

宝盈资源优选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈资源优选混合型证券投资基金由鸿飞证券投资基金转型而成。依据中国证监会 2008 年 3 月 31 日证监许可[2008]392 号文核准的鸿飞证券投资基金基金份额持有人大会决议，鸿飞证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为宝盈资源优选股票型证券投资基金。自 2008 年 4 月 15 日起，由《鸿飞证券投资基金基金合同》修订而成的《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》生效。

根据 2014 年 8 月 8 日正式实施的证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金管理人于 2015 年 8 月 5 日发布《关于宝盈资源优选股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》，将本基金类型变更为混合型证券投资基金，基金名称变更为宝盈资源优选混合型证券投资基金，对应基金简称变更为宝盈资源优选混合。

重要提示

基金管理人保证本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募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

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 15 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日。基金托管人中国建设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

名称：宝盈基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第 15 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

法定代表人：李文众

总经理：张啸川

组织形式：有限责任公司

成立时间：2001 年 5 月 18 日

注册资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：(0755) 83276688

传真：(0755) 83515599

联系人：张志刚

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总部任项目经理；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

易祚兴先生，浙江大学计算机科学与技术硕士。曾任浙江天堂硅谷资管集团产业整合部投资经理，中国中投证券资产管理部投资经理、研究员。自2014年11月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混

合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金和宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理助理，现任宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金和宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理。

肖肖先生，北京大学金融学硕士。2008年7月至2015年2月先后在联合证券有限责任公司、民生证券有限责任公司和方正证券股份有限公司担任研究员，自2015年2月加入宝盈基金管理有限公司研究部，担任研究员。现任宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理。

宝盈资源优选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：

彭敢，2010年11月5日至2017年1月26日；

杨宏亮，2009年5月25日至2010年11月5日；

欧阳东华，2008年4月15日至2009年6月19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。

陈若劭女士（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：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。

本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016 中国最佳银行，《环球金融》2016 中国最佳消费者银行、2016 亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016 年世界银行 1000 强排名中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珏，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持以客户为中心的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》中国最佳托管银行、中国最佳次托管银行、最佳托管专家 QFII 等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家最佳托管银行。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内

控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的新一代托管应用监督子系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

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：0755-83275807、0755-83275129

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.drcbank.com

(13)郑州银行

联系地址：郑州市郑东新区商务外环 22 号郑银大厦

客户联系电话：4000967585

公司网址：www.zzbank.cn

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)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

(32)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

(33)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

(34)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

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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：4008888100、95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(44)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

(45)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

(46)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

(47)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

(48)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

(49)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

(50)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

(51)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

(52)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

(53)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

(54)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

(55)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

(56)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

(57)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

(58)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

(59)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

(60)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

(61)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

(62)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

(63)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

(64)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

(65)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

(66)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

(67)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

(68)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

(69)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

(70)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

(71)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

(72)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

(73)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

(74)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

(75)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

(76)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

(77)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

(78)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

(79)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

(80)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

(81)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

(82)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

(83)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

(84)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

(85)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

(86)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

(87)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

(88)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

(89)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

(90)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

(91)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

(92)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

(93)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

(94)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

(95)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

(96)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

(97)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

(98)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

(99)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
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：宝盈资源优选混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式混合型基金

六、基金的投资目标

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，处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值，相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型，优选各个行业中具有资源优势的上市公司，建立股票池。在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。

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、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，在履行适当程序后，基金管理人可相应调整本基金的投资比例规定。

基金的投资组合比例为：股票投资的比例范围为基金资产的 60%—95%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0—40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有资源优势的股票。

八、基金的投资策略

本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合，并注重资产在各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用自上而下进行资产配置和行业配置、自下而上精选个股的积极投资策略。

（1）资产配置策略

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。

1) 宏观经济环境

本基金分析宏观经济运行状况主要参考以下指标：

季度 GDP 及其增长速度；

月度工业增加值及其增长率；

月度固定资产投资完成情况及其增长速度；

月度社会消费品零售总额及其增长速度；

月度居民消费价格指数、工业品价格指数以及主要行业价格指数；

月度进出口数据以及外汇储备等数据；

货币供应量 M0、M1、M2 的增长率以及贷款增速。

2) 政策环境

主要指国家财政政策、货币政策、产业政策及证券市场监管政策。

3) 市场资金环境

本基金主要参考以下指标分析判断市场资金环境：

居民储蓄进行证券投资的增量；

货币市场利率；

基金新增投资规模；

券商自营规模变动额；

QFII 新增投资额；

新股扩容；

增发、配股所需资金；

可转债所需资金；

印花税和佣金；

其他投资资金变动额等。

(2) 股票配置策略

本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。

在个股选择层面，本基金以净资产收益率、预期 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。

1) 形成投资股票备选库

根据上市公司资源的类别、数量、与主营业务的密切程度判断公司是否属于资源类公司，所有资源类公司形成资源类基础股票备选库；

对基础股票备选库中的所有股票，综合考虑净资产收益率、预期 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选出股票构成投资股票备选库；投资股票备选库每年在 4 月 30 日上市公司年度报告出齐后整体调整一次，日常则可根据股票价格变动情况进行微调。

预期 PEG 值的计算公式如下：

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，为根据上市公司历史财务数据、实地调研、财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务利润增长率。

对于每年 5 月至下一年度 4 月上市的新股，本基金将其作为一个特殊资产分类，由基金管理人根据公司基本面及具体市场情况决定投资。

2) 建立各类股票池

由基金管理人的研究人员对投资备选股票库中的股票进行基本面价值评估，通过公司股票池的构建程序，形成各类股票池，构建最终股票组合。

股票池的构建程序

图 1 股票池构建流程图

如图 1，首先根据对资源类上市公司的评级建立公司评级库。各行业研究员按影响其相关行业上市公司投资价值和投资风险的主要因素，就行业、核心竞争力、公司成长性、投资风险、市场估值这五个方面，分别制定进一步细化的定性和定量分析指标，形成分行业的《上市公司投资评级指标体系》。以此作为各行业股票进行投资评级管理的依据，并进而精选出具备持续增长或阶段性高速增长能力、且价值被低估的优势企业形成公司的股票池。如研究员要调整股票的投资评级，须及时提交股票投资评级调整报告，投资评级调整报告需附上《上市公司投资评级表》，并就调整的原因做出说明。各行业研究员应将其所负责行业的《上市公司投资评级指标体系》及其每次重大调整报研究部总监备案。

在公司评级库的基础上，通过进行全面深入的研究分析，经有投资部、研究部共同参加的投资研究联席会议集中讨论，就股票的基本面、业绩与成长性、内在价值与潜在风险进行严格的答辩，拟定公司备选股票池。备选股票池名单须经投资决策委员会审批同意后方可执行。对进入备选股票池的股票，行业研究员必须确保定期跟踪和维护。定期跟踪的内容包括：至少每半年一次对公司进行深度调研并提交调研简报；每季度、每半年、每年提交相应的季报、中报、年报点评。

在备选股票池的基础上，经过严格的答辩产生核心股票池，对进入核心股票池名单的上市公司要求研究员必须定期提交实地调研的深度研究报告。核心股票池名单须经投资决策委员会审批同意后方可执行。

为了更好的控制风险，对于已经进入备选股票池、核心股票池并且纳入基金投资组合的个股，由于已经接近、达到预期估值上限或者基于行业集中度等因素的考虑，投资决策委员会又在备选股票池和核心股票池的基础上设立限制股票池。

本基金管理人投资决策委员会规定，基金的投资组合只能从备选股票池和核心股票池中产生，并制定了相应的投资权限限制。

（3）债券及短期金融工具投资策略

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。

1) 利率预期策略下的债券选择

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益，例如预期利率下调时适当加大长久期债券的投资比例，为债券组合赢得价格收益；预期利率上升时减少长久期债券的投资，降低基金债券组合的久期，以控制利率风险。

2) 收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。基金管理人通过预测收益率曲线形状的

变化，调整长久期债券组合内部品种的比例获得投资收益。

3) 信用度分析

信用度分析是企业债的投资策略。基金管理人通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行更细致的调研，准确评价债券的违约概率和提早预测债券评级的改变，从而取得价格优势或进行套利。

4) 收益率利差分析

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。

5) 相对价值评估

基金管理人运用该种策略的目的在于识别被市场错误定价的债券，并采取适当的交易以期获利。一方面基金管理人通过利率期限结构，评估处于同一风险层次的多只债券中，究竟哪些更具投资价值，另一方面，通过综合考察债券等级、息票率、所属行业、可赎回条款等因素对率差的影响，评估风险溢价。

4) 权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

5、投资决策程序及依据

图 2 公司投资决策流程图

1. 决策依据

- (1) 国内国际宏观经济环境；
- (2) 国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策；
- (3) 证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况；
- (4) 上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势；
- (5) 上市公司盈利能力、增长能力和创新能力，以及对公司综合价值的评估结论；
- (6) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2. 决策程序

- (1) 投资决策委员会制定整体投资战略；
- (2) 研究部根据自身或者其他研究机构的研究成果，构建各级股票池，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持；
- (3) 投资部根据投资决策委员会的投资战略，在研究支持下，结合对证券市场、上市公司、投资时机的

分析，拟定基金的具体投资计划，包括：资产配置、策略配置、行业配置、重仓个股投资方案；

(4) 投资决策委员会对投资部各基金提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；

(5) 金融工程部定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

3. 投资操作程序

(1) 在确定基金投资组合方案后，基金经理在投资组合方案和授权范围内，进行具体买卖决策，并向集中交易部下达统一规范、标准化的交易指令，实现证券品种的日常买卖；

(2) 基金经理可以采用书面方式、电脑方式或电话录音方式下达委托交易指令，并采用书面方式或电子化方式记录，存档备案；基金经理不可以直接进行证券品种的交易；

(3) 集中交易部的集中接单员接到基金经理的交易指令后，对其是否符合基金经理的权限和公司投资限制性指标进行审核；如符合，则分发到交易员执行，如不符合，则拒绝执行，并向风险控制执行官汇报审核；

(4) 交易员执行经审核的交易指令，并将执行结果反馈基金经理；基金经理根据市场情况可以对投资指令进行调整；

(5) 本基金管理人根据有关法律、法规、监管机构要求和公司内部管理制度，制定了一系列投资限制性指标，这些指标通过参数设置到投资管理系统，如果买卖指令与指标冲突，系统自动拒绝执行。

3. 投资组合分析与调整

公司投资组合调整过程如图 3。

图 3 投资组合调整过程图

投资决策委员会成员、基金经理和研究员根据宏观经济及投资策略，如果发现资产配置比例需要调整，可以提议召开投资决策委员会；

投资决策委员会集体决策是否调整资产配置比例；

如果投资决策委员会不调整资产配置比例，基金经理只能在原来规定的资产配置比例内根据强度指标考虑是否调整投资组合；如果投资决策委员会调整资产配置比例，基金经理根据调整后的比例考虑调整投资组合；

行业研究员跟踪行业和个股因素，对已有的投资组合和股票池中股票进行动态评级，提出投资建议；基金经理对投资组合进行跟踪，参考研究员的投资建议，作出投资组合调整策略；

监察稽核部对投资组合调整的合规性和组合调整是否严格执行相应的流程进行实时监控。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

沪深 300 指数 75%+上证国债指数 25%

沪深 300 指数由市值规模大、流动性强和良好基本面的 300 家上市公司作为样本股，上证国债指数涵盖所有在上海证券交易所上市的国债，具有良好的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，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）

(一) 本报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 2,532,821,154.41 88.55

其中：股票 2,532,821,154.41 88.55

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 324,905,187.42 11.36

8 其他资产 2,713,752.00 0.09

9 合计 2,860,440,093.83 100.00

(二) 本报告期末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	77,995,060.00	2.76
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	1,880,246,537.60	66.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	44,937,820.41	1.59
F	批发和零售业	61,037,903.32	2.16
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,411,178.10	3.17
J	金融业	297,105,833.51	10.53
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.00
M	科学研究和技术服务业	43,651.27	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	45,501,000.00	1.61
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	0.00
R	文化、体育和娱乐业	36,251,086.54	1.28
S	综合	--	--
	合计	2,532,821,154.41	89.76

(三) 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

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	000333	美的集团	3,142,100	138,849,399.00	4.92
2	601318	中国平安	2,470,199	133,785,977.84	4.74
3	601952	苏垦农发	8,799,974	129,623,617.02	4.59

4	600872	中炬高新	5,473,276	129,333,511.88	4.58
5	000568	泸州老窖	2,299,992	129,029,551.20	4.57
6	002456	欧菲光	5,799,991	122,901,809.29	4.36
7	600219	南山铝业	24,000,000	95,760,000.00	3.39
8	600196	复星医药	2,799,929	95,729,572.51	3.39
9	000807	云铝股份	6,710,000	93,067,700.00	3.30
10	002466	天齐锂业	1,199,971	84,345,961.59	2.99

(四) 本报告期内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。

(五) 报告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。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八) 报告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。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本基金投资国债期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,469,082.41

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 70,639.13

5 应收申购款 1,174,030.46

6 其他应收款 -

- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 2,713,752.00

4、报告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。

5、报告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。

6、其他需说明的重要事项

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 2008 年 4 月 15 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:(截至 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
2008 年	-33.52%	2.49%	-37.22%	2.28%
2009 年	77.53%	1.56%	68.15%	1.54%
2010 年	-3.81%	1.60%	-8.29%	1.19%
2011 年	-17.23%	1.38%	-18.30%	0.97%
2012 年	6.07%	1.48%	6.88%	0.96%
2013 年	36.14%	1.53%	-4.73%	1.04%
2014 年	50.31%	1.25%	38.62%	0.91%
2015 年	51.97%	3.27%	7.23%	1.86%
2016 年	-20.98%	2.00%	-7.40%	1.05%
2017 年上半年	-14.74%	1.02%	8.12%	0.43%
2017 年三季度	-4.67%	0.77%	3.52%	0.44%

十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关费用

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) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；

(8) 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

- (9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

(3) 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

6、基金税收

基金和基金份额持有人根据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

前端：

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

后端：

申购份额 = 申购金额 / T 日基金份额净值

申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额采用四舍五入的方法保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

前端：

申购费率（前端） 金额 费率

$M < 100$ 万元 1.5%

100 万元 $\leq M < 500$ 万元 0.9%

500 万元 $\leq M < 1000$ 万元 0.3%

$M \geq 1000$ 万元 固定费用 1000 元

后端：

申购费率（后端） 持有时间 费率

1 年以内（含） 1.8%

1年2年(含) 1.0%

2年3年(含) 0.6%

3年以上 0

3.赎回费

前端:

赎回总金额=赎回份额T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

后端:

赎回总金额=赎回份数T日基金份额净值

后端申购费用=赎回份额申购日基金份额净值对应的后端申购费率

赎回费用=赎回总金额赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-后端申购费用-赎回费用

费率表如下:

赎回费率 持有时间 费率

1年以内(含) 0.50%

1年2年(含) 0.25%

2年以上 0

本基金赎回费的25%归入基金财产所有。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。

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,具体内容详见基金管理人发布的有关基金转换公告。

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》、《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,更新本招募说明书所载内容和相关财务数据的截止时间。
- 2、在三、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中,更新了基金托管人的相应内容。
- 4、在五、相关服务机构部分,更新了代销机构的相应内容。
- 5、在十一、基金的投资部分,更新了基金投资组合报告的内容。
- 6、在十二、基金的业绩部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 7、在二十四、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

二〇一七年十一月二十五日