

宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金由宝盈鸿利收益证券投资基金更名而来。宝盈鸿利收益证券投资基金（以下简称本基金）经中国证券监督管理委员会 2002 年 8 月 9 日证监基金字 2002[53]号文批准公开发售。本基金基金合同于 2002 年 10 月 8 日正式生效。2015 年 6 月 8 日至 2015 年 7 月 9 日，宝盈鸿利收益证券投资基金基金份额持有人大会以通讯会议方式召开，大会审议并通过《关于修改宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括宝盈鸿利收益证券投资基金变更名称，修改基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、收益分配方式等，以及根据《基金法》和《运作办法》对其他部分条款按照现时有效的相关法律法规及中国证监会的有关规定进行的修改。2015 年 7 月 10 日，基金份额持有人大会决议生效，并报中国证监会备案。自持有人大会决议自通过之日起生效，原《宝盈鸿利收益证券投资基金基金合同》失效且《宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效，宝盈鸿利收益证券投资基金正式变更为宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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》、基金合同及其他有关规定享有权利、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，应详细查阅本基金的基金合同。

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。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险，这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2017 年 10 月 8 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日。基金托管人中国农业银行股份有限公司对本招募说明书(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、基金管理人基本情况

名称：宝盈基金管理有限公司

注册地址：深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501

成立时间：2001 年 5 月 18 日

法定代表人：李文众

总经理：张啸川

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

注册资本：10000 万元人民币

电话：075583276688

传真：075583515599

联系人：张志刚

2、基金管理人股权结构及组织结构

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、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 75% 的股权，中国对外经济贸易信托有限公司持有 25% 的股权。

公司设置公募基金投资决策委员会（试行）、专户投资决策委员会（试行）、风险管理委员会、信息技术治理委员会和产品委员会，并设置权益投资部、固定收益一部、固定收益二部、专户投资部、量化投资部、海外投资部、研究部、创新业务部、风险管理部、集中交易部、产品规划部、渠道业务部、机构业务部、市场营销部、互联网金融部、基金运营部、信息技术部、监察稽核部、公司财务部、人力资源部和总经理办公室等 21 个部室及北京办事处、上海办事处。

（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

李文众先生，董事长，1959 年生，中共党员，经济师。1978 年 12 月至 1985 年 5 月在中国人民银行成都市支行解放中路办事处工作；1985 年 6 月至 1997 年 12 月在中国工商银行成都市信托投资公司任职，先后担任委托代理部、证券管理部经理；1997 年 12 月至 2002 年 11 月成都工商信托投资有限责任公司任职，历任部门经理、总经理助理；2002 年 11 月至今在中铁信托有限责任公司任副总经理。

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。

陈赤先生，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。

张栋先生，董事，1977 年生，硕士研究生。2000 年 8 月至 2001 年 5 月，在中国化工进出口总公司资产管理部投资一部任副总经理；2001 年 6 月至 2002 年 3 月，在中化进出口总公司投资部任项目经理；2002 年 3 月至 2003 年 2 月，在飞秒光电科技（西安）有限公司光通信事业部任总经理助理；2003 年 2 月至 2004 年 3 月，在中化国际（控股）股份有限公司冶金能源事业部任项目经理；2004 年 3 月至 2009 年 5 月，在山西中化寰达事业有限责任公司任总经理；2009 年 6 月至 2010 年 7 月，在中化石油有限公司炼化事业部任高级项目经理；2010 年 7 月至 2011 年 2 月，在中国中化股份有限公司工程管理部控制部任副经理；2011 年 2 月至 2013 年 7 月，在中化石油有限公司油品销售南方事业部任副总经理；2013 年 7 月至 2014 年 1 月，在中国对外经济贸易信托有限公司资产管理一部工作；2014 年 1 月至 2014 年 7 月，在中国对外

经济贸易信托有限公司资产管理三部任总经理；2014年7月至2016年7月，在中国对外经济贸易信托有限公司基础产业部任总经理；2016年7月至今，在中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部任总经理。

张苏彤先生，独立董事，1957年生，中共党员，博士研究生。1975年12月到1978年3月，在陕西重型机器厂任职；1982年7月到1985年9月，在陕西省西安农业机械厂任助理工程师；1987年7月到1989年5月，在陕西省西安农业机械厂任工程师、车间副主任；1989年5月到2000年4月，在陕西财经学院财会学院任教授、系主任；2000年4月到2003年3月，在西安交通大学会计学院任教授、系主任；2003年3月到2016年12月在中国政法大学民商经济法学院财税金融法研究所任副所长、教授、研究生导师，2016年12月至今在中国政法大学商学院会计研究所任教授、研究生导师。

廖振中先生，独立董事，1977年生，法学硕士研究生。2003年到2014年，在西南财经大学法学院任讲师；2014年至今，在西南财经大学法学院任副教授。兼任四川亚峰律师事务所兼职律师，成都市传媒集团新闻实业有限公司外部董事，乐山市嘉州民富村镇银行独立董事，成都市中级人民法院专家调解员，四川省住建厅海绵城市建设专家委员会成员。

王艳艳女士，独立董事，1980年生，中共党员，会计学博士。2007年8月到2008年8月，在美国休斯敦大学从事博士后研究工作；2008年6月到2010年12月，在厦门大学财务与会计研究院任助理教授；2011年1月到2014年7月，在厦门大学管理学院任副教授；2014年8月至今，在厦门大学管理学院任教授。

徐加根先生，独立董事，1969年生，中共党员，西南财经大学教授。1991年至1996年在中国石化湖北化肥厂工作；1996年至1999年，在西南财经大学学习；1999年至今，在西南财经大学任教，现任西南财经大学金融创新与产品设计研究所副所长。

张啸川先生，董事，1978年生，中共党员，经济学博士。2005年3月-2005年5月任职于中国证监会市场监管部结算监管处。2005年5月至2009年11月任职于中国证监会股权分置改革领导小组办公室。2009年11月至2011年8月担任中国证监会市场监管部市场监控处副处长。2011年8月至2012年5月担任中国证监会市场监管部综合处副处长。2012年5月至2015年7月担任中国证监会市场监管部交易监管处处长。2015年7月至2017年4月担任博时基金管理有限公司高级顾问兼北京分公司总经理、博时资本管理有限公司董事。2017年4月14日起任宝盈基金管理有限公司总经理。

（2）监事会

张建华女士，监事，1969年生，高级经济师。曾就职于四川新华印刷厂、成都科力风险投资公司、成都工商信托有限公司、衡平信托有限责任公司。现任中铁信托有限责任公司金融同业部总经理。

刘郁飞先生，监事，1973年生，中国注册会计师、ACCA。曾就职于中国林业科学研究院、中林绿源科技有限责任公司、同新会计师事务所、中国德仁集团有限公司、毕马威华振会计师事务所。现任职于中国对外经济贸易信托有限公司审计稽核部。

魏玲玲女士，监事，1970年生，中级经济师。曾任职于深圳石化集团股份有限公司、华夏证券深圳振华路营业部。现任宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

汪兀先生，监事，1983年生。曾任职于宝盈基金管理有限公司监察稽核部、融通基金管理有限公司监察稽核部，现任宝盈基金管理有限公司监察稽核部总经理。

（3）其他高级管理人员

张瑾女士，督察长，1964年生，工学学士。曾任职于中国工商银行安徽省分行科技处、华安证券有限公司深圳总部投资银行部、资产管理总部。2001年加入宝盈基金管理有限公司，历任监察稽核部总监助理、副总监、总监，2013年12月起任宝盈基金管理有限公司督察长。

丁宁先生，副总经理，1976年生，硕士，高级经济师。1998年8月至2001年7月任职于安徽

省马鞍山钢铁股份有限公司。2003年6月至2010年9月担任中铁信托有限责任公司综合管理部、人力资源部副总经理。2010年9月至2016年11月担任中铁信托有限责任公司综合管理部、人力资源部总经理。2015年12月加入宝盈基金管理有限公司，现任宝盈基金管理有限公司副总经理、党工委书记、纪工委书记、董事会秘书。2017年3月起兼任中铁宝盈资产管理有限公司董事长。

葛俊杰先生，副总经理，1973年生，硕士。曾任职于深圳市政府外事办公室、深圳市政府金融发展服务办公室。2007年加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、总经理办公室主任、专户投资部总监，现任副总经理、投资经理。

张新元先生，副总经理，1997年3月至2002年8月任职于黄河证券，2002年9月至2004年2月任职于民生证券，2004年3月至2011年6月任职于长城基金管理有限公司，2011年7月加入宝盈基金管理有限公司，历任总经理办公室主任、机构业务部总监、总经理助理，现任公司副总经理、创新业务部总经理、投资经理。2017年8月起兼任中铁宝盈资产管理有限公司副董事长。

2、基金经理简历

李进先生，武汉大学金融学专业硕士。2007年7月至2010年2月任职于中国农业银行深圳分行，担任信贷审批员，2010年3月至2013年8月任职于华泰联合证券研究所，担任研究员。自2013年8月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

张小红，2014年1月7日至2017年1月4日；

彭敢，2013年8月1日至2014年9月13日；

高峰，2010年2月12日至2013年8月1日；

陆万山，2008年12月24日至2010年9月2日；

刘丰元，2007年4月11日至2008年12月22日；

赵龙，2006年8月30日至2007年4月13日；

陈鹏，2004年12月17日至2006年8月30日；

杨军：2003年9月5日至2004年12月17日；

方晔，2002年10月8日至2003年9月5日。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

本公司公募基金投资决策委员会（试行）成员包括：

张啸川先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

孙海波先生（秘书长）：权益投资部总经理、研究部总经理。

葛俊杰先生（委员）：宝盈基金管理有限公司副总经理、投资经理。

段鹏程先生（委员）：宝盈基金管理有限公司权益投资部执行总经理、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金和宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈若劲女士（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益一部总经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理。

刘李杰先生（委员）：宝盈基金管理有限公司量化投资部总经理，宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理。

高宇先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益二部副总经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理。

方佳佳女士（秘书）：宝盈基金管理有限公司研究员，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资

基金基金经理助理。

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

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

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

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造伴你成长服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国最佳托管银行。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届金牌理财 TOP10 颁奖盛典中成绩突出,获最佳托管银行奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的最佳资产托管奖。2012 年荣获第十届中国财经风云榜最佳资产托管银行称号;2013 年至 2016 年连续荣获上海清算所授予的托管银行优秀奖和中央国债登记结算有限责任公司授予的优秀托管机构奖称号;2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的养老金业务最佳发展奖称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 140 名,其中具有高级职称的专家 30 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术

职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2017 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 415 只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理,实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

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：李文众

电话：0755-83276688

传真：0755-83515880

联系人：李依、梁靖

2、代销机构

(1)中国农业银行

联系地址：北京市海淀区复兴路甲 23 号

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(2)中国工商银行

联系地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(3) 中国银行

联系地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(4) 中国建设银行

联系地址：北京市西城区金融大街 25 号

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(5) 交通银行

联系地址：上海市银城中路 188 号

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(6) 招商银行

联系地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(7) 中信银行

联系地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

客户服务电话：95558

公司网址：www.ecitic.com

(8) 中国民生银行

联系地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(9) 中国邮政储蓄银行

联系地址：北京市西城区金融大街 3 号

客户服务电话：95580

公司网址：www.psbc.com

(10) 北京银行

联系地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

客户服务电话：95526

公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

(11) 平安银行

联系地址：深圳市深南东路 5047 号

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

(12) 东莞农村商业银行

联系地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号

客户服务电话：0769-961122

公司网址：www.drccbank.com

(13) 国泰君安证券

联系地址：上海市延平路 135 号

客户服务电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(14)国元证券

联系地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

客户服务电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

(15)中信建投证券

联系地址：北京市东城区朝内大街 188 号

客户服务电话：4008888108、95587

公司网址：www.csc108.com

(16)国信证券

联系地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

客户服务电话：8008108868

公司网址：www.guosen.com.cn

(17)招商证券

联系地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(18)广发证券

联系地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

客户服务电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(19)中信证券

联系地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦三层

客户服务电话：400-889-5548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(20)银河证券

联系地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 c 座

客户服务电话：4008888888、95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

(21)海通证券

联系地址：上海市淮海中路 98 号金钟广场 19 层

客户服务电话：4008888001、95553

公司网址：www.htsec.com

(22)申万宏源证券

联系地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 40 层

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(23)兴业证券

联系地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(24)长江证券

联系地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

客户服务电话：4008888999、95579

公司网址：www.cjsc.com.cn

(25)安信证券

联系地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

客户服务电话：4008001001

公司网址：www.essence.com.cn

(26)西南证券

联系地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

客户服务电话：4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

(27)万联证券

联系地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

客户服务电话：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

(28)华宝证券

联系地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层

客户联系电话：400-820-9898、021-38929908

公司网址：www.cnhbstock.com

(29)渤海证券

联系地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

客户服务电话：4006515988

公司网址：www.bhzq.com

(30)华泰证券

联系地址：江苏省南京市中山东路 90 号

客户服务电话：4008895597、95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(31)中信证券（山东）

联系地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(32)东兴证券

联系地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

客户服务电话：4008888993

公司网址：www.dxzq.net

(33)东吴证券

联系地址：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

客户服务电话：0512-96288

公司网址：www.dwjq.com.cn

(34)信达证券

联系地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

客户服务电话：4008008899

公司网址：www.cindasc.com

(35)东方证券

联系地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼

客户服务电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

(36)长城证券

联系地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

客户服务电话：4006666888

公司网址：www.cc168.com

(37)光大证券

联系地址：上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 16 楼

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(38)广州证券

联系地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

客户服务电话：961303

公司网址：www.gzs.com.cn

(39)国联证券

联系地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层

客户服务电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn

(40)浙商证券

联系地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座

客户服务电话：0571-87901963

公司网址：www.stocke.com.cn

(41)平安证券

联系地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦

客户服务电话：95511

公司网址：www.stock.pingan.com

(42)国海证券

联系地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

客户服务电话：400888100、95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(43)国都证券

联系地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层（100007）

客户服务电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(44)东海证券

联系地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

客户服务电话：95531、400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

(45)国盛证券

联系地址：江西省南昌市永叔路 15 号

客户服务电话：400-822-2111

公司网址：www.gsstock.com

(46)华西证券

联系地址：四川省成都市陕西街 239 号

客户服务电话：4008888818

公司网址：www.hx168.com.cn

(47)申万宏源西部证券有限公司

客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(48)中泰证券

联系地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(49)世纪证券

联系地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40/42 层

客户服务电话：0755-83199511

公司网址：www.csc.com.cn

(50)第一创业证券

联系地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

客户服务电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

(51)金元证券

联系地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

客户服务电话：4008888228

公司网址：www.jyzq.com.cn

(52)中航证券

联系地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

客户服务电话：400-8866-567

公司网址：www.scstock.com

(53)华福证券

联系地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

客户服务电话：0591-96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

(54)中金公司

联系地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

客户服务电话：010-65051166

公司网址：www.cicc.com.cn

(55)五矿证券

联系地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心大厦 47-49 层

客户服务电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(56)中投证券

联系地址：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-21 层

客户服务电话：4006008008、95532

公司网址：www.china-invs.cn

(57)九州证券

联系地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 D 座 5 层

客户服务电话：400-654-3218

公司网址: www.jzsec.com

(58)厦门证券

联系地址: 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

客户服务电话: 0592-5161816

公司网址: www.xmzq.cn

(59)英大证券

联系地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十层

客户服务电话: 400-018-8688

公司网址: www.ydsc.com.cn

(60)天相投顾

联系地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

客户服务电话: 010-66045678

公司网址: www.txsec.com

(61)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

联系地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

客户服务电话: 400-166-1188

公司网址: wen.wen@jrj.com.cn

(62)和讯信息科技有限公司

联系地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

客户服务电话: 400-920-0022

公司网址: www.hexun.com

(63)上海长量基金

联系地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

客户服务电话: 400-089-1289

公司网址: www.erichfund.com.cn

(64)深圳众禄基金

联系地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层

客户服务电话: 4006788887

公司网址: www.jjmmw.com

(65)上海天天基金

联系地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

客户服务电话: 4001818188

公司网址: www.1234567.com.cn

(66)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

联系地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

客户服务电话: 4000766123

公司网址: www.fund123.cn

(67)上海好买基金

联系地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

客户服务电话: 4007009665

公司网址: www.ehowbuy.com

(68)中期时代基金(北京)

联系地址: 北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

客户服务电话: 95162

公司网址：www.cifcofund.com

(69)众升财富（北京）基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

客户联系电话：400-059-8888

公司网址：www.wy-fund.com

(70)上海汇付金融服务有限公司

联系地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

客户服务电话：400-820-2819

公司网址：tty.chinapnr.com

(71)唐鼎耀华

联系地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

客户服务电话：400-819-9868

公司网址：www.tdyhfund.com

(72)上海基煜基金销售有限公司

联系地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

客户服务电话：021-65370077

公司网址：www.jiyu.com.cn

(73)（上海陆金所资产管理有限公司

联系地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

客户服务电话：4008-219-031

公司网址：www.lufunds.com

(74)浙江同花顺基金销售有限公司

联系地址：杭州市文二西路一号 903 室

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(75)珠海盈米财富管理有限公司

联系地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(76)北京汇成基金销售有限公司

联系地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

客户服务电话：4006-199-059

公司网站：www.fundzone.cn

(77)大泰金石投资管理有限公司

联系地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

客户服务电话：400-928-2266

公司网站：www.dtfunds.com

(78)上海凯石财富基金销售有限公司

联系地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

客服电话：4006-433-389

公司网址：www.lingxianfund.com

(79)上海利得基金销售有限公司

联系地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

客户服务电话：400-067-6266

公司网址: www.leadfund.com.cn

(80)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

联系地址: 上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋

客户服务电话: 400-821-5399

公司网址: www.noah-fund.com

(81)北京格上富信投资顾问有限公司

联系地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

客户服务电话: 400-066-8586

公司网址: www.igesafe.com

(82)浙江金观诚财富管理有限公司

办公地址: 杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

客户服务电话: 400-068-0058

网址: www.jincheng-fund.com

(83)和耕传承基金销售有限公司

办公地址: 郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层

客户服务电话: 400-555-671

网址: www.hgccpb.com

(84)北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

客户服务电话: 010-62675369

网址: www.xincai.com

(85)上海万得投资顾问有限公司

办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼

客户服务电话: 400-821-0203

(86)深圳富济财富管理有限公司

办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

客户服务电话: 0755-83999907

公司网址: www.jinqianwo.cn

(87)上海联泰资产管理有限公司

办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

客户服务电话: 021-52822063

网址: www.66zichan.com

(88)天津国美基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

客户服务电话: 400-111-0889

网址: www.gomefund.com

(89)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

办公地址: 北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

客户服务电话: 400-890-9998

网址: www.jnlc.com

(90)凤凰金信(银川)投资管理有限公司

办公地址: 北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼

客户服务电话: 400-810-5919

网址：www.fengfd.com

(91)北京乐融多源投资咨询有限公司

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

客户服务电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

(92)杭州科地瑞富基金销售有限公司

办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼

客户服务电话：0571-86655920

网址：www.cd121.com

(93)上海中正达广投资管理有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

客户服务电话：400-6767-523

网址：www.zzwealth.cn

(94)深圳市金斧子投资咨询有限公司

办公地址：深圳市南山区科苑路科兴科学园B3单元7楼

客户服务电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

(95)奕丰金融服务（深圳）有限公司有限公司

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115-1116室

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

(96)深圳新华信通资产管理有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦1808单元

网址：www.xintongfund.com

(97)北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

客户服务电话：4000-618-518

网址：danjuanapp.com

(98)上海挖财金融信息服务有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

客户服务电话：400-711-8718

网址：www.wacaijijin.com/contact

（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：李文众

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：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

经办律师：廖海、刘佳

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：薛竞、周祎

联系人：周祎

四、基金的名称

本基金名称：宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，为基金投资人谋求长期资本增值收益。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证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，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于符合收益型条件的上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；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%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

八、基金的投资策略

本基金主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益：

（一）战略资产配置策略

基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标，对不同市场的风险收益状况做出判断，据此调整股票、债券和现金等大类资产的配置比例。主要考虑的因素包括：

- 1、宏观经济指标：年度/季度 GDP 增速、固定资产投资总量、消费价格指数、采购经理人指数、进出口数据、工业用电量、客运量及货运量等；
- 2、政策因素：税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策，利率水平、货币净投放等货币政策；

3、市场指标：市场整体估值水平、市场资金的供需以及市场的参与情绪等因素。

（二）股票投资策略

1、行业资产配置策略。首先由行业分析师估计各行业未来的期望增长速度，以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整，寻找总体投资价值被相对低估的行业。根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标，结合经济发展不同阶段对不同行业的影响，决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。

2、公司选择策略。本基金对上市公司投资价值的判断，主要依赖于两方面的基础工作：一是从行业发展趋势、公司核心竞争优势、公司运营管理效率的角度对公司进行定性分析，二是通过选择适当的估值模型对公司的投资价值进行定量测算。在筛选过程中，更强调公司长期（3-5年）的发展和竞争优势、稳定成长的市场、可持续的主营业务利润、良好的现金流和满意的红利分配政策。在对行业内上市公司进行合理排序的基础上，重点投资于位于行业前列的收益型上市公司，排序所依据的主要指标为红利收益率和增长率调整后的市盈率。本基金所定义收益型上市公司需符合以下条件：

（1）稳定收益型公司。稳定收益型公司指主营业务收入稳定增长，在行业内有一定的竞争优势，现金流与主营业务收入同步增长，有满意的红利分配政策的上市公司。本基金选择稳定收益型公司的主要指标包括：红利收益率、主营业务利润率、每股经营性现金流、主营业务利润贡献率、资产负债率。基金管理人对上述5项指标进行加权评分，选择排序靠前的公司。

（2）价值相对低估型公司。资本市场上，不同的公司有不同的市盈率，公司之间市盈率差别的两个根本原因是市场对其预期的增长率和风险的差别，因此，不同公司的市盈率不具有直接的可比性。为此，本基金引入市盈率调整系数（PEAF），对公司市盈率进行增长率和风险调整，计算增长率及风险调整后市盈率（PEAG）。经过调整后，同行业不同公司的市盈率就可以直接比较，从而可以对公司相对投资价值进行排序，寻找价值被相对低估的公司股票。

具体计算方式如下：

市盈率调整系数（PEAF）：

增长率调整后市盈率（PEAG）：

其中， E_i 表示上市公司第*i*年盈利增长率的期望值， r 表示与增长率风险对应的期望收益率。

本基金主要通过以下方法对上市公司的期望增长率进行估计和调整：

（1）在对公司经营状况和历史财务数据深入了解的基础上，区分不同的公司类型（成长型、成熟型、衰退型、周期型等），采用定性分析、因果分析、时间序列等方法，结合对未来融资结构分析，预测公司未来3到5年的每股利润增长率；

（2）以上市公司公开信息披露（招股说明书、配股或增发说明书、年报、中报、业绩预测等）中预计的增长率为基础，根据历史上预测数据与实现数据的差异进行调整；

（3）留存收益比率与净资产利润率的乘积计算理论的收益增长率，根据历史实现的增长率与理论增长率的差异进行调整；

（4）收集跟踪该上市公司证券分析师对公司增长率的预测值，根据不同分析师的经验、历史业绩等分配不同权重，得出外部分分析师对公司增长率预测的期望值。

本基金综合考虑以上对增长率的预测值，估计公司的期望增长率、乐观预测和悲观预测的波动范围，从而确定及风险调整因子 r 。以上任何预测值发生变化时，本基金将及时对进行调整。

（三）固定收益类资产投资策略

在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

1、利率预期策略

通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

2、信用债券投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。

3、套利交易策略

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。

4、可转换债券投资策略

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。

5、资产支持证券投资策略

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。

6、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券具有二级市场流动性差、信用风险高、票面利率高的特点。本基金将综合运用个券信用分析、收益率预期、收益率利差、收益率曲线变动、相对价值评估等策略，结合中小企业私募债券对基金资产流动性影响的分析，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别关注中小企业私募债券的信用风险分析。通过对宏观经济进行研判，根据经济周期的景气程度，合理增加或减少中小企业私募债券的整体配置比例，降低宏观经济系统性风险。本基金同时通过对发行主体所处行业、发行主体自身经营状况以及债券增信措施的分析，选择风险调整后收益最具优势的个券，保证本金安全并获得长期稳定收益。

本基金同时关注中小企业私募债券的流动性风险。在投资决策中，根据基金资产现有持仓结构、资产负债结构、基金申赎安排等，充分评估中小企业私募债券对基金资产流动性的影响，并通过分散投资等措施，提高中小企业私募债券的流动性。

（四）权证投资策略

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具：

- 1、运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能，构建权证与标的股票的组合，主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益；
- 2、构建权证与债券的组合，利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性，形成保本投资组合；
- 3、针对不同的市场环境，构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合，形成多元化的盈利模式；
- 4、在严格风险监控的前提下，通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究，谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 65%+中债综合指数收益率（全价） 35%

沪深 300 指数选样科学客观，流动性高，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%95%的股票投资，其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为 65%和 35%，并用中债综合指数收益率（全价）代表债券资产收益率。因此，沪深 300 指数收益率 65%+中债综合指数收益率（全价） 35%是衡量本基金投资业绩的理想基准。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

十一、基金投资组合报告（截至 2017 年 9 月 30 日）

（1）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 332,614,653.76 85.06

其中：股票 332,614,653.76 85.06

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 57,488,704.63 14.70

8 其他资产 934,358.51 0.24

9 合计 391,037,716.90 100.00

(2) 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 采矿业 39,793.60 0.01

C 制造业 271,499,043.67 70.70

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 31,093.44 0.01

E 建筑业 --

F 批发和零售业 26,380.90 0.01

G 交通运输、仓储和邮政业 25,571.91 0.01

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 32,458,645.03 8.45

J 金融业 28,295,500.00 7.37

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 79,324.72 0.02

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 --

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 115,299.99 0.03

R 文化、体育和娱乐业 44,000.50 0.01

S 综合 --

合计 332,614,653.76 86.62

(3) 基金投资前十名股票明细

序号 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 002833 弘亚数控 547,486 35,422,344.20 9.22

2 603197 保隆科技 494,956 26,712,775.32 6.96

3 000063 中兴通讯 880,000 24,904,000.00 6.49

4 300567 精测电子 234,993 24,836,410.17 6.47

5 603111 康尼机电 1,320,000 19,588,800.00 5.10

6 603556 海兴电力 417,800 17,564,312.00 4.57

7 300308 中际旭创 325,000 15,791,750.00 4.11

8 600030 中信证券 850,000 15,461,500.00 4.03

9 002624 完美世界 465,000 15,233,400.00 3.97

10 600999 招商证券 600,000 12,834,000.00 3.34

(4) 按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(5) 基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

(6) 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(7) 本基金本报告期末未持有贵金属。

(8) 本基金本报告期末未持有权证。

(9) 本基金本报告期末未投资股指期货。

(10) 本基金本报告期末未投资国债期货。

(11) 投资组合报告附注。

1、报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中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。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 286,778.29

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 13,623.46

5 应收申购款 633,956.76

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 934,358.51

4、本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本基金本报告期末前十名股票中流通受限情况说明。

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 603111 康尼机电 19,588,800.00 5.10 重大事项

6、由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

本基金基金合同生效日为2002年10月8日，基金合同生效以来完整会计年度的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：（截至2017年9月30日）

阶段 净值增长率 净值增长标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2002年 -5.27% 0.53% -11.75% 0.99% 6.49% -0.46%

2003年 14.58% 0.66% -2.63% 0.87% 17.21% -0.21%

2004年 -6.37% 1.00% -13.78% 1.08% 7.41% 0.08%

2005年 -4.79% 0.95% -6.69% 1.14% 1.90% -0.19%

2006年 142.93% 1.37% 83.28% 1.12% 59.65% 0.25%

2007年 93.91% 1.76% 122.35% 1.81% -28.44% -0.05%

2008年 -47.47% 1.65% -53.33% 2.42% 5.86% -0.77%

2009年 9.37% 1.25% 80.19% 1.63% -70.82% -0.38%
2010年 1.11% 1.16% -1.70% 1.25% 2.81% -0.09%
2011年 -20.94% 1.12% -22.38% 1.07% 1.44% 0.05%
2012年 6.07% 1.08% 5.39% 1.06% 0.68% 0.02%
2013年 11.06% 1.03% 3.11% 1.07% 7.95% -0.04%
2014年 53.89% 1.05% 38.54% 0.89% 15.35% 0.16%
2015年 34.56% 2.67% 14.90% 1.78% 19.66% 0.89%
2016年 -23.38% 1.73% -7.51% 0.91% -15.87% 0.82%
2017年
上半年 3.70% 0.95% 6.13% 0.38% -2.43% 0.57%
2017年
三季度 12.26% 1.04% 2.96% 0.38% 9.30% 0.66%

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的相关账户的开户及维护费用；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 基金的银行汇划费用；
- (9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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划付指令，经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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划付指令，经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述一、基金费用的种类中第3—9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金

额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- (1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- (2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- (3) 《基金合同》生效前的相关费用；
- (4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

5、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

费用类别 费率（设申购金额为 M）

申购费 M < 100 万 1.50%

100 万 ≤ M < 500 万 1.20%

500 万 ≤ M < 1000 万 0.60%

M ≥ 1000 万 固定费用 1000 元

费用类别 费率（设申购金额为 M）

申购费 M < 100 万 1.50%

100 万 ≤ M < 500 万 1.20%

500 万 ≤ M < 1000 万 0.60%

M ≥ 1000 万 固定费用 1000 元

本基金的申购费用由投资人承担，在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人网上交易平台详细费率标准及费率标准调整，请查阅网上交易平台及相关公告。

3、赎回费

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

赎回费根据持有人持有基金的期限递减，最高不超过赎回总额的 0.25%，作为注册登记费。费率表如下：

费用 费率

赎回费 持有期限 < 7 日 1.50% 全额计入基金资产

7 日 ≤ 持有期限 < 30 日 0.75%

30日≤持有期限<90日 0.50% 75%计入基金资产
90日≤持有期限<180日 0.50% 50%计入基金资产
180日≤持有期限<365日 0.20% 25%计入基金资产
365日≤持有期限<730日 0.10%
持有期限≥730日 0% 25%计入基金资产

在持有期内持有人多次申购基金的，赎回时按照先进先出的原则计算。

4、转换费

基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下部分基金在直销机构和部分代销机构的基金转换业务，具体内容详见本公司网站发布的有关本基金与其他基金的转换公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在重要提示部分，更新了本招募说明书所载内容和相关财务数据的截止时间。
- 2、在第三部分基金管理人部分，更新了基金管理人概况、证券投资基金管理情况和主要人员情况的相应内容。
- 3、在第四部分基金托管人部分，更新了基金托管人的相应内容。
- 4、在第五部分相关服务机构部分，更新了直销机构、代销机构的相应内容。
- 5、在第九部分基金的投资部分，更新了本基金投资组合报告的内容。
- 6、在第十一部分基金的业绩部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 7、在第二十二部分其他应披露事项部分，披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司

二〇一七年十一月二十一日