

# 宝盈祥泰混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈祥泰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2015 年 5 月 11 日中国证监会证监许可[2015]864 号《关于核准宝盈祥泰混合型证券投资基金募集的批复》批准公开发售。本基金基金合同于 2015 年 5 月 29 日正式生效。

## 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。本基金资产投资于科创板股票，将面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、退市风险、流动性风险、投资集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明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。基金投资人欲了解份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

本基金本次更新招募说明书对基金合同变更的相关信息进行更新，基金合同变更相关信息截止日为 2020 年 1 月 14 日。本招募说明书有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 9 月 30 日，其他所载内容截止日为 2019 年 12 月 31 日。本招募说明书（更新）中涉及托管业务相关的更新信息已经基金托管人复核。

基金招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 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：深圳市深南大道6008号特区报业大厦15楼

成立时间：2001年5月18日

法定代表人：马永红

总经理：杨凯

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：0755 - 83276688

传真：0755 - 83515599

联系人：邹明睿

股权结构：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。

### （二）主要人员情况

#### 1、公司董事、监事及高级管理人员

##### （1）董事会

马永红先生，董事长。曾任中铁三局集团有限公司会计员、科长、处长、高级会计师、总会计师等职务；中铁置业集团有限公司董事、财务总监、副总经理。现任中铁信托有限责任公司党委书记、董事长；宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人）。

李文众先生，董事。曾任中国人民银行成都市支行解放中路办事处职员；中国工商银行成都市信托投资公司委托代理部、证券管理部经理；成都工商信托投资有限责任公司部门经理、总经理助理；中铁信托有限责任公司副总经理；宝盈基金管理有限公司董事长。现任中铁信托有限责任公司副巡视员；宝盈基金管理有限公司董事。

陈恪先生，董事。曾任中铁信托有限责任公司研究发展部职员、部门总经理助理。现任中铁信托有限责任公司证券投资部副总经理（主持工作）。

刘洪明先生，董事。曾任天津师范大学助教；中亚证券天津业务部部门经理；中化集团战略规划部职员；中国对外经济贸易信托有限公司战略管理部总经理、财富管理中心副总经

理兼财富管理中心投资管理部总经理。现任中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部总经理。

张苏彤先生，独立董事。曾任职于陕西重型机器厂、陕西省西安农业机械厂、陕西省西安农业机械厂、陕西财经学院、西安交通大学。现任中国政法大学商学院高层管理教育中心（EEP）主任，中国政法大学商学院财务会计系教授，中国政法大学法务会计研究中心主任；中国会计学会会员（CFE）兼北京分会副会长，中国注册会计师协会法务会计师认证项目专家小组副组长，北京注册会计师协会法律专家小组副组长，教育部学位与研究生教育发展中心学位论文评议专家，国家自然科学基金委项目同行评议专家，国家社会科学基金委项目同行评议专家。

廖振中先生，独立董事。曾任西南财经大学法学院讲师。现任西南财经大学法学院副教授，四川诚方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设计专家委员会成员。

王艳艳女士，独立董事。曾任美国休斯敦大学博士后；厦门大学财务与会计研究院助理教授；厦门大学管理学院副教授。现任厦门大学管理学院教授。

徐加根先生，独立董事。曾任职于中国石化。现任西南财经大学教授、金融创新与产品设计研究所副所长。

杨凯先生，董事。曾任湖南工程学院教师；振远科技股份有限公司销售经理；宝盈基金管理有限公司市场开发部总监、特定客户资产管理部总监、公司总经理助理、研究部总监、基金经理、公司副总经理；中融基金管理有限公司总经理。现任宝盈基金管理有限公司总经理、经营管理层董事。

## （2）监事会

陈林先生，监事会主席。曾任中铁二局会计员、项目财务主管、云南分公司财务科长、机电公司财务部长、副总会计师；中曼投资有限公司副总经理；中铁二局地产集团郫县项目副总经理、财务总监；中铁置业长沙公司副总经理、财务总监；成都分公司副总经理、财务总监。现任中铁信托有限责任公司内控审计部副总经理（主持工作）。

王法立先生，监事。曾任中国对外经济贸易信托有限公司财富管理中心管理部产品经理、投资管理部信托经理；诺安基金管理有限公司董事会秘书。现任中国对外经济贸易信托有限公司投资管理事业部-股权管理部副总经理（主持工作）。

魏玲玲女士，监事。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。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、风险管理部总经理。

### （3）高级管理人员

马永红先生，董事长（简历请参见董事会成员）。

杨凯先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

邹纯余先生，副总经理。曾任职于中铁二局、中铁信托有限责任公司。现任宝盈基金管理有限公司党委书记、副总经理、工会主席、董事会秘书。

葛俊杰先生，副总经理。曾任深圳市政府外事办公室主任科员；深圳市政府金融发展服务办公室主任科员、副处长；宝盈基金管理有限公司研究员、总经理办公室主任、专户投资部总监、投资经理。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。

张磊先生，督察长。曾任职于广东茂名石化公司、新疆邮政储汇局、新疆邮政局、中国证监会新疆监管局、华融证券股份有限公司、上海石上投资管理有限公司。现任宝盈基金管理有限公司督察长、纪委书记。

张献锦先生，首席信息官。曾任职于铁道部株洲车辆厂、深圳大学通信技术研究所、中国平安保险（集团）股份有限公司、博时基金管理有限公司。现任宝盈基金管理有限公司首席信息官兼信息技术部总经理。

## 2、基金经理简历

高宇先生，厦门大学投资学硕士。2008年6月至2009年8月任职于第一创业证券资产管理部，担任研究员；2009年8月至2010年10月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师，获首届金牛分析师第五名（团队）；2010年10月至2016年6月任职于博时基金，先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理，并负责信用团队；2016年7月至2017年8月任职于天风证券，担任机构业务总部总经理助理。2017年8月加入宝盈基金管理有限公司。现任宝盈基金固定收益部副总经理，宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金经理。

宝盈祥泰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：

陈若劲，2015年5月29日至2017年11月11日。

## 3、基金管理人公募基金投资决策委员会成员包括：

本公司公募基金投资决策委员会成员包括：

杨凯先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

葛俊杰先生（委员）：宝盈基金管理有限公司副总经理。

张志梅女士（委员）：宝盈基金管理有限公司权益投资部总经理，宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金和宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

邓栋先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益部总经理，宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券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、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理。

肖肖先生（委员）：宝盈基金管理有限公司研究部副总经理（主持工作），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、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈品牌消费股票型证券投资基金基金经理。

魏玲玲女士（委员）：宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

李颖女士（秘书）：宝盈基金管理有限公司权益投资部秘书。

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)6759 5096

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。建设银行于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)。

2018年末，集团资产规模23.22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,556.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300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

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

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。

原珩，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、存托业务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2019年二季度末，中国建设银行已托管924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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”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”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## (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、行业监管规章和建设银行内有关管理规定，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）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，如有必要将及时报告中国证监会。

### 三、基金的历史沿革

宝盈祥泰养老混合型证券投资基金于 2015 年 5 月 11 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2015】864 号文准予募集注册，基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

宝盈祥泰养老混合型证券投资基金自 2015 年 5 月 25 日起向社会公开募集，截至 2015 年 5 月 25 日，基金募集工作已顺利结束。募集结束后基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2015 年 5 月 29 日获中国证监会机构部函[2015]1587 号文书面确认，《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金合同》自该日起正式生效。

根据中国证券监督管理委员会 2018 年第 2 号公告《养老目标证券投资基金指引（试行）》（以下简称“《指引》”）的规定，基金名称中已经包含“养老”字样的公募基金，不符合《指引》要求的，基金管理人应当在 3 个月内履行程序修改基金名称，“养老”产业投资主题基金除外。经基金管理人与基金托管人协商一致并向监管机构履行相关程序后，基金管理人于 2018 年 5 月 9 日发布《宝盈基金管理有限公司关于变更宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金名称并修改基金法律文件的公告》，“宝盈祥泰养老混合型证券投资基金”更名为“宝盈

祥泰混合型证券投资基金”。

经中国证监会 2019 年 11 月 19 日《关于准予宝盈祥泰混合型证券投资基金变更注册的批复》，宝盈祥泰混合型证券投资基金就基金变更事宜进行变更注册。

宝盈祥泰混合型证券投资基金自 2019 年 12 月 13 日至 2020 年 1 月 13 日召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《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》，内容包括调整宝盈祥泰混合型证券投资基金的投资目标、投资范围、投资策略、基金份额净值精度等内容，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》修改部分表述，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

#### **四、基金的存续**

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

#### **五、相关服务机构**

##### **（一）基金份额发售机构**

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦15楼

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：马永红

总经理：杨凯

成立日期：2001年5月18日

客户服务统一咨询电话：400-8888-300（全国统一，免长途话费）

传真：0755-83515880

联系人：李依、梁靖

公司网站：[www.byfunds.com](http://www.byfunds.com)

##### **2、其他销售机构**

###### **（1）中国建设银行股份有限公司**

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

(2) 交通银行股份有限公司

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

(3) 平安银行股份有限公司

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

(4) 东莞农村商业银行股份有限公司

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

(5) 国泰君安证券股份有限公司

联系地址：上海市静安区南京西路768号

客户服务电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(6) 中信建投证券股份有限公司

联系地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际大厦

客户服务电话：4008888108、95587

公司网址：www.csc108.com

(7) 国信证券股份有限公司

联系地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦21楼

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(8) 招商证券股份有限公司

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

(9) 中信证券股份有限公司

联系地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦

客户服务电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(10) 海通证券股份有限公司

联系地址：上海市广东路689号

客户服务电话：4008888001、95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(11) 申万宏源证券有限公司

联系地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

客户服务电话：021-33389888

公司网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(12) 长江证券股份有限公司

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.95579.com](http://www.95579.com)

(13) 安信证券股份有限公司

联系地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼

客户服务电话：95517

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(14) 万联证券股份有限公司

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：95322

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(15) 渤海证券股份有限公司

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：400-651-5988

公司网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(16) 中信证券（山东）有限责任公司

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

客户服务电话：0532-85022313

公司网址：www.zxwt.com.cn

(17) 东兴证券股份有限公司

联系地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）6、10、12、15、16层

客户服务电话：95309

公司网址：www.dxzq.net

(18) 信达证券股份有限公司

联系地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(19) 长城证券股份有限公司

联系地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦16、17层

客户服务电话：4006666888

公司网址：www.cgws.com

(20) 光大证券股份有限公司

联系地址：上海市静安区新闻路 1508 号

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(21) 广州证券股份有限公司

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：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(22) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街6666号

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

(23) 平安证券股份有限公司

联系地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层

客户服务电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

(24) 东海证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

客户服务电话：95531、400-888-8588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(25) 中泰证券股份有限公司

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](http://www.zts.com.cn)

(26) 第一创业证券股份有限公司

联系地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦16-20楼

客户服务电话：95358

公司网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(27) 华林证券股份有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦8楼

客服电话：400-188-3888

公司网站：[www.chinalin.com](http://www.chinalin.com)

(28) 五矿证券有限公司

联系地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47楼

客户服务电话：40018-40028

公司网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

(29) 西藏东方财富证券股份有限公司

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

客户服务电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

(30) 国金证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦

客户服务电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(31) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

联系地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

客户服务电话：0755-88394688

公司网址：www.xinlande.com.cn

(32) 江苏汇林保大基金销售有限公司

联系地址：南京市新街口中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座

客户服务电话：025-56663409

公司网址：www.huilinbd.com

(33) 上海挖财基金销售有限公司

联系地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼5层01、02、03室

客户服务电话：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

(34) 喜鹊财富基金销售有限公司

联系地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

客户服务电话：400-699-7719

公司网址：<http://www.xiquefund.com/>

(35) 民商基金销售（上海）有限公司

联系地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼

客户服务电话：021-50206003

公司网址：www.msftec.com

(36) 诺亚正行基金销售有限公司

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

(37) 深圳众禄基金销售股份有限公司

联系地址：深圳市罗湖区梨园路Halo广场4楼

客户服务电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn

(38) 上海天天基金销售有限公司

联系地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

客户服务电话：95021或400-181-8188

公司网址：www.1234567.com.cn

(39) 上海好买基金销售有限公司

联系地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼

客户服务电话：4007009665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(40) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

联系地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

客户服务电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(41) 上海长量基金销售有限公司

联系地址：上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层

客户服务电话：400-820-2899

公司网址：[www.erichfund.com.cn](http://www.erichfund.com.cn)

(42) 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

客户服务电话：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(43) 上海利得基金销售有限公司

联系地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53层

客户服务电话：400-921-7755

公司网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

(44) 浙江金观诚基金销售有限公司

联系地址：浙江省杭州市登云路43号金诚集团10楼

客户服务电话：400-688-1888

公司网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(45) 南京苏宁基金销售有限公司

联系地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

客户服务电话：95177

公司网址：[www.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

(46) 北京格上富信基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区东三环北路19号中青大厦七层



客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

(47) 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e世界A座1108室

客户服务电话：4006-199-059

公司网址：www.hcjijin.com

(48) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

联系地址：北京市海淀区宝盛南路奥北科技园20号楼国泰大厦9层

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(49) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1504/1505室

客户服务电话：400-819-9868

公司网址：www.tdyhfund.com

(50) 北京植信基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙苑10号楼10号

客户服务电话：4006-802-123

公司网址：www.zhixin-inv.com

(51) 成都华羿恒信基金销售有限公司

联系地址：成都市高新区蜀锦路88号新中泰国际大厦1号楼32F2号

客户服务电话：400-8010-009

公司网址：www.huayihengxin.com

(52) 天津国美基金销售有限公司

联系地址：天津市滨海新区泰达MSD商务区C区2801

客户服务电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

(53) 北京新浪仓石基金销售有限公司

联系地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

(54) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

联系地址：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

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

(55) 济安财富（北京）基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦3层307单元

客户服务电话：400-673-7010

公司网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

(56) 上海万得基金销售有限公司

联系地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

客户服务电话：400-821-0203

(57) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

联系地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(58) 上海联泰基金销售有限公司

联系地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

客户服务电话：400-118-1188

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(59) 上海汇付基金销售有限公司

联系地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

客户服务电话：400-821-3999

公司网址：[www.hotjjin.com](http://www.hotjjin.com)

(60) 上海基煜基金销售有限公司

联系地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

客户服务电话：400-820-5369

公司网址：[www.jiyufund.com](http://www.jiyufund.com)

(61) 上海凯石财富基金销售有限公司

联系地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦

客户服务电话：4006-433-389

公司网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(62) 上海中正达广基金销售有限公司

联系地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼

客户服务电话：400-6767-523

公司网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

(63) 北京虹点基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东门2层216

客户服务电话：400-618-0707

公司网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(64) 深圳新华信通基金销售有限公司

联系地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦1806单元

客户服务电话：400-000-5767

公司网址：[www.xintongfund.com](http://www.xintongfund.com)

(65) 深圳富济基金销售有限公司

联系地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

客户服务电话：0755-83999907

公司网址：[www.fujiwealth.cn](http://www.fujiwealth.cn)

(66) 上海陆金所基金销售有限公司

联系地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

客户服务电话：4008-219-031

公司网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(67) 大泰金石基金销售有限公司

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

公司网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(68) 珠海盈米基金销售有限公司

联系地址：广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室

客户服务电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(69) 和耕传承基金销售有限公司

联系地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房  
间

客户服务电话：400-555-671

公司网址：[www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

(70) 奕丰基金销售有限公司

联系地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(71) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

联系地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

客户服务电话：400-890-9998

公司网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(72) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

联系地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

客户服务电话：400-0988-511

公司网址：[www.kenterui.jd.com](http://www.kenterui.jd.com)

(73) 中民财富基金销售（上海）有限公司

联系地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

客户服务电话：400-876-5716

公司网址：[www.cmiwm.com](http://www.cmiwm.com)

(74) 深圳市金斧子基金销售有限公司

联系地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

1108

客户服务电话：400-930-0660

公司网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(75) 北京蛋卷基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层7

客户服务电话：400-159-9288

公司网址：[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

(76) 万家财富基金销售有限公司

联系地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层

客户服务电话：010-59013895

公司网址：www.wanjiawealth.com

(77) 联储证券有限责任公司

联系地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

客户服务电话：400 620 6868

公司网址：www.lczq.com

(二) 注册登记机构

登记机构名称：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道6008号特区报业大厦15楼

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：马永红

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：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

(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：上海市湖滨路202号普华永道中心11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：李丹

联系电话：(021) 23238888

经办注册会计师：薛竞 罗佳

联系人：罗佳

## 六、基金的名称

本基金名称：宝盈祥泰混合型证券投资基金

## 七、基金的类型

本基金类型：契约型开放式混合型基金

## 八、基金的投资目标

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。

## 九、基金的投资策略

本基金采取稳健的投资策略，在控制下行风险的前提下，确定大类资产配置比例，通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益，适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。

### （一）大类资产配置策略

#### 1、宏观形势研判

本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。

本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略。研判宏观形势的过程中主要考虑的因素包括：

#### （1）宏观经济环境

- ①季度GDP及其增长速度；
- ②月度工业增加值及其增长率；
- ③月度固定资产投资完成情况及其增长速度；
- ④月度社会消费品零售总额及其增长速度；
- ⑤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；
- ⑥月度进出口数据以及外汇储备等数据；
- ⑦货币供应量M0、M1、M2的增长率以及贷款增速。

## （2）政策环境

- ①财政政策；
- ②货币政策；
- ③产业政策；
- ④证券市场监管政策。

## （3）市场资金环境

- ①居民储蓄进行证券投资的增量；
- ②货币市场利率；
- ③券商自营规模变动额；
- ④QFII、RQFII新增投资额；
- ⑤新股扩容；
- ⑥增发、配股所需资金；
- ⑦可转债所需资金；
- ⑧印花税和佣金；
- ⑨其他投资资金变动额等。

## （二）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、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略，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、可转换债券的投资策略

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。

基金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

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。

## （三）股票投资策略

本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式构建备选股票库。

### 1、行业配置策略

本基金的行业配置策略以规避下行风险、降低组合波动率为目标，结合基金管理人对波动率、相关性的定量研究，同时参考内部与外部的定性研究成果，做出行业配置决策。



在进行行业配置的过程中，基金管理人主要关注的指标包括但不限于：由行业盈利对经济周期的敏感度定义的行业周期属性、行业景气度指标（行业销售收入增长率、行业毛利率和净利率、原材料和成品价格指数以及库存率等）、行业估值指标（P/E，P/B，EV/EBITDA等）以及投资人情绪等。

## 2、个股精选策略

本基金主要采取“自下而上”的选股策略，备选股票库的构建由定量筛选和定性筛选两部分组成。

（1）首先，使用定量分析的方法，通过财务和运营数据进行企业价值评估，初步筛选出具备优势的股票备选库。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。

### ①盈利能力

本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力，主要参考的指标包括净资产收益率（ROE），毛利率，净利率，EBITDA/主营业务收入等。

### ②成长能力

本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长速度，主要参考的指标包括EPS增长率和主营业务收入增长率等。

### ③估值水平

本基金通过估值水平分析评估当前市场估值的合理性，主要参考的指标包括市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市盈增长比率（PEG）、自由现金流贴现（FCFF，FCFE）和企业价值/EBITDA等。

（2）其次，使用定性分析的方法，从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行进一步的精选。

持续成长性的分析。通过对上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入研究，评估具有持续成长能力的上市公司。具体为：产能利用率、原材料的自给率、生产规模在行业的占比较高；公司产品核心竞争力、营销渠道、品牌竞争力等方面在行业中表现较强；公司的主营业务收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率、每股收益增长率等方面在行业中具有领先优势。

在市场前景方面，需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、开拓市场、进而创造利润增长的能力。

公司治理结构的优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基金将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结

构进行评价。

#### （四）金融衍生品投资策略

##### 1、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

##### 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。

## 十、业绩比较基准

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、信用级别投资级以上、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。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准的构成因子停止发布或变更名称，本基金管理人可以在符合法律法规的规定和基金合同的约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可变更业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

## 十一、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。

## 十二、基金投资组合报告（截至 2019 年 9 月 30 日）

### 1、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	68,010,454.98	16.45
	其中：股票	68,010,454.98	16.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	337,442,200.00	81.60
	其中：债券	337,442,200.00	81.60
	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	1,927,601.27	0.47
8	其他资产	6,155,792.10	1.49
9	合计	413,536,048.35	100.00

### 2、期末按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	4,254,212.60	1.34
C	制造业	19,350,443.15	6.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,107,598.00	0.98
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	1,443,261.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,119,724.23	0.67
J	金融业	32,657,122.00	10.25
K	房地产业	2,932,992.00	0.92
L	租赁和商务服务业	1,321,452.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	823,650.00	0.26
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	68,010,454.98	21.35

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	601318	中国平安	95,700	8,329,728.00	2.62
2	600519	贵州茅台	4,400	5,060,000.00	1.59
3	600036	招商银行	100,500	3,492,375.00	1.10
4	600276	恒瑞医药	31,300	2,525,284.00	0.79
5	601166	兴业银行	117,200	2,054,516.00	0.65
6	600030	中信证券	88,900	1,998,472.00	0.63
7	600016	民生银行	267,800	1,612,156.00	0.51
8	601328	交通银行	280,900	1,530,905.00	0.48
9	600000	浦发银行	125,900	1,490,656.00	0.47
10	601288	农业银行	409,200	1,415,832.00	0.44

### 4、期末按债券品种分类的债券投资组合

序	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
---	------	---------	--------------

号			
1	国家债券	17,998,200.00	5.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,475,000.00	9.25
	其中：政策性金融债	29,475,000.00	9.25
4	企业债券	30,112,000.00	9.45
5	企业短期融资券	130,596,000.00	41.00
6	中期票据	71,031,000.00	22.30
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	58,230,000.00	18.28
9	其他	-	-
10	合计	337,442,200.00	105.94

5、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111904067	19 中国银行 CD067	500,000	48,530,000.00	15.24
2	190205	19 国开 05	300,000	29,475,000.00	9.25
3	101763010	17 晋能 MTN003	200,000	20,364,000.00	6.39
4	101752015	17 光明 MTN001	200,000	20,262,000.00	6.36
5	136102	15 合景 02	200,000	20,202,000.00	6.34

6、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。

7、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。

8、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）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持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

10、期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

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) 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持有国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期末，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除民生银行外未受到公开谴责、处罚。本基金投资民生银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

2018年12月7日，中国银行保险监督管理委员会网站发布了关于中国民生银行股份有限公司的行政处罚信息。经查，中国民生银行股份有限公司存在以下问题：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。行政处罚内容如下，根据相关法律法规，罚款3160万元。

(2) 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金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	59,222.38

2	应收证券清算款	206,589.47
3	应收股利	-
4	应收利息	5,885,508.87
5	应收申购款	3,471.38
6	其他应收款	1,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,155,792.10

(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。

(5) 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

(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。

### 十三、基金的业绩

本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 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 2019 年 9 月 30 日)

宝盈祥泰混合 A

阶段	净值增长率①	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
2015年5月29日-2015年12月31日	3.60%	0.08%	1.93%	0.01%	1.67%	0.07%
2016年	0.58%	0.10%	2.50%	0.01%	-1.92%	0.09%
2017年	2.21%	0.08%	2.50%	0.01%	-0.29%	0.07%
2018年	-0.66%	0.28%	2.50%	0.01%	-3.16%	0.27%
2019年上半年	5.39%	0.60%	1.24%	0.01%	4.15%	0.59%
2019年三季度	3.68%	0.34%	0.63%	0.01%	3.05%	0.33%

宝盈祥泰混合 C

阶段	净值增长率①	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
2019年三季度	2.76%	0.31%	0.63%	0.01%	2.13%	0.30%

注：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈祥泰混合 C”。

#### 十四、基金的费用与税收

##### （一）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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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。

##### （二）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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。



## 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：

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

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

## 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 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。

### （三）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。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

#### （五）与基金有关的费用

##### 1、申购费

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费，C 类基金份额在申购时不收取申购费。本基金 A 类基金份额的申购费率最高不高于 1.5%，且随申购金额的增加而递减。投资人重复申购的，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

费用类别	费率（设申购金额为 M）	
A 类基金份额 申购费	M < 100 万	1.50%
	100 万 ≤ M < 200 万	1.00%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.80%
	M ≥ 500 万	固定费用 1000 元

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，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、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。

##### 2、赎回费

本基金赎回费率最高不超过 1.5%，A 类基金份额与 C 类基金份额的赎回费率分别按基金份额持有人持有该类基金份额的时间分段设定如下：

费用	费率		
A 类基金份额 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%	
C 类基金份额 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	0.50%	
	30 日 ≤ 持有期限	0%	

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在投资人赎回本基金份额时收取，其中未归入基金财产的部分用于支付

登记费和其他必要的手续费。

### 3、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2015年6月11日发布的《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》和其他有关基金转换公告。

## 十五、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》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). 根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和我公司于2020年1月15日发布的《宝盈基金管理有限公司关于宝盈祥泰养老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(附公证书)》更新了招募说明书的有关内容。
- 2). 在“重要提示”部分,更新了本招募说明书所载各项内容的截止时间。
- 3). 在“第三部分 基金管理人”中,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。
- 4). 在“第四部分 基金托管人”中,更新了基金托管人的相应内容。
- 5). 在“第五部分 相关服务机构”中,更新了相关服务机构的相应内容。
- 6). 在“第九部分 基金的投资”中,更新了基金投资组合报告的相应内容。
- 7). 在“第十部分 基金的业绩”中,更新了基金的投资业绩。
- 8). 根据本公司于2019年6月22日发布的《宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告》,在重要提示及风险揭示章节增加基金投资于科创板股票的相关提示。
- 9). 在“第二十一部分 基金份额持有人服务”中,更新了网上交易服务的相关内容。
- 10). 在“第二十二部分 其他应披露事项”中,披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司

二〇二〇年一月十五日