

宝盈增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈增强收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2008 年 3 月 10 日中国证监会证监许可[2008]325 号《关于核准宝盈增强收益债券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 2008 年 5 月 15 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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。投资人投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。

基金管理人的过往业绩并不预示其未来业绩。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2014 年 11 月 15 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2014 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

注册及办公地址：广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第 15 层

法定代表人：李建生

总经理：汪钦

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：王中宝

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、公司高级管理人员

（1）董事会

李建生女士，董事长，1954 年生，中共党员，高级会计师、注册会计师、企业法律顾问。2000 年 1 月至 2002 年 12 月任中铁工总会会计师，2002 年 12 月至 2007 年 9 月任中铁工总会会计师、总法律顾问，2005 年 5 月至 2009 年 12 月兼任中铁信托有限责任公司董事长，2007 年 9 月

至 2014 年 3 月任中国中铁股份有限公司副总裁、财务总监、总法律顾问，2011 年 6 月至今任安徽昊方机电股份有限公司独立非执行董事。

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。

张一冰女士，董事，1967 年生，中共党员，陕西财经学院硕士。1989 年 7 月起，在中国华大理工技术公司计财部任职；1990 年 5 月至 1999 年 5 月，在中国对外经济贸易信托投资公司计财部、综合部和证券部任职；1999 年 6 月，任香港第一太平银行投资银行部副总裁；2001 年 4 月起，在中国对外经济贸易信托投资公司先后担任投资银行部、稽核法律部、投资发展部总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司董事会秘书。

贺颖奇先生，独立董事，1962 年生，中共党员，管理学博士。1986 年至 1992 年，在河北大学经济系任教；1995 年至 2001 年，在厦门大学管理学院任教；2001 年至 2003 年在清华大学经济管理学院管理学博士后流动站从事博士后研究工作；2003 年 7 月至 2010 年 4 月，在清华大学会计研究所从事教学与科研工作，任清华大学会计研究所党支部书记，副教授；2010 年 5 月至今，在北京国家会计学院任副教授。兼任福建星网锐捷公司独立董事。

屈文洲先生，独立董事，1972 年生，中共党员，金融学博士。1995 至 1997 年，任厦门建发信托投资公司海滨证券营业部投资信息部主任；1997 至 2001 年，任厦门建发信托投资公司投资银行部经理；1998 至 1999 年，借调中国证监会厦门特派办上市公司监管处；2001 至 2003 年任厦门市博亦投资咨询有限公司总经理；2003 至 2005 年任深圳证券交易所研究员；2005 至今，在厦门大学管理学院从事教学与研究工作。现任厦门大学管理学院教授、博士生导师，厦门大学中国资本市场研究中心主任，厦门大学管理学院财务学系副主任。兼任厦门空港、山东航空、莱宝高科的独立董事。

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。

汪钦先生，董事，1966 年生，中共党员，经济学博士。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处、海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三亚东方实业股份有限公司副总经理、国信证券股份有限公司研究所所长、长城基金管理有限公司副总经理。2010 年 11 月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。

张新元先生，员工监事，1973 年生，硕士。曾就职于黄河证券有限责任公司周口营业部、民生证券有限责任公司周口营业部、长城基金管理有限公司。2011 年 7 月起至今，在宝盈基金

管理有限公司工作，曾任总经理办公室主任，现任宝盈基金管理有限公司机构业务部总监。

（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。

杨凯先生，1974年生，中山大学岭南学院MBA。2003年7月至今，在宝盈基金管理有限公司工作，先后担任市场部总监助理、市场部总监、特定客户资产管理部总监、研究部总监、总经理助理。目前，其担任宝盈基金管理有限公司副总经理兼鸿阳证券投资基金基金经理。

储诚忠先生，1962年生，经济学博士。曾任武汉大学期货证券研究中心主任、金融系副主任、副教授，国信证券有限公司投资研究中心特级研究员、综合研究部总经理，中融基金管理有限公司（现国投瑞银基金管理有限公司）研究部总监、金融工程总监，国投瑞银基金管理有限公司产品开发部总监、渠道服务部总监，长盛基金管理有限公司北京分公司总经理兼营销策划部总监、华南营销中心总经理兼深圳注册地负责人。2011年加入宝盈基金管理有限公司，任总经理助理，现任宝盈基金管理有限公司副总经理。

2、本基金基金经理

陈若劲女士，1971年6月生，香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作，2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员，现任宝盈基金管理有限公司固定收益部总监、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理。

宝盈增强收益债券型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

刘丰元，2008年5月15日至2008年12月24日。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

杨凯先生：宝盈基金管理有限公司副总经理兼鸿阳证券投资基金基金经理。

彭敢先生：宝盈基金管理有限公司投资部总监、宝盈资源优选股票型证券投资基金基金经理、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理。

段鹏程先生：宝盈基金管理有限公司研究部总监。

陈若劲女士：宝盈基金管理有限公司固定收益部总监、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理。

张小仁先生：宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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：王洪章

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

中国建设银行拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年，本集团实现利润总额1,695.16亿元，较上年同期增长9.23%；净利润1,309.70亿元，较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元，较上年同期增长14.20%；其中，利息净收入增长12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长8.39%，在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%，同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%，同业领先。

截至2014年6月末，本集团资产总额163,997.90亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户贷款和垫款总额91,906.01亿元，增长6.99%；负债总额152,527.78亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户存款总额129,569.56亿元，增长6.00%。

截至2014年6月末，中国建设银行公司机构客户326.89万户，较上年末增加20.35万户，增长6.64%；个人客户近3亿户，较上年末增加921万户，增长3.17%；网上银行客户1.67亿户，较上年末增长9.23%，手机银行客户数1.31亿户，增长12.56%。

截至2014年6月末，中国建设银行境内营业机构总量14,707个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备72,128台，较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%，较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12位。中国建设银行总行设投资托管业务部，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、监督稽核处等9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240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

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，

具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资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。

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、QFII、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2014年9月末，中国建设银行已托管389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。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”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。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资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“托管业务综合系统——基金监督子系统”，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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。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）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(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、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，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：李建生

电话：0755-83276688

传真：0755-83515880

联系人：陈坤

2、代销机构

(1) 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

(2) 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

(3) 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

(4) 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

(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) 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

(13) 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

(14) 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：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(15) 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

(16) 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

(17) 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.ectitic.com

(18) 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

(19) 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

(20) 申银万国证券

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 4008895523

公司网址：www.sywg.com.cn

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 中信证券（浙江）

联系地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

客户服务电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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

(34) 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：967777

公司网址：www.stocke.com.cn

(35) 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

(36) 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：4008188118

公司网址：www.guodu.com

(37) 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

(38) 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

(39) 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

(40) 宏源证券

联系地址：新疆乌鲁木齐建设路 2 号

客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(41) 齐鲁证券

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.qlzq.com.cn

(42) 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

(43) 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

(44) 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: 4008866567

公司网址: www.scstock.com

(45) 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

(46) 天源证券

联系地址: 深圳市民田路新华保险大厦 18 楼

客户服务电话: 400-654-3218

公司网址: www.tyzq.com.cn

(47) 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.com.cn

(48) 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.cscs.com.cn

(49) 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

(50) 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

(51) 英大证券

联系地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

客户服务电话: 400-018-8688

公司网址: www.ydsc.com.cn

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 上海长量基金销售

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

(59) 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

(60) 深圳众禄基金销售

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

(61) 天天基金网

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

(62) 杭州数米基金销售

联系地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

客户服务电话: 4000766123

公司网址: www.fund123.cn

(63) 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

(64) 上海好买基金销售

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: 400-700-9665

公司网站: www.ehowbuy.com

(65) 中期时代基金销售(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

(66) 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

(67) 万银财富(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: 400-808-0069

公司网址: www.wy-fund.com

(68) 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

(69) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

联系地址: 北京市朝阳区亮马桥路甲 40 号二十一世纪大厦 A 座 303

客户服务电话: 4008199868

公司网站: www.tdyhfund.com

(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: 李建生

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: 广东华瀚律师事务所

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗东路宝安广场 A 座 16 楼 G、H 室

办公地址: 深圳市罗湖区笋岗东路宝安广场 A 座 16 楼 G、H 室

法定代表人: 李兆良

经办律师: 杨忠、戴瑞冬

电话: 0755-82687860

传真: 0755-82687861

(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：单峰、魏佳亮

联系人：魏佳亮

四、基金的名称

本基金名称：宝盈增强收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式债券型基金

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，本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力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债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类金融工具和股票、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。

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。

基金的投资组合比例为：投资于固定收益类金融工具（含可转换债券）占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票等权益类金融工具占基金资产的比例为 0-20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股（含增发）申购以及二级市场股票投资之间的配置：

- ①基于对利率、信用等因素的分析，预测固定收益品种的风险和收益；
- ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断；
- ③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析，预测新股申购的风险和收益；
- ④股票市场走势的预测。

2. 固定收益品种投资策略

（1）固定收益品种的配置策略

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

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。

(2) 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。

本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。

(3) 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。

(4) 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。

3. 股票投资策略

(1) 新股（含增发）的投资策略

在参与股票一级市场投资的过程中，本基金管理人从行业景气度、成长性、核心竞争力等全面深入地把握上市公司基本面，运用宝盈基金的研究平台和股票估值体系，并参考同类公司的估值水平，深入发掘新股内在价值。并根据新股的中签率及上市后股价涨幅的统计，制定新股申购策略。

在新发股票获准上市后，本基金管理人将根据对股票内在价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，在新股上市后选择适当的时机卖出。

(2) 股票二级市场的投资策略

在股票二级市场投资方面，本基金根据研究部的估值模型，选出各个行业中具有核心竞争力、具有资源优势、具有高品牌价值、具有管理优势的龙头企业。本基金将根据企业业绩的长期

增长趋势以及同类企业的平均估值水平，应用本基金管理人设计的估值模型，选择价值被市场相对低估的企业进行投资。

4. 权证投资策略??

本基金将权证投资作为在严格控制风险前期下提高基金投资组合收益的辅助手段。本基金的权证投资策略包括：??

(1) 根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；??

(2) 在产品定价时，主要采用市场公认的多种期权定价模型以及研究人员对公司基本面等因素的分析基础上形成的对权证的合理定价；??

(3) 本基金权证投资策略包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等等。

5. 投资决策流程

图1 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，构建各级债券池和股票池，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供债券和股票决策支持；
- (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、重仓券种投资方案；
- (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，并报监察稽核部；
- (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。

6. 投资组合分析与调整

公司投资组合调整过程如图2。

图2 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进行调整，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；

研究员跟踪债券和个股因素，对已有的投资组合和债券池股票池中的证券进行动态评级，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

中信标普全债指数

中信标普全债指数涵盖国债、企业债、金融债、可转债，具有良好的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，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

本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金，高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告（截至2014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	25,783,135.31	2.80
	其中：股票	25,783,135.31	2.80
2	固定收益投资	821,002,590.10	89.08
	其中：债券	821,002,590.10	89.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	44,800,000.00	4.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,264,323.27	1.01
7	其他资产	20,785,810.21	2.26
8	合计	921,635,858.89	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,343,844.02	1.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,680.00	0.00
E	建筑业	15,673,525.00	3.57

F	批发和零售业	1,728,826.29	0.39
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,260.00	0.01
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	25,783,135.31	5.86

(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	600502	安徽水利	1,299,950	12,349,525.00	2.81
2	002399	海普瑞	199,910	4,987,754.50	1.13
3	600219	南山铝业	499,908	3,344,384.52	0.76
4	002482	广田股份	200,000	3,324,000.00	0.76
5	000025	特力A	140,213	1,728,826.29	0.39
6	603018	设计股份	1,000	32,260.00	0.01
7	603606	东方电缆	1,000	8,200.00	0.00
8	600917	重庆燃气	1,000	4,680.00	0.00
9	300401	花园生物	500	3,505.00	0.00

(四) 本报告期内按券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	117,312,879.90	26.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,799,000.00	6.78
	其中:政策性金融债	29,799,000.00	6.78
4	企业债券	342,516,164.10	77.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	321,732,000.00	73.18
7	可转债	9,642,546.10	2.19
8	其他	-	-
9	合计	821,002,590.10	186.75

(五) 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	010107	21国债(7)	811,340	82,594,412.00	18.79
2	122295	13川投01	400,000	40,720,000.00	9.26

3	122305	14 鲁高速	400,000	40,720,000.00	9.26
4	122103	11 航机 01	400,000	40,360,000.00	9.18
5	122187	12 玻纤债	400,000	40,000,000.00	9.10

(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序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国债期货交易情况说明

1、本期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

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十) 投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查；在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票中未有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	103,659.86
2	应收证券清算款	6,108,225.33
3	应收股利	-
4	应收利息	14,184,021.72
5	应收申购款	389,903.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,785,810.21

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	110020	南山转债	1,152,102.40	0.26
---	--------	------	--------------	------

东

78essences

5、报告期末前十名股票中存在流通受限

情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------------	--------------

流通受限情况说明

1	002482	广田股份	3,324,000.00	0.76	重大事项
2	603018	设计股份	32,260.00	0.01	新股流通受限
3	603606	东方电缆	8,200.00	0.00	新股流通受限

4 300401 花园生物 3,505.00 0.00 新股流通受限

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

本基金合同生效日为2008年5月15日，本基金于2008年10月20日起增加收取销售服务费的C类收费模式，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2014年9月30日）

宝盈增强收益债券A/B类：

阶段	净值增长率①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2008年	8.04%	0.13%	7.29%	0.12%	0.75%	0.01%
2009年	9.49%	0.22%	0.27%	0.06%	9.22%	0.16%
2010年	12.06%	0.39%	2.00%	0.07%	10.06%	0.32%
2011年	-5.34%	0.54%	3.79%	0.06%	-9.13%	0.48%
2012年	6.05%	0.49%	4.03%	0.04%	2.02%	0.45%
2013年	3.63%	0.13%	1.78%	0.05%	1.85%	0.08%
2014年上半年	6.21%	0.14%	3.87%	0.05%	2.34%	0.09%
过去三个月	2.91%	0.10%	1.66%	0.25%	1.25%	-0.15%

宝盈增强收益债券C类：

阶段	净值增长率①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2008年	3.56%	0.18%	2.65%	0.10%	0.91%	0.08%
2009年	9.07%	0.22%	0.27%	0.06%	8.80%	0.16%
2010年	11.62%	0.39%	2.00%	0.07%	9.62%	0.32%
2011年	-5.71%	0.54%	3.79%	0.06%	-9.50%	0.48%
2012年	5.70%	0.49%	4.03%	0.04%	1.67%	0.45%
2013年	3.22%	0.13%	1.78%	0.05%	1.44%	0.08%
2014年上半年	6.02%	0.14%	3.87%	0.05%	2.15%	0.09%
过去三个月	2.79%	0.10%	1.66%	0.25%	1.13%	-0.15%

十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

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) 销售服务费
- (4) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (5) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 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；

(10) 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 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

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

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) 销售服务费

宝盈增强收益 A/B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额计提的销售服务费年费率最高不超过 0.4%，销售服务费具体费率参见本基金公告或更新后的招募说明书，基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整对 C 类各级基金份额计提的销售服务费率。销售服务费将专门用于宝盈增强收益 C 类基金份额的销售与 C 类基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，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，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(4) 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（A类）：

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（B类）：

申购份额=申购金额/T日基金份额净值

销售费模式（C类）：

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。

费用种类 申购金额 M、持有年限 Y

前端申购费（A类） M<100万 0.8%

100万≤M<300万 0.5%

300万≤M<500万 0.3%

500万≤M 固定费用 1000元

后端申购费（B类） Y<1年 1.0%

1年≤Y<2年 0.7%

2年≤Y<3年 0.5%

3年≤Y<5年 0.3%

5年≤Y 0%

C类基金份额不收取申购费

2. 赎回费

前端（A类）：

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（B类）：

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

销售费模式（C类）：

赎回总金额=赎回份数×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

费率表如下：

费用种类 持有年限 Y

赎回费（A/B类） Y<1年 0.2%

1年≤Y<2年 0.1%

2年≤Y 0%

赎回费（C类） Y<30天 0.1%

30天≤Y 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。

3. 转换费

目前可在宝盈鸿利收益证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈资源优选股票型证券投资基金、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及宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈祥瑞养老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十二只基金之间实施转换。

1、基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成, 具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

(1) 基金转换申购补差费: 按照转入基金与转出基金的申购费的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费低于转入基金的申购费的, 补差费为转入基金的申购费和转出基金的申购费差额。转出基金金额所对应的转出基金申购费高于转入基金的申购费的, 补差费为零。

(2) 转出基金赎回费: 按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

2、转换份额的计算公式

转出金额=转入金额= $B \times C \times (1 - D) / (1 + G) + H$

转入份额=转入金额/E

其中:

B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

G 为对应的申购补差费率;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值;

H 为转出基金份额对应的未支付收益, 若转出基金为非货币市场基金的, 则 H=0

例: 投资者申请将持有的宝盈增强收益债券 A 10,000 份转换为宝盈核心优势混合 A(213006), 假设转换当日本基金的基金份额净值为 1.066 元, 投资者持有该基金 7 个月, 对应赎回费为 1.0%, 申购费为 0.8%, 宝盈核心优势混合 A 的基金份额净值为 1.163 元, 申购费为 1.5%, 则投资者转换后可得到的宝盈核心优势混合 A 基金份额为:

转出金额=转入金额= $10,000 \times 1.066 \times (1 - 1.0\%) / (1 + 0.7\%) + 0 = 10,480.04$ 元

转入份额= $10,633.35 / 1.163 = 9,011.21$ 份注: 转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

特别提示:

由宝盈增强收益债券 A、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技 30 混合转入宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈核心优势混合 A、宝盈资源优选股票、宝盈睿丰创新混合 A 时, 如果投资者的转入金额在 500 万(含)到 1000 万之间, 在收取基金转换的申购补差费时, 将直接按照转入基金的申购费收取, 不再扣减申购原基金时已缴纳的 1000 元申购费。

3、网上直销转换费率

根据本基金管理人 2014 年 5 月 7 日发布的《宝盈基金管理有限公司关于网上交易平台费率优惠方案调整的公告》, 投资人在本公司网上交易平台使用除招商银行直联渠道以外的支付渠道, 转换补差费率享受 1 折优惠; 使用招商银行直联渠道转换为其他前端收费基金的, 转

换补差费率享受 8 折优惠；标准转换补差费率为固定费用的，按标准费率执行。

目前网上直销支持的银行卡包括：中国建设银行、中国农业银行、中国银行、招商银行、交通银行、平安银行、广发银行、中国民生银行、中信银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行、中国工商银行、银联通（上海银联）支持银行卡、汇付“天天盈”支持银行卡。

基金管理人可以根据市场情况调整上述收费方式和费率水平，但最迟应于新收费办法开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

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，更新了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“（二）证券投资基金管理情况”、“（三）主要人员情况”的相应内容。
- 3、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人相应内容。
- 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“九、基金份额的非交易过户、转换、冻结与质押”部分，更新了基金份额的转换的相关内容。
- 6、在“十、基金的投资”部分，更新了本基金投资组合报告的内容。
- 7、在“十一、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 8、在“二十二、对基金份额持有人的服务”部分，更新了纸质对账单和定期定额投资计划的内容。
- 9、在“二十三、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

二〇一四年十二月二十七日