

# 宝盈基金管理有限公司关于宝盈祥泰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告

根据《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》和《宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，现将宝盈基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下宝盈祥泰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会的决议及相关事项公告如下：

## 一、本次基金持有人大会会议情况

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《关于修改宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”），并由参加大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。大会投票表决时间为2019年12月13日至2020年1月13日15:00。2020年1月14日，在本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司授权代表的监督及上海市通力律师事务所的见证下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。

本次基金份额持有人大会的权益登记日为2019年12月12日，权益登记日本基金总份额为265,585,125.20份，参加本次基金份额持有人大会表决并出具有效书面表决意见的基金份额持有人或代理人所代表的基金份额为243,868,141.25份，占权益登记日基金总份额的91.82%，符合《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》和《宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同》有关持有人大会（通讯方式）的召开条件。

本次基金份额持有人大会的表决结果为：同意票所代表的基金份额为243,868,141.25份，占出具有效书面表决意见的基金份额持有人或代理人所代表的基金份额总数的100%；反对票所代表的基金份额为0份，占出具有效书面表决意见的基金份额持有人或代理人所代表的基金份额总数的0%；弃权票所代表的基金份额为0份，占出具有效书面表决意见的基金份额持有人或代理人所代表的基金份额总数的0%。同意本次会议议案的基金份额占出具有效书面表决意见的基金份额持有人或代理人所代表的基金份额总数的100%，超过参加本次会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一，满足法定生效条件，符合《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》和《宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本次会议议案有效通过。

本次基金份额持有人大会费用包括公证费10,000元，律师费40,000元，合计50,000元，由基金资产承担；其他费用由本基金管理人承担。

## 二、宝盈祥泰混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本基金基金份额持有人大会于2020年1月14日表决通过了《关于修改宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

基金管理人将自表决通过之日起5日内将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

## 三、基金份额持有人大会决议相关事项的实施情况

### 1、关于宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同等法律文件的修订

根据《关于修改宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已对《宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）和《宝盈祥泰混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“托管协议”）涉及的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金份额净值精度等内容进行修改，并根据中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改相关表述。宝盈祥泰混合型证券投资基金的主要变更内容如下：

#### (1)变更基金的投资目标

删除投资目标中的“养老”两字，优化表述。

修改前“投资目标”的相关表述 修改后“投资目标”的相关表述

在严格控制下行风险的前提下，追求稳定的投资回报，为投资人提供稳健的养老理财工具。

在严格控制下行风险的前提下，追求稳定的投资回报，为投资人提供稳健的理财工具。

## (2) 变更基金的投资范围

投资范围中增加国债期货，删除中小企业私募债、权证。投资策略、投资限制、基金估值、信息披露的相关内容也一并修改。

修改前“投资范围”的相关表述 修改后“投资范围”的相关表述

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、股指期货、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。

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（包含主板、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、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、股指期货、国债期货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。

## (3) 变更基金的投资策略

1) 删除投资策略中基金份额净值与仓位挂钩的控制策略。

2) 鉴于投资范围中删除中小企业私募债、权证并增加国债期货，投资策略中相应删除中小企业私募债券投资策略和权证投资策略，补充国债期货投资策略。

修改前“投资策略”的相关表述

修改后“投资策略”的相关表述

述

### 2、股票资产的仓位控制

为控制下行风险，本基金将以会计年度作为仓位控制策略的执行周期、以基金份额净值作为基准，确定股票资产的投资仓位上限。具体而言，本基金以上一会计年度末的A类基金份额净值作为基准（《基金合同》生效日所在年度基准为基金份额发售面值）设置仓位调整阈值，当A类基金份额净值与本会计年度A类基金份额单位累计分红金额之和连续5个交易日达到仓位调整阈值，则触发仓位调整基准。本基金应根据对未来市场的判断，在合理期限内将股票仓位调整至规定范围内。股票资产的仓位调整阈值和对应的股票仓位上限如下表所示：

注：NAV0为上一会计年度年末A类基金份额净值（《基金合同》生效日所在年度，NAV0为基金份额发售面值），NAV1为当前A类基金份额净值，D为本会计年度A类基

金份额单位累计分红金额（基金除权日在本会计年度的累计分红金额）。

.....

## 6、中小企业私募债券的投资策略

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。

.....

## 1、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。

## 2、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低

投资组合的整体风险的目的。

#### (4)变更基金份额净值精度

基金份额净值精度由 3 位调整为 4 位。基金合同中涉及基金份额净值精度的表述一并修改。

修改前“基金资产估值”的相关表述 修改后“基金资产估值”的相关表述

各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

#### (5) 调整业绩比较基准

业绩比较基准由“一年期银行定期存款利率（税后）+1%”修改为“中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%”。

修改前“业绩比较基准”的相关表述 修改后“业绩比较基准”的相关表述

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+1%。

上述“一年期银行定期存款利率（税后）”是指当年 1 月 1 日中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。《基金合同》生效日所在年度以《基金合同》生效日中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”为准。

本基金采用上述业绩比较基准的理由是：本基金追求长期稳定投资回报，上述业绩比较基准能够较好地体现本基金的投资目标，并易于被投资者理解和接受。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券由沪深交易所和银行间市场上市、信用评级投资级以上、剩余期限 1 年以上的国债、金融债及信用债组成。沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两市指数，该指数编制合理、透明，有一定的市场覆盖、抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。本基金的业绩比较基准能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

(6)根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同、托管协议相应内容。

2、自本次基金份额持有人大会决议生效日即 2020 年 1 月 14 日起，本基金开始执行修改后的《宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同》。

#### 四、备查文件

1、《宝盈基金管理有限公司关于以通讯方式召开宝盈祥泰混合型证券投资基金基金份额持有人大会

审议基金合同修改事项的公告》；

2、《宝盈基金管理有限公司关于以通讯方式召开宝盈祥泰混合型证券投资基金基金份额持有人大会审议基金合同修改事项的第一次提示性公告》；

3、《宝盈基金管理有限公司关于以通讯方式召开宝盈祥泰混合型证券投资基金基金份额持有人大会审议基金合同修改事项的第二次提示性公告》；

4、上海市通力律师事务所出具的法律意见书；

5、深圳市深圳公证处出具的公证书。

特此公告。

宝盈基金管理有限公司

2020年1月15日

附件：深圳市深圳公证处出具的公证书