640.00 | 2.03 |
| 21 | 600031 | 三一重工 | 2,250,000 | 48,667,500.00 | 2.03 |
| 22 | 000425 | 徐工机械 | 850,093 | 48,625,319.60 | 2.02 |
| 23 | 600066 | 宇通客车 | 2,250,300 | 47,323,809.00 | 1.97 |
| 24 | 002050 | 三花股份 | 1,400,000 | 46,900,000.00 | 1.95 |
| 25 | 600111 | 包钢稀土 | 620,014 | 44,293,800.16 | 1.84 |
| 26 | 002048 | 宁波华翔 | 3,250,000 | 44,167,500.00 | 1.84 |
| 27 | 600875 | 东方电气 | 1,200,000 | 41,880,000.00 | 1.74 |
| 28 | 600327 | 大厦股份 | 2,700,000 | 32,373,000.00 | 1.35 |
| 29 | 600221 | 海南航空 | 3,600,600 | 32,297,382.00 | 1.34 |
| 30 | 600354 | 敦煌种业 | 850,000 | 30,855,000.00 | 1.28 |
| 31 | 002273 | 水晶光电 | 600,000 | 30,294,000.00 | 1.26 |
| 32 | 600887 | 伊利股份 | 700,000 | 26,782,000.00 | 1.12 |
| 33 | 600096 | 云天化 | 850,000 | 22,703,500.00 | 0.95 |
| 34 | 000547 | 闽福发 A | 1,380,000 | 19,471,800.00 | 0.81 |
| 35 | 002100 | 天康生物 | 900,056 | 17,317,077.44 | 0.72 |
| 36 | 002028 | 思源电气 | 530,000 | 13,923,100.00 | 0.58 |
| 37 | 600248 | 延长化建 | 1,000,000 | 11,880,000.00 | 0.49 |
| 38 | 600422 | 昆明制药 | 621,808 | 8,630,695.04 | 0.36 |
| 39 | 600475 | 华光股份 | 264,060 | 6,308,393.40 | 0.26 |
| 40 | 002488 | 金固股份 | 147,601 | 3,602,940.41 | 0.15 |
| 41 | 000815 | 美利纸业 | 500,000 | 3,030,000.00 | 0.13 |
| 42 | 601118 | 海南橡胶 | 307,886 | 1,844,237.14 | 0.08 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 541,646,941.78 | 15.80 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 2 | 600030 | 中信证券 | 403,700,238.55 | 11.77 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 299,002,054.43 | 8.72 |
| 4 | 600029 | 南方航空 | 262,757,380.92 | 7.66 |
| 5 | 600489 | 中金黄金 | 259,832,115.43 | 7.58 |
| 6 | 600837 | 海通证券 | 250,036,216.43 | 7.29 |
| 7 | 600406 | 国电南瑞 | 230,728,244.55 | 6.73 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 215,626,266.58 | 6.29 |
| 9 | 600096 | 云天化 | 198,341,870.36 | 5.78 |
| 10 | 000425 | 徐工机械 | 194,250,802.70 | 5.67 |
| 11 | 000063 | 中兴通讯 | 187,273,821.81 | 5.46 |
| 12 | 601111 | 中国国航 | 186,084,759.24 | 5.43 |
| 13 | 600547 | 山东黄金 | 183,334,142.00 | 5.35 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 157,990,941.21 | 4.61 |
| 15 | 600000 | 浦发银行 | 147,073,148.44 | 4.29 |
| 16 | 600519 | 贵州茅台 | 145,779,549.45 | 4.25 |
| 17 | 600875 | 东方电气 | 144,356,871.71 | 4.21 |
| 18 | 600111 | 包钢稀土 | 141,289,838.22 | 4.12 |
| 19 | 600312 | 平高电气 | 139,806,820.89 | 4.08 |
| 20 | 000792 | 盐湖钾肥 | 137,651,493.68 | 4.01 |
| 21 | 600118 | 中国卫星 | 135,509,165.29 | 3.95 |
| 22 | 000157 | 中联重科 | 132,327,856.32 | 3.86 |
| 23 | 600085 | 同仁堂 | 129,286,931.20 | 3.77 |
| 24 | 000002 | 万科A | 119,450,313.92 | 3.48 |
| 25 | 600362 | 江西铜业 | 114,846,211.11 | 3.35 |
| 26 | 601857 | 中国石油 | 113,207,982.36 | 3.30 |
| 27 | 601989 | 中国重工 | 109,057,299.29 | 3.18 |
| 28 | 600383 | 金地集团 | 103,263,202.70 | 3.01 |
| 29 | 600125 | 铁龙物流 | 97,723,254.11 | 2.85 |
| 30 | 600019 | 宝钢股份 | 91,974,627.79 | 2.68 |
| 31 | 002375 | 亚厦股份 | 91,703,089.13 | 2.67 |
| 32 | 600309 | 烟台万华 | 91,074,582.58 | 2.66 |
| 33 | 601088 | 中国神华 | 90,912,087.35 | 2.65 |
| 34 | 600256 | 广汇股份 | 88,233,394.58 | 2.57 |
| 35 | 000069 | 华侨城A | 87,777,774.92 | 2.56 |
| 36 | 600819 | 耀皮玻璃 | 86,557,043.70 | 2.52 |
| 37 | 000799 | 酒鬼酒 | 83,981,185.16 | 2.45 |
| 38 | 002092 | 中泰化学 | 83,713,522.11 | 2.44 |
| 39 | 601328 | 交通银行 | 83,505,266.78 | 2.44 |
| 40 | 600123 | 兰花科创 | 82,932,535.76 | 2.42 |
| 41 | 000652 | 泰达股份 | 80,762,402.90 | 2.36 |
| 42 | 600900 | 长江电力 | 74,264,076.12 | 2.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 43 | 601939 | 建设银行 | 72,339,035.00 | 2.11 |
| 44 | 600316 | 洪都航空 | 70,405,290.91 | 2.05 |
| 45 | 600038 | 哈飞股份 | 69,038,001.89 | 2.01 |
| 46 | 002179 | 中航光电 | 68,978,387.44 | 2.01 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 665,803,704.80 | 19.42 |
| 2 | 600837 | 海通证券 | 435,539,750.39 | 12.70 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 369,802,926.63 | 10.79 |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 303,095,382.04 | 8.84 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 281,629,652.19 | 8.21 |
| 6 | 600016 | 民生银行 | 275,887,329.95 | 8.05 |
| 7 | 601857 | 中国石油 | 268,750,211.16 | 7.84 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 261,655,268.47 | 7.63 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 253,795,197.32 | 7.40 |
| 10 | 600489 | 中金黄金 | 242,944,900.70 | 7.09 |
| 11 | 600900 | 长江电力 | 234,207,635.18 | 6.83 |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 217,443,621.08 | 6.34 |
| 13 | 601628 | 中国人寿 | 211,111,251.07 | 6.16 |
| 14 | 600028 | 中国石化 | 199,631,279.85 | 5.82 |
| 15 | 000157 | 中联重科 | 188,519,597.35 | 5.50 |
| 16 | 600029 | 南方航空 | 188,251,047.36 | 5.49 |
| 17 | 600547 | 山东黄金 | 164,107,973.56 | 4.79 |
| 18 | 600519 | 贵州茅台 | 149,617,845.90 | 4.36 |
| 19 | 600096 | 云天化 | 147,318,373.51 | 4.30 |
| 20 | 000568 | 泸州老窖 | 146,743,493.43 | 4.28 |
| 21 | 000425 | 徐工机械 | 145,299,189.71 | 4.24 |
| 22 | 601166 | 兴业银行 | 145,005,853.62 | 4.23 |
| 23 | 600406 | 国电南瑞 | 137,463,470.00 | 4.01 |
| 24 | 000792 | 盐湖钾肥 | 134,866,728.27 | 3.93 |
| 25 | 601318 | 中国平安 | 134,267,244.86 | 3.92 |
| 26 | 600111 | 包钢稀土 | 132,408,893.93 | 3.86 |
| 27 | 601328 | 交通银行 | 126,077,049.72 | 3.68 |
| 28 | 002092 | 中泰化学 | 122,909,873.31 | 3.58 |
| 29 | 600875 | 东方电气 | 120,322,567.76 | 3.51 |

| | | | | |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 30 | 000002 | 万 科 A | 118,963,061.79 | 3.47 |
| 31 | 600089 | 特变电工 | 112,717,097.17 | 3.29 |
| 32 | 600362 | 江西铜业 | 110,603,222.72 | 3.23 |
| 33 | 600596 | 新安股份 | 105,351,227.21 | 3.07 |
| 34 | 600123 | 兰花科创 | 101,466,108.41 | 2.96 |
| 35 | 600256 | 广汇股份 | 100,415,885.61 | 2.93 |
| 36 | 600309 | 烟台万华 | 97,114,647.89 | 2.83 |
| 37 | 000059 | 辽通化工 | 95,490,576.75 | 2.78 |
| 38 | 600383 | 金地集团 | 94,185,060.36 | 2.75 |
| 39 | 601111 | 中国国航 | 91,532,144.36 | 2.67 |
| 40 | 600019 | 宝钢股份 | 90,022,386.58 | 2.63 |
| 41 | 000423 | 东阿阿胶 | 89,327,130.72 | 2.61 |
| 42 | 600316 | 洪都航空 | 86,308,670.66 | 2.52 |
| 43 | 600312 | 平高电气 | 85,221,205.82 | 2.49 |
| 44 | 000933 | 神火股份 | 77,264,588.17 | 2.25 |
| 45 | 600118 | 中国卫星 | 76,095,551.48 | 2.22 |
| 46 | 000069 | 华侨城 A | 74,956,395.54 | 2.19 |
| 47 | 601939 | 建设银行 | 73,066,427.04 | 2.13 |
| 48 | 600415 | 小商品城 | 70,516,945.80 | 2.06 |
| 49 | 600085 | 同仁堂 | 70,451,335.49 | 2.05 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|-------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 10,859,811,517.60 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 11,304,044,282.49 |

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.9.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,773,819.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | 92,795,152.08 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 60,854.65 |
| 5 | 应收申购款 | 120,211.34 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 94,750,037.32 |

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 126,038 | 19,333.60 | 7,057,592.55 | 0.29% | 2,429,710,285.63 | 99.71% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 135,954.24 | 0.0056% |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2007年1月19日)基金份额总额 | 9,568,309,032.42 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,028,308,604.39 |
| 本报告期基金总申购份额 | 43,022,106.49 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 634,562,832.70 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,436,767,878.18 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2010年3月19日，宝盈基金管理有限公司独立董事陈小悦先生病逝。2010年6月28日，宝盈基金管理有限公司股东会以直接做出决定的方式通过更换宝盈基金管理有限公司独立董事事项：同意陈

雨露辞去宝盈基金管理有限公司独立董事职务；同意贺颖奇和屈文洲担任宝盈基金管理有限公司独立董事。相关情况按规定已报监管部门备案。2010 年 4 月 17 日公司股东会同意原监事长王慧辞去监事职务，公司拟按规定程序增补监事。宝盈基金管理有限公司 2010 年 8 月 6 日公告，经公司董事会审议决定：不再聘任刘传葵先生担任督察长、不再聘任于志先生担任副总经理、同意陆金海先生辞去总经理职务。同意拟聘任汪钦先生担任宝盈基金管理有限公司总经理、同意拟聘任孙胜华先生为宝盈基金管理有限公司督察长。上述事项按规定报监管部门核准。宝盈基金管理有限公司 2010 年 11 月 4 日公告，汪钦先生、孙胜华先生的基金行业高级管理人员任职资格已获中国证券监督管理委员会核准。宝盈基金管理有限公司 2010 年 11 月 9 日公告，决定同意胡东良先生辞去公司副总经理职务，按规定报监管机构。2010 年 12 月 19 日，公司股东会同意张建华女士担任宝盈基金管理有限公司监事，同意陆金海先生辞去董事职务，由汪钦先生担任宝盈基金管理有限公司管理层董事，同意钟鸣先生辞去董事职务，上述事项按规定报监管机构。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度，基金管理人收到福田区人民法院传票，法院受理了胡博天诉本基金管理人证券投资基金交易纠纷案（案号：（2010）深福法民二初字第 7680 号）。2010 年 12 月 27 日，法院开庭不公开审理了此案。2010 年 12 月 29 日，法院裁定本案按自动撤诉处理。除上述案件外，本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所审计费 100,000.00 元，目前事务所已连续 2 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 长江证券 | 1 | 3,003,696,416.26 | 13.59% | 2,553,125.80 | 13.77% | - |
| 安信证券 | 1 | 2,719,090,963.67 | 12.30% | 2,311,207.58 | 12.46% | - |
| 西南证券 | 1 | 2,595,693,623.96 | 11.74% | 2,206,335.36 | 11.90% | - |
| 国元证券 | 1 | 1,868,359,918.00 | 8.45% | 1,588,087.37 | 8.56% | - |
| 招商证券 | 1 | 1,790,198,048.16 | 8.10% | 1,454,551.00 | 7.84% | - |
| 中银国际 | 1 | 1,762,228,595.41 | 7.97% | 1,431,825.60 | 7.72% | - |
| 中信证券 | 1 | 1,474,075,374.68 | 6.67% | 1,252,959.96 | 6.76% | - |
| 兴业证券 | 1 | 1,406,027,135.05 | 6.36% | 1,142,404.93 | 6.16% | - |
| 国盛证券 | 1 | 981,681,879.03 | 4.44% | 834,427.29 | 4.50% | - |
| 第一创业 | 1 | 679,959,036.92 | 3.08% | 577,960.68 | 3.12% | - |
| 民族证券 | 1 | 675,663,084.21 | 3.06% | 574,314.03 | 3.10% | - |
| 广发证券 | 1 | 675,208,006.31 | 3.05% | 548,613.73 | 2.96% | - |
| 东海证券 | 1 | 647,901,326.98 | 2.93% | 550,715.12 | 2.97% | - |
| 中金公司 | 1 | 642,413,682.27 | 2.91% | 521,966.33 | 2.81% | - |
| 银河证券 | 1 | 558,005,812.39 | 2.52% | 474,304.09 | 2.56% | - |
| 海通证券 | 1 | 510,377,366.65 | 2.31% | 433,815.88 | 2.34% | - |
| 宏源证券 | 1 | 112,245,904.62 | 0.51% | 91,200.28 | 0.49% | - |
| 华泰联合证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单独指股票交易佣金。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

（I）租用交易单元情况

| 券商名称 | 上海交易单元（个数） | 深圳交易单元（个数） |
|------|------------|------------|
| 英大证券 | 1 | - |
| 国元证券 | 1 | - |
| 西南证券 | 1 | - |
| 民族证券 | 1 | - |

（II）退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|------------------|------------|
| 1 | 宝盈基金管理有限公司关于调整旗下基金转换费率的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-03-15 |
| 2 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-04-01 |
| 3 | 宝盈基金管理有限公司关于参加东方证券股份有限公司基金非现场交易费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-04-07 |
| 4 | 宝盈基金管理有限公司关于参加兴业证券股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-04-12 |
| 5 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-05-06 |
| 6 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-06-01 |
| 7 | 宝盈基金管理有限公司关于新增申银万国证券股份有限公司办理基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-06-07 |
| 8 | 宝盈基金管理有限公司关于参加中国建银投资证券有限责任公司网上费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-06-28 |
| 9 | 宝盈基金管理有限公司关于参加安信证券股份有限公司开放式基金网上申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-06-28 |
| 10 | 宝盈基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-07-01 |
| 11 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-07-01 |
| 12 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票 | 中国证券报 证券时报 | 2010-07-02 |

| | | | |
|----|--|------------------|------------|
| | 采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 报 上海证券报 | |
| 13 | 宝盈基金管理有限公司关于新增信达证券股份有限公司办理基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-07-14 |
| 14 | 宝盈基金管理有限公司关于参加信达证券股份有限公司非现场委托方式基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-07-14 |
| 15 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-07-17 |
| 16 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-07-29 |
| 17 | 宝盈基金管理有限公司关于变更公司高级管理人员的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-08-06 |
| 18 | 宝盈基金管理有限公司关于参加海通证券股份有限公司基金定投业务申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-08-09 |
| 19 | 宝盈基金管理有限公司关于参加齐鲁证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-08-31 |
| 20 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-09-03 |
| 21 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-09-13 |
| 22 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加华泰证券股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-09-21 |
| 23 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行网上银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-09-30 |
| 24 | 宝盈基金管理有限公司关于参加中信建投证券有限责任公司网上交易系统费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-10-27 |
| 25 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金新增中国农业银行股份有限公司办理转换业务的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-10-29 |
| 26 | 宝盈基金管理有限公司关于变更公司高级管理人员的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-11-04 |
| 27 | 宝盈基金管理有限公司关于同意胡东良先生辞去公司副总经理职务的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-11-09 |
| 28 | 宝盈基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司网上银行和手机银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-12-31 |
| 29 | 宝盈基金管理有限公司关于配合交通银行股份有限公司调整基金定期定额投资起点金额的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-12-31 |
| 30 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2011 倾心回馈”基金定期定额优惠活动的公告 | 中国证券报 证券时报 上海证券报 | 2010-12-31 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2010 年 1 月 6 日至 1 月 15 日，深圳证监局对我公司进行了现场检查。2010 年 3 月 30 日，中国证监会就现场检查中发现的问题出具了《关于对宝盈基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》（以

下简称“《决定》”), 责令我公司进行为期 6 个月的整改, 在整改期间暂停我公司新产品审核和特定客户资产管理合同备案。我公司将按照《决定》的要求进行整改, 并及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈策略增长股票型证券投资基金设立的文件

《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金合同》

《宝盈策略增长股票型证券投资基金基金托管协议》

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人办公地址: 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501

基金托管人办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

宝盈基金管理有限公司

二〇一一年三月三十一日