

宝盈融源可转债债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

2019 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 1 月 17 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈融源可转债债券
基金主代码	006147
交易代码	006147
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 4 日
报告期末基金份额总额	364,194,901.25 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险和保持基金资产流动性的基础上，以可转换债券为主要投资标的，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、债券投资策略</p> <p>本基金以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点，结合估值研究、投资者行为研究，自上而下确定组合整体杠杆率以及各类债券资产的配置比例。同时，本基金注重微观层面的投资研究及策略，尤其是在信用债券领域，具体投资标的的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。</p> <p>本基金充分发挥基金管理人在信用债市场所积累的长期经验，利用自主开发的信用分析体系及数据、经验积累，结合行业研究、公司研究进行自下而上选券。</p> <p>本基金采用的投资策略主要为（包括但不限于）：债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略、流动性管理策略。</p> <p>（1）债券资产配置策略。组合杠杆率及各类债券资产的配置比例决策侧重以下几个方面研究</p>

	<p>(包括但不限于):</p> <p>1) 宏观经济变量(包括但不限于宏观增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业周期等)、流动性条件、行业基本面等研究;</p> <p>2) 利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究;</p> <p>3) 宏观流动性环境及货币市场流动性研究;</p> <p>4) 大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。</p> <p>(2) 行业配置策略。基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法,并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究,本基金以分散化配置模式为基础,实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异,在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上,合理地决定不同行业的配置比例。</p> <p>(3) 公司配置策略。基于公司价值研究的重要性,本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况,在充分考虑组合流动性特征的前提下,结合行业周期研究,甄别具有估值优势、基本面改善的公司,以分散化配置模式为基础策略。</p> <p>(4) 流动性管理策略。本策略侧重于对组合可质押券的管理。信用债的质押率水平与其基本面存在一定的相关关系。本基金将在合同约定的组合杠杆率以及既定债券资产配置策略下的杠杆率范围内,充分考虑发行人基本面的当前和未来变化的可能性及趋势,合理配置于不同发行主体所发行的可质押券。</p> <p>2、可转换债券(含可交换债券)投资策略</p> <p>基于行业研究、公司研究可转债估值模型分析,本基金在一、二级市场投资可转债(含可交换债)。主要有以下几类策略(包括但不限于):</p> <p>(1) 行业配置策略。本基金以宏观经济走势、经济周期特征和阶段性市场投资主题的研究为基础,综合考量宏观调控目标、产业结构调整因素等,精选具有良好成长潜力和受益于政策扶持具有优良成长环境的公司发行的可转债(含可交换债)进行投资布局。同时,结合经济和市场阶段性特征,动态调整不同行业的可转债(含可交换债)比例。</p> <p>(2) 个券精选策略。本基金将对所有可转债(含可交换债)所对应的股票进行基本面分析,具体采用定量分析(如 P/E、P/B、PEG 等)和定性分析(公司治理结构、行业地位、竞争优势、创新能力等)相结合的方式,精选具有良好成长潜</p>
--	--

	<p>力且估值合理的标的。</p> <p>(3) 转股策略。在转股期内，当本基金所持可转债（含可交换债）市场价格显著低于转换价值时，即转股溢价率为负时，本基金将实现转股并卖出股票实现收益；当可转债（含可交换债）流动性不足以满足投资组合的需要时，本基金将通过转股保障基金财产安全；当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时，本基金将通过转股锁定已有收益，并通过进一步分析和预测正股未来走势，作出进一步投资决策。</p> <p>(4) 条款博弈策略。可转债通常附有赎回、回售、转股修正等条款，其中赎回条款是发行人促进可转债转股的重要手段，回售和转股价向下修正条款则是对可转债投资者的保护性条款。这些条款在特定环境下对可转债价值有重要影响。本基金将根据可转债上市公司当前经营状况和未来发展战略，以及公司的财务状况和融资需求，对发行人的促进转股意愿和能力进行分析，把握投资机会。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，主要遵循以下三个步骤：</p> <p>1) 本基金将对股票的风格特征进行评估，从股票池中选择成长与价值特性突出的股票。根据一系列指标对市场上所有股票的风格特征进行评估。成长股的重要评估指标是考察公司的成长性。价值投资的核心思想是寻找市场上被低估的股票。通过以上评估，初步筛选出成长与价值股票池。</p> <p>2) 对股票的基本面素质进行筛选，应用基本面分析方法，确定优质成长股与优质价值股的评价标准，在第一步选择出的具有鲜明风格的股票名单中，进一步分析，选出基本面较好的股票。</p> <p>3) 进行成长与价值的风格配置。本基金将根据对市场的判断，动态地调整成长股与价值股的投资比重，追求在可控风险前提下的稳健回报。在以上形成的价值股、成长股股票池中，本基金根据对市场趋势的判断、宏观经济环境等因素，对成长与价值股的投资比例进行配置。总体而言，成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整。以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动的风险，提高整体收益率。</p> <p>(2) 高股息股票投资策略</p> <p>重点投资于竞争格局稳定、长期回报优秀的高股息率低估值股票，分析维度主要有行业状况、竞</p>
--	---

	<p>争格局、财务质量、盈利能力、估值水平等。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、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。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的产品。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈融源可转债债券 A	宝盈融源可转债债券 C
下属分级基金的交易代码	006147	006148
报告期末下属分级基金的份额总额	355,599,531.79 份	8,595,369.46 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年10月1日—2019年12月31日）
--------	-----------------------------

	宝盈融源可转债债券 A	宝盈融源可转债债券 C
1. 本期已实现收益	5,468,720.09	105,317.09
2. 本期利润	45,349,664.73	892,049.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0791	0.0715
4. 期末基金资产净值	377,290,919.93	9,110,765.05
5. 期末基金份额净值	1.0610	1.0600

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、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。

4、本基金本报告期为 2019 年 9 月 4 日（合同生效日）起至 2019 年 12 月 31 日止。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

宝盈融源可转债债券 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
过去三个月	8.59%	0.53%	6.13%	0.37%	2.46%	0.16%

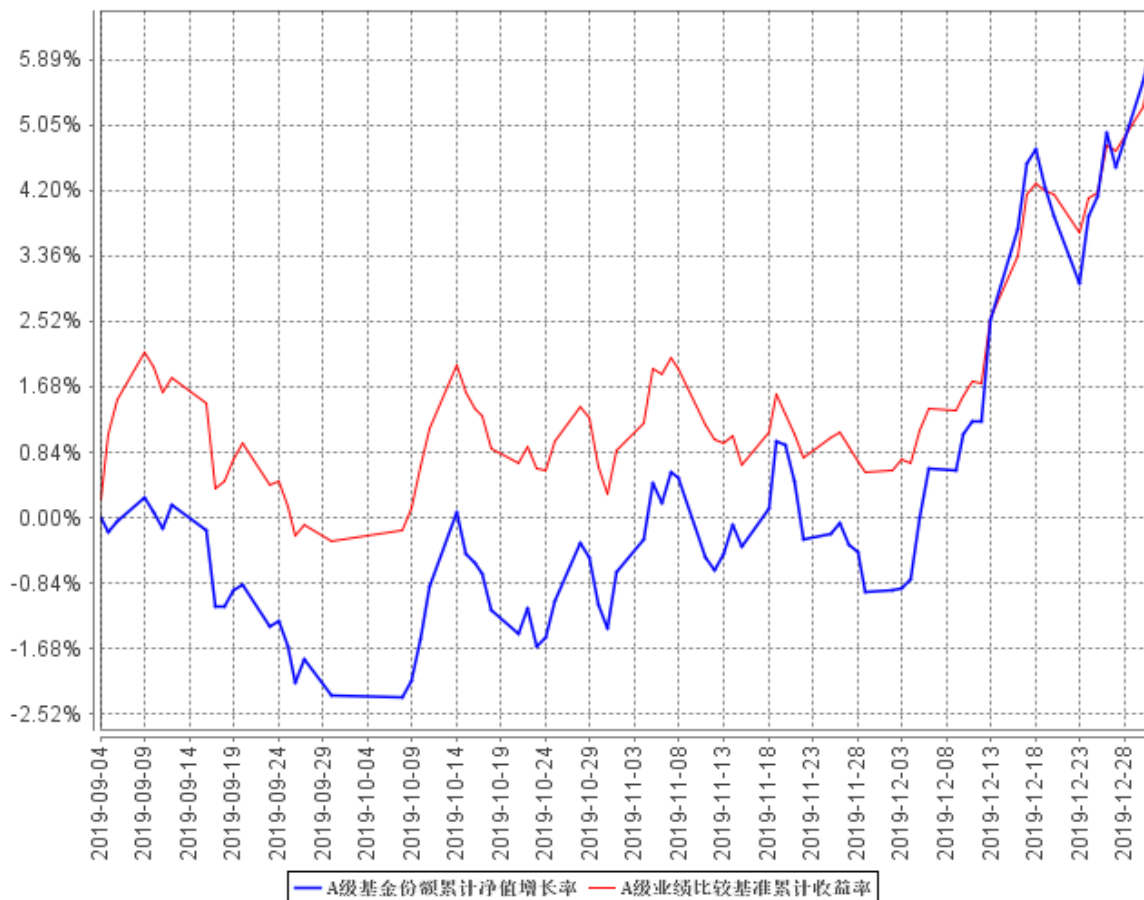
宝盈融源可转债债券 C

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
过去三个月	8.51%	0.53%	6.13%	0.37%	2.38%	0.16%

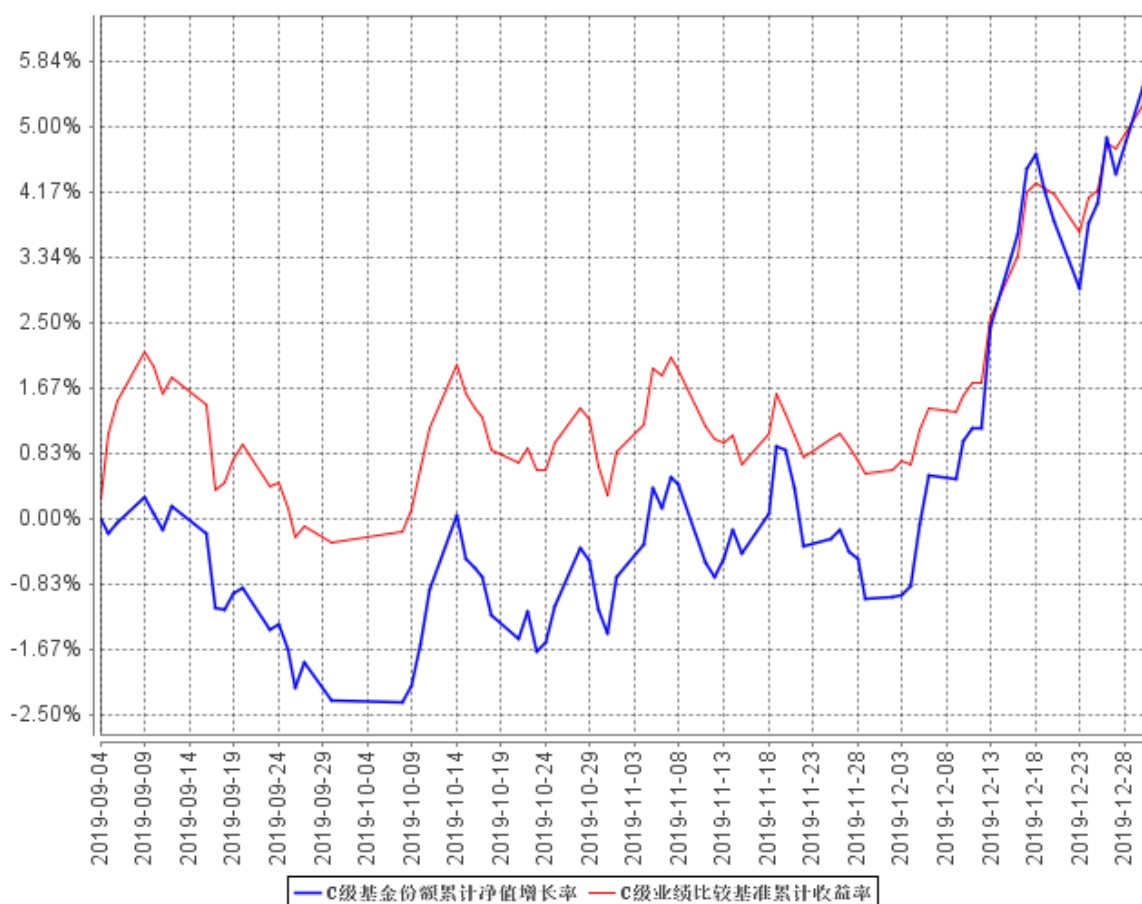
注：本基金本报告期为 2019 年 9 月 4 日（合同生效日）起至 2019 年 12 月 31 日止。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2019 年 9 月 4 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓栋	本基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金基金	2019年9月4日	-	9年	邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008年3月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自2010年1月至2017年8月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017年8月加入宝盈基金

	经理;固定收益部 总经理				管理有限公司固定收益部。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 公平交易专项说明

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,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;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 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4 季度经济稳中略有下行,货币政策保持稳健中性,央行在 11 月下调公开市场操作利率正式开启国内降息周期。从市场表现看,4 季度主要股指震荡,但电子医药传媒等行业有较大超额收益,结构性行情特征突出。中证转债指数 4 季度 7.06%,转股溢价率继续提升。

报告期内,本基金严格遵守基金合同约定,主要投资于风险可控,溢价率偏低的可转债,并灵活参与权益资产投资。4 季度转债市场上涨,组合自下而上优选个券,并通过维持较高的转债和权益仓位博取超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈融源可转债债券 A 基金份额净值为 1.0610 元,本报告期基金份额净值增长率为 8.59%;截至本报告期末宝盈融源可转债债券 C 基金份额净值为 1.0600 元,本报告期基金份额净值增长率为 8.51%;同期业绩比较基准收益率为 6.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	77,161,775.90	14.67
	其中：股票	77,161,775.90	14.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	427,414,701.56	81.27
	其中：债券	427,414,701.56	81.27
	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	10,279,118.11	1.95
8	其他资产	11,057,923.22	2.10
9	合计	525,913,518.79	100.00

5.2 报告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	-	-
C	制造业	18,928,000.00	4.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,150,920.90	9.10
J	金融业	15,382,800.00	3.98
K	房地产业	7,700,055.00	1.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	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	77,161,775.90	19.97

5.3 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	600519	贵州茅台	16,000	18,928,000.00	4.90
2	600570	恒生电子	224,930	17,483,808.90	4.52
3	601318	中国平安	180,000	15,382,800.00	3.98
4	002624	完美世界	308,000	13,595,120.00	3.52
5	001914	招商积余	379,500	7,700,055.00	1.99
6	600536	中国软件	56,800	4,071,992.00	1.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,150,000.00	5.21
	其中：政策性金融债	20,150,000.00	5.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	407,264,701.56	105.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	427,414,701.56	110.61

5.5 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	113021	中信转债	317,460	35,917,424.40	9.30
2	110053	苏银转债	300,000	35,217,000.00	9.11
3	113011	光大转债	270,000	33,658,200.00	8.71
4	132018	G 三峡 EB1	250,000	27,817,500.00	7.20
5	128048	张行转债	200,000	23,380,000.00	6.05

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

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，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；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合整体风险的目的。

5.9.2 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持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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苏银转债、中信转债、光大转债的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2019 年 2 月 3 日，中国银行业监督管理委员会江苏监管局认定江苏银行股份有限公司存在未按业务实质准确计量风险资产；理财产品之间未能实现相分离；理财投资非标资产未严格比照自营贷款管理，对授信资金未按约定用途使用监督不力的风险。江苏监管局依照《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项对其采取罚款人民币 90 万元的处罚。

2019 年 8 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会认定中信银行股份有限公司存在以下问题：
（一）未按规定提供报表且逾期未改正；（二）错报、漏报银行业监管统计资料；（三）未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件；（四）信息系统控制存在较大安全漏洞，未做到有效的安全控制；（五）未按企业划型标准将多家企业划分为小微企业，报送监管数据不真实；（六）向关系人发放信用贷款、向关系人发放担保贷款的条件优于其他借款人同类贷款条件；（七）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（八）贷后管理不到位导致贷款资金被挪用；（九）以流动资金贷款名义发放房地产开发贷款；（十）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；

(十一) 投资同一家银行机构同期非保本理财产品采用风险权重不一致; (十二) 购买非保本理财产品签订可提前赎回协议, 未准确计量风险加权资产; (十三) 未按规定计提资产支持证券业务的风险加权资产。根据相关法律法规, 没收违法所得 33.6677 万元, 罚款 2190 万元, 合计 2223.6677 万元。

2019 年 12 月 27 日, 中国银行保险监督管理委员会认定中国光大银行股份有限公司存在以下问题: (一) 授信审批不审慎; (二) 为还款来源不清晰的项目办理业务; (三) 总行对分支机构管控不力承担管理责任。依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项的规定和相关内控管理和业务审慎经营规则, 对光大银行做出罚款 180 万元的处罚决定。

上述处罚措施对江苏银行、中信银行、光大银行的正常经营影响可控, 本基金投资苏银转债、中信转债、光大转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	164,952.66
2	应收证券清算款	9,658,739.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,066,162.25
5	应收申购款	168,069.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,057,923.22

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113021	中信转债	35,917,424.40	9.30
2	110053	苏银转债	35,217,000.00	9.11
3	113011	光大转债	33,658,200.00	8.71
4	128048	张行转债	23,380,000.00	6.05
5	113517	曙光转债	21,631,025.80	5.60
6	110046	圆通转债	20,900,842.30	5.41
7	113013	国君转债	18,669,000.00	4.83
8	113009	广汽转债	16,251,200.00	4.21
9	127012	招路转债	16,043,860.49	4.15

10	128045	机电转债	14,415,200.00	3.73
11	113518	顾家转债	14,019,698.00	3.63
12	123025	精测转债	13,661,801.06	3.54
13	128016	雨虹转债	12,959,850.54	3.35
14	110048	福能转债	12,124,000.00	3.14
15	110050	佳都转债	379,140.00	0.10

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈融源可转债债券 A	宝盈融源可转债债券 C
报告期期初基金份额总额	629,351,714.19	14,133,901.54
报告期期间基金总申购份额	1,426,250.52	951,672.39
减：报告期期间基金总赎回份额	275,178,432.92	6,490,204.47
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	355,599,531.79	8,595,369.46

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈融源可转债债券型证券投资基金设立的文件。

《宝盈融源可转债债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈融源可转债债券型证券投资基金托管协议》。

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媒介上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

9.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2020 年 1 月 17 日