

宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 21 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 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈祥利稳健配置混合
基金主代码	008324
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 27 日
报告期末基金份额总额	670,509,816.05 份
投资目标	在严格控制风险的基础上，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>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产品收益。</p> <p>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、国债期货投资策略和股指期货投资策略五个部分组成。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，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货币类、利率类、信用类、权益资产的配置比例。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资策略主要包括债券资产配置</p>

	<p>策略、行业配置策略、公司配置策略。</p> <p>1) 债券资产配置策略。组合杠杆率及货币类、利率类、信用类债券的配置比例决策主要参考以下几个方面研究：</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>(2) 资产支持证券投资策略</p> <p>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、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，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>(3) 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、二级市场投资可转换债券（含可交换债券），主要的投资策略包括行业配置策略、个券精选策略、转股策略、条款博弈策略等。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。</p> <p>(1) 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作为备选投资标的。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面对股票进行考量。</p> <p>(2) 在定量分析的基础上，基金管理人将深入调研上市公司，并基于公司治理、公司发展战略、基本面变化、竞争优势、管理水平、估值比较和行业景气度趋势等关键因素，评估上市公司的中长期发展前景、成长性和核心竞争力，进一步优化备选投资标的。</p> <p>4、国债期货投资策略</p>
--	---

	<p>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>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值和流动性管理为目的，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和流动性风险，改善组合的风险收益特性。</p>	
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%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈祥利稳健配置混合 A	宝盈祥利稳健配置混合 C
下属分级基金的交易代码	008324	008325
报告期末下属分级基金的份额总额	164,629,642.55 份	505,880,173.50 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（2020年1月1日—2020年3月31日）	
	宝盈祥利稳健配置混合 A	宝盈祥利稳健配置混合 C
1. 本期已实现收益	665,036.85	1,747,594.25
2. 本期利润	-432,737.14	-1,759,332.78
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0025	-0.0031
4. 期末基金资产净值	164,273,089.69	504,392,560.27
5. 期末基金份额净值	0.9978	0.9971

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。

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

宝盈祥利稳健配置混合 A

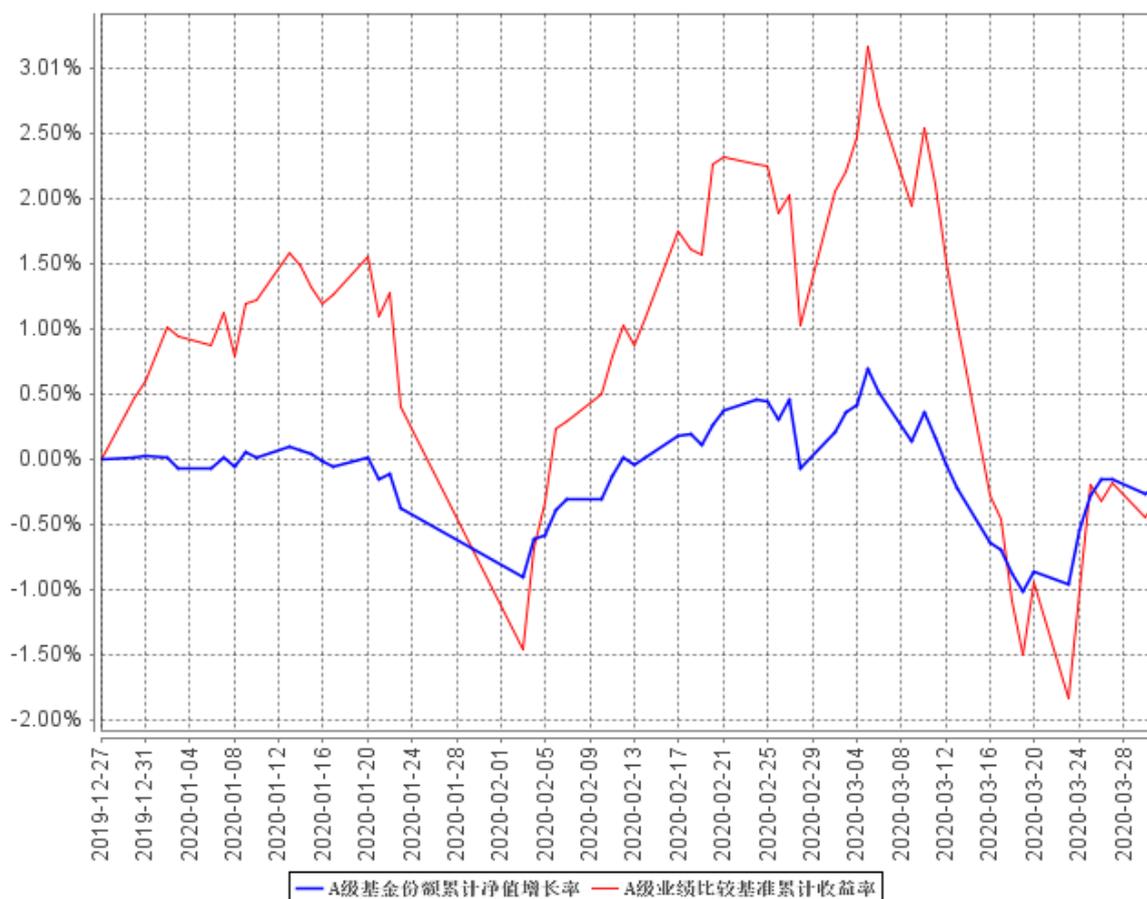
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.25%	0.19%	-0.90%	0.55%	0.65%	-0.36%

宝盈祥利稳健配置混合 C

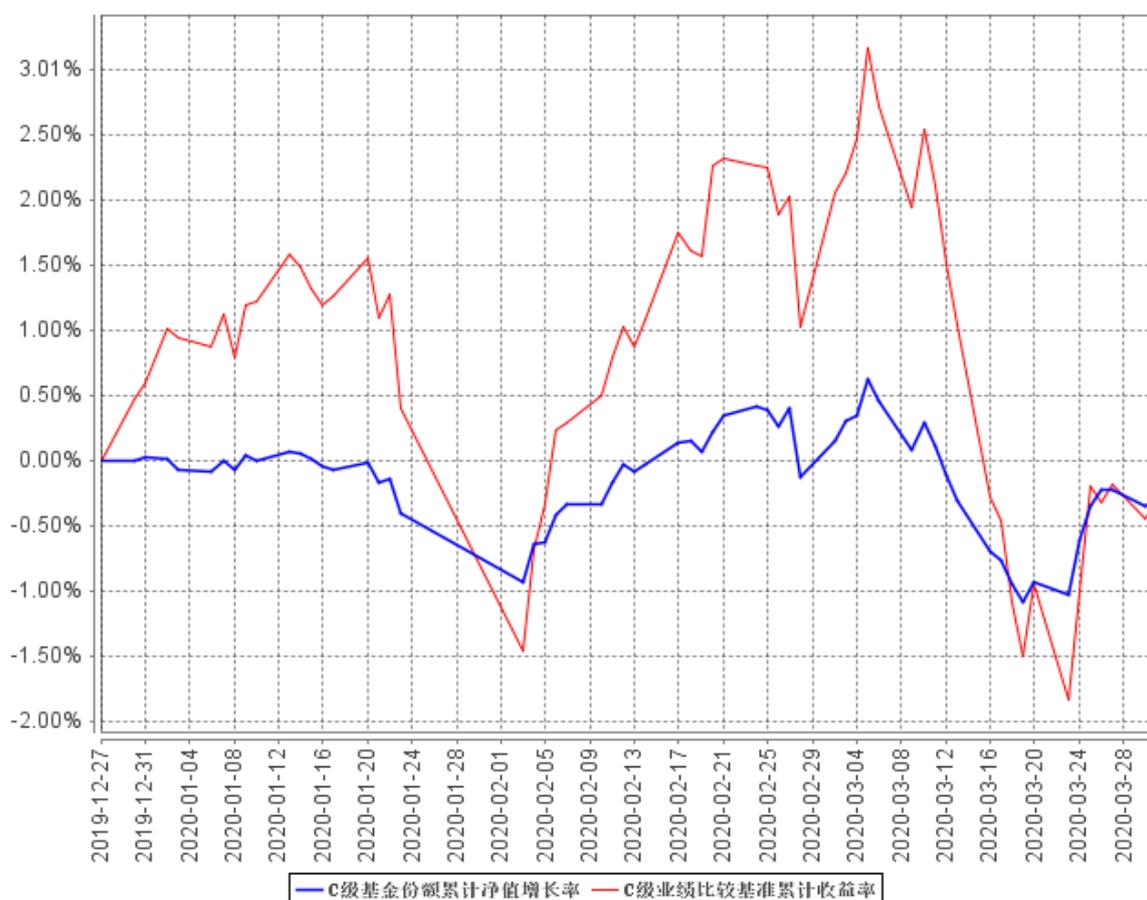
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.32%	0.19%	-0.90%	0.55%	0.58%	-0.36%

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 12 月 27 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		
吕姝仪	本基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥泽混合型证券投资基金基金经理	2019 年 12 月 27 日	-	7 年	吕姝仪女士，中国人民大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2013 年 9 月在中山证券有限责任公司任投资经理助理，2013 年 10 月至 2015 年 9 月在民生加银基金管理有限公司任债券交易员，2015 年 9 月至 2017 年 12 月在东兴证券股份有限公司基

					金业务部任基金经理。2017 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，历任投资经理。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

1 季度经济弱复苏的势头被新冠疫情暂时中断。春节假期期间，国内疫情从扩散到爆发，国内情绪恐慌，海外市场资产调整相对温和。春节复工后三周，国内疫情逐步得到控制，市场风险偏好明显修复，长端利率先下后上，股市连续反弹。2 月中下旬至 3 月，境外疫情快速扩散，压制全球总需求，全球风险资产出现普跌。国内股市最初表现相对较好，但后期由于市场开始担忧疫情扩散对全球产业链、基本面的影响，也开始出现调整。3 月长端利率震荡下行，其中 10 年期国开利率下行约 25BP，10 年期国债利率下行约 15BP。

报告期内，本基金严格遵守基金合同约定，以信用债为底仓配置，灵活参与股票投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥利稳健配置混合 A 基金份额净值为 0.9978 元，本报告期基金份额净值

增长率为-0.25%；截至本报告期末宝盈祥利稳健配置混合 C 基金份额净值为 0.9971 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.32%；同期业绩比较基准收益率为-0.90%。

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	74,441,851.91	8.14
	其中：股票	74,441,851.91	8.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	817,547,500.00	89.39
	其中：债券	817,547,500.00	89.39
	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	7,916,835.37	0.87
8	其他资产	14,695,128.00	1.61
9	合计	914,601,315.28	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	8,932,000.00	1.34
C	制造业	39,768,798.62	5.95
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	19,147.31	0.00
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	13,388,250.00	2.00

J	金融业	6,647,237.00	0.99
K	房地产业	1,825,866.00	0.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,552.98	0.00
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	3,843,000.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,441,851.91	11.13

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	600276	恒瑞医药	160,000	14,724,800.00	2.20
2	601088	中国神华	550,000	8,932,000.00	1.34
3	601318	中国平安	96,100	6,647,237.00	0.99
4	603636	南威软件	575,000	6,463,000.00	0.97
5	600760	中航沈飞	225,600	6,458,928.00	0.97
6	600887	伊利股份	205,700	6,142,202.00	0.92
7	603881	数据港	125,000	6,046,250.00	0.90
8	000661	长春高新	8,200	4,493,600.00	0.67
9	300347	泰格医药	60,000	3,843,000.00	0.57
10	600298	安琪酵母	99,920	3,517,184.00	0.53

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	11,132,000.00	1.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,212,000.00	6.01
	其中：政策性金融债	40,212,000.00	6.01
4	企业债券	409,839,000.00	61.29
5	企业短期融资券	286,182,500.00	42.80
6	中期票据	70,182,000.00	10.50
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	817,547,500.00	122.27

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	143712	18 招商 G5	500,000	51,115,000.00	7.64
2	112740	18 国信 03	500,000	50,830,000.00	7.60

3	136775	16 中船 02	500,000	50,375,000.00	7.53
4	143607	18 国君 G2	400,000	40,756,000.00	6.10
5	190211	19 国开 11	400,000	40,212,000.00	6.01

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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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持有股指期货。

5.9.2 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，以套期保值和流动性管理为目的，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和流动性风险，改善组合的风险收益特性。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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，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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除 18 招商 G5、18 国信 03、18 国君 G2 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。相关处罚措施对招商证券、国信证券、国泰君安证券的正常经营影响可控，本基金投资 18 招商 G5、18 国信 03、18 国君 G2 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

2019 年 5 月 29 日，香港证券及期货事务监察委员会认为招商证券子公司招证香港在担任中国金属再生资源（控股）有限公司上市申请的联席保荐人时（2008 年 11 月至 2009 年 6 月）没有履行其应尽的尽职审查责任。香港证券及期货事务监察委员会对招证香港采取纪律行动，包括处以罚款 2,700 万元港币。

2019 年 6 月 1 日，香港证券及期货事务监察委员会认为招商证券子公司招证香港错误处理客户款项（发生于 2011 年 10 月至 2014 年 9 月期间）。香港证券及期货事务监察委员会对招证香港采取纪律行动，包括处以罚款 500 万元港币。

2019 年 9 月 11 日，中国证监会认为招商证券存在以下问题：一是投行部门未配备专职合规人员；部分投行异地团队未配备专职合规人员；部分分支机构未配备合规人员；部分分支机构合规人员不具备 3 年以上相关工作经验。二是部分合规人员薪酬低于公司同级别平均水平。三是未见合规总监有权参加监事会的规定。四是部分重大决策、新产品和新业务未经合规总监合规审查。上述情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第十三条、第二十三条、第二十五条、第二十八条、《证券公司合规管理实施指引》第二十八条、第三十一条的规定。按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条的规定，证监会决定对招商证券采取出具警示函的行政监管措施。

2019 年 9 月 11 日，北京证监局认为招商证券北京朝外大街证券营业部在为某客户开立融资融券账户时，由于员工操作失误，该营业部将融资融券账户错误关联到另一客户股东账户下；在代销产品过程中，该营业部向某客户进行风险提示的留痕缺失。北京证监局对该营业部作出责令改正并增加合规检查次数的监督管理措施决定。

2019 年 2 月 18 日，香港证券及期货事务监察委员会认为国信证券香港子公司于 2014 年 11 月至 2015 年 12 月期间未遵守有关打击洗钱及恐怖分子资金筹集的监管规定，决定对其作出公开谴责及罚款 1,520 万港元。

2019 年 4 月 17 日，中国人民银行呼和浩特中心支行对国信证券内蒙古分公司作出《行政处罚决定书》（蒙银罚字[2019]第 4 号），认为内蒙古分公司未按规定有效履行反洗钱客户身份识别

义务和未按照规定报送可疑交易报告。中国人民银行呼和浩特中心支行对国信证券内蒙古分公司及内蒙古分公司合规风控总监分别处以人民币 20 万元和 1 万元罚款。并要求及时完善内部反洗钱工作机制，加强内部培训和审核机制，强化客户身份识别的审核效能，提高可疑交易报告工作质量。

2019 年 8 月 7 日，广东证监局认为国信证券南海分公司存在员工私下接受客户委托买卖证券、借用客户名义买卖股票的行为，该分公司未能及时发现并有效实施合规管理。同时，该分公司对回访时客户身份明显存疑的情况未采取进一步的核查措施。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》（国务院令 522 号）第二十七条、《证券投资顾问业务暂行规定》（证监会公告〔2010〕27 号）第九条和《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告〔2010〕11 号）第三条的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，广东证监局决定对你分公司采取增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的行政监管措施。

2019 年 12 月 17 日，江苏证监局认为国信证券对发行人的募集资金使用监督不到位，未及时发现其募集资金中有 2 亿元存在未按约定用途使用的情形，发行人在 2016 年 5 月 17 日至 2016 年 9 月 23 日期间将募集资金中 2 亿元转借他人；而国信证券出具的 2016 年受托管理事务报告中，披露发行人不存在挪用募集资金，将募集资金转借他人等违规行为，未按照《受托管理协议》的约定履行职责。上述行为不符合《公司债券受托管理人执业行为准则》第十条、第十三条的规定，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条、第五十二条的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条的规定，江苏证监局决定对国信证券采取出具警示函的监管措施。

2019 年 9 月 16 日，吉林证监局认为国泰君安证券四平中央西路证券营业部员工王珏存在替客户办理证券交易操作、与客户约定分享投资收益的行为。该营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位、部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映出该营业部内部控制不完善。上述行为违反了《证券经纪人管理暂行规定》第十八条及《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，吉林证监局决定对该营业部采取责令改正的行政监管措施。

2019 年 6 月 24 日，河北证监局认为国泰君安证券唐山建华西道证券营业部因印章保管未实行双人双锁管理制，未有效执行公司内部控制制度，决定对该营业部采取责令限期改正的行政监管措施。

2020 年 1 月 17 日，上海证监局认为国泰君安证券分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。决定对公司采取出

具警示函的行政监管措施。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,380.17
2	应收证券清算款	3,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	11,629,510.43
5	应收申购款	5,237.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,695,128.00

5.11.4 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。

5.11.5 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股票。

5.11.6 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	宝盈祥利稳健配置混合 A	宝盈祥利稳健配置混合 C
报告期期初基金份额总额	171,303,624.82	618,461,433.68
报告期期间基金总申购份额	619,491.27	3,960,106.78
减：报告期期间基金总赎回份额	7,293,473.54	116,541,366.96
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	164,629,642.55	505,880,173.50

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

中国证监会准予宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金设立的文件；

《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》；

《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金托管协议》；

法律意见书；

基金管理人业务资格批件、营业执照；

基金托管人业务资格批件、营业执照；

中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

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：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

9.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，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 4 月 22 日