

宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017 年第 2 次)

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日期：二一七年十月

重要提示

根据 2014 年 8 月 8 日正式实施的证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金管理人于 2015 年 8 月 5 日发布《关于宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》，将本基金类型变更为混合型证券投资基金，基金名称变更为宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金，对应基金简称变更为宝盈泛沿海混合。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金资产，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代表将来业绩。

投资有风险，投资人购买基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。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其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；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人保证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。

本基金基金合同自 2005 年 3 月 8 日起正式生效。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2017 年 9 月 8 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日。基金托管人中国工商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

1、基金管理人基本情况

名称：宝盈基金管理有限公司

注册地址：深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501

成立时间：2001 年 5 月 18 日

法定代表人：李文众

总经理：张啸川

办公地址：深圳市福田区福华一路投行大厦 10 层

注册资本：10000 万元人民币

电话：075583276688

传真：075583515599

联系人：张志刚

2、基金管理人股权结构及组织结构

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。

公司设置公募基金投资决策委员会（试行）、专户投资决策委员会（试行）、风险管理委员会、信息技术治理委员会和产品委员会，并设置权益投资部、固定收益一部、固定收益二部、专户投资部、量化投资部、海外投资部、研究部、创新业务部、风险管理部、集中交易部、产品规划部、渠道业务部、机构业务部、市场营销部、互联网金融部、基金运营部、信息技术部、监察稽核部、公司财务部、人力资源部和总经理办公室等 21 个部室及北京办事处、上海办事处。

（二）主要人员情况

1、公司高级管理人员

（1）董事会

李文众先生，董事长，1959 年生，中共党员，经济师。1978 年 12 月至 1985 年 5 月在中国人民银行成都市支行解放中路办事处工作；1985 年 6 月至 1997 年 12 月在中国工商银行成都市信托投资公司任职，先后担任委托代理部、证券管理部经理；1997 年 12 月至 2002 年 11 月成都工商信托投资有限责任公司任职，历任部门经理、总经理助理；2002 年 11 月至今在中铁信托有限责任公司任副总经理。

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。

张栋先生，董事，1977 年生，硕士研究生。2000 年 8 月至 2001 年 5 月，在中国化工进出口总公司资产管理部投资一部任副总经理；2001 年 6 月至 2002 年 3 月，在中化进出口总公司投资部任项目经理；2002 年 3 月至 2003 年 2 月，在飞秒光电科技（西安）有限公司光通信事业部任总经理助理；2003 年 2 月至 2004 年 3 月，在中化国际（控股）股份有限公司冶金能源事业总部任项目经理；2004 年 3 月至 2009 年 5 月，在山西中化寰达事业有限责任公司任总经理；2009 年 6 月至 2010 年 7 月，在中化石油有限公司炼化事业部任高级项目经理；2010 年 7 月至 2011 年 2 月，在中国中化股份有限公司工程管理部控制部任副经理；2011 年 2 月至 2013 年 7 月，在中化石油有限公司油品销售南方事业部任副总经理；2013 年 7 月至 2014 年 1 月，在中国对外经济贸易信托有限公司资产管理一部工作；2014 年 1 月至 2014 年 7 月，在中国对外经济贸易信托有限公司资产管理三部任总经理；2014 年 7 月至 2016 年 7 月，在中国对外经济贸易信托有限公司基础产业部任总经理；2016 年 7 月至今，在中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部任总经理。

张苏彤先生，独立董事，1957 年生，中共党员，博士研究生。1975 年 12 月到 1978 年 3 月，在陕西重型机器厂任职；1982 年 7 月到 1985 年 9 月，在陕西省西安农业机械厂任助理工程师；1987 年 7 月到 1989 年 5 月，在陕西省西安农业机械厂任工程师、车间副主任；1989 年 5 月到 2000 年 4 月，在陕西财经学院财会学院任教授、系主任；2000 年 4 月到 2003 年 3 月，在西安交通大学会计学院任教授、系主任；2003 年 3 月到 2016 年 12 月在中国政法大学民商经济法学院财税金融法研究所任副所长、教授、研究生导师，2016 年 12 月至今在中国政法大学商学院会计研究所任教授、研究生导师。

廖振中先生，独立董事，1977 年生，法学硕士研究生。2003 年到 2014 年，在西南财经大学法学院任讲师；2014 年至今，在西南财经大学法学院任副教授。兼任四川亚峰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建设专家委员会成员。

王艳艳女士，独立董事，1980年生，中共党员，会计学博士。2007年8月到2008年8月，在美国休斯敦大学从事博士后研究工作；2008年6月到2010年12月，在厦门大学财务与会计研究院任助理教授；2011年1月到2014年7月，在厦门大学管理学院任副教授；2014年8月至今，在厦门大学管理学院任教授。

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。

张啸川先生，董事，1978年生，中共党员，经济学博士。2005年3月-2005年5月任职于中国证监会市场监管部结算监管处。2005年5月至2009年11月任职于中国证监会股权分置改革领导小组办公室。2009年11月至2011年8月担任中国证监会市场监管部市场监控处副处长。2011年8月至2012年5月担任中国证监会市场监管部综合处副处长。2012年5月至2015年7月担任中国证监会市场监管部交易监管处处长。2015年7月至2017年4月担任博时基金管理有限公司高级顾问兼北京分公司总经理、博时资本管理有限公司董事。2017年4月14日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。

刘郁飞先生，监事，1973年生，中国注册会计师、ACCA。曾就职于中国林业科学研究院、中林绿源科技有限责任公司、同新会计师事务所、中国德仁集团有限公司、毕马威华振会计师事务所。现任职于中国对外经济贸易信托有限公司审计稽核部。

魏玲玲女士，监事，1970年生，中级经济师。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监。

汪兀先生，监事，1983年生。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。

丁宁先生，副总经理，1976年生，硕士，高级经济师。1998年8月至2001年7月任职于安徽省马鞍山钢铁股份有限公司。2003年6月至2010年9月担任中铁信托有限责任公司综合管理部、人力资源部副总经理。2010年9月至2016年11月担任中铁信托有限责任公司综合管理部、人力资源部总经理。2015年12月加入宝盈基金管理有限公司，现任宝盈基金管理有限公司副总经理、党工委书记、纪工委书记、董事会秘书。2017年3月起兼任中铁宝盈资产管理有限公司董事长。

葛俊杰先生，副总经理，1973年生，硕士。曾任职于深圳市政府外事办公室、深圳市政府金融发展服务办公室。2007年加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、总经理办公室主任、专户投资部总监，现任副总经理、投资经理。

张新元先生，副总经理，1997年3月至2002年8月任职于黄河证券，2002年9月至2004年2月任职于民生证券，2004年3月至2011年6月任职于长城基金管理有限公司，2011年7月加入宝盈基金管理有限公司，历任总经理办公室主任、机构业务部总监、总经理助理，现任公司副总经理、创新业务部总监、投资经理。2017年8月起兼任中铁宝盈资产管理有限公司副董事长。

2、基金经理简历

盖俊龙先生，经济学硕士，2005年8月至2011年5月，在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011年6月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理，现任宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金和宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

高峰，2010年11月19日至2014年5月23日。

夏和平，2009年12月26日至2010年11月19日。

陆万山，2009年3月3日至2010年9月2日。

姚刚，2007年5月9日至2009年5月12日。

祝东升，2005年3月8日至2007年5月9日。

3、本基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

本公司公募基金投资决策委员会（试行）成员包括：

张啸川先生：宝盈基金管理有限公司总经理。

葛俊杰先生：宝盈基金管理有限公司副总经理、投资经理。

段鹏程先生：宝盈基金管理有限公司权益投资部总监、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金和宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈若劭女士：宝盈基金管理有限公司固定收益一部总监、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、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理。

张戈先生：宝盈基金管理有限公司研究部副总监。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2017年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工205人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承诚实信用、勤勉尽责的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年3月，中国工商银行共托管证券投资基金709只。自2003年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的53项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的职责基金托管人应当履行下列职责：

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部一手抓业务拓展，一手抓内控建设的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照内控优先的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立自控防线、互控防线、监控防线三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立以人为本的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从

而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的随机演练。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(五) 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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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：李文众

电话：0755-83275807、83275129

传真：0755-83515880

联系人：李依、梁靖

2、代销机构

(1) 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

(2) 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

(3) 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

(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

注册地：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) 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) 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

(10) 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

(11) 东莞农村商业银行

联系地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号

客服热线：0769-961122

公司网址：www.drcbank.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：8008108868

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.ecitic.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）申万宏源证券

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 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

（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.xyq.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) 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

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(29) 中信证券（山东）

联系地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融中心 1 号楼第 20 层（266061）

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(30) 东兴证券

联系地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

客户服务电话：4008888993

公司网址：www.dxzq.net

(31) 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

(32) 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

(33) 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

(34) 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

(35) 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

(36) 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

(37) 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

(38) 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

(39) 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

(40) 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

(41) 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：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(42) 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

(43) 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

(44) 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

（45）申万宏源西部证券有限公司

客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

（46）中泰证券

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.zts.com.cn

（474）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.csc.com.cn

（48）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

（49）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

（50）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：400-8866-567

公司网址：www.scstock.com

（51）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

（52）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

（53）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

（54）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

（55）九州证券

联系地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 D 座 5 层

客户服务电话：400-654-3218

公司网址: www.jzsec.com

(56) 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.cn

(57) 英大证券

联系地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十层

客户服务电话: 400-018-8688

公司网址: www.ydsc.com.cn

(58) 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

(59) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

联系地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

客户服务电话: 400-166-1188

公司网址: wen.wen@jrj.com.cn

(60) 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

(61) 上海长量基金

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

(62) 深圳众禄基金

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

(63) 上海天天基金

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

(64) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

联系地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

客户服务电话: 4000766123

公司网址: www.fund123.cn

(65) 上海好买基金

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: 4007009665

公司网址: www.ehowbuy.com

(66) 中期时代基金(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

(67) 众升财富(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: 400-059-8888

公司网址: www.wy-fund.com

(68) 上海汇付金融服务有限公司

联系地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

客户服务电话: 400-820-2819

公司网址: tty.chinapnr.com

(69) 唐鼎耀华

联系地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

客户服务电话: 400-819-9868

公司网址: www.tdyhfund.com

(70) 上海基煜基金销售有限公司

联系地址: 上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

客户服务电话: 021-65370077

公司网址: www.jiyu.com.cn

(71) 上海陆金所资产管理有限公司

联系地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

客户服务电话: 4008-219-031

公司网址: www.lufunds.com

(72) 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

客服电话: 4008-773-772

公司网址: www.5ifund.com

(73) 珠海盈米财富管理有限公司

联系地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

客服电话: 020-89629066

公司网址: www.yingmi.cn

(74) 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大街 11 号 11 层 1108

客户服务电话: 4006-199-059

公司网站: www.fundzone.cn

(75) 大泰金石投资管理有限公司

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

公司网站: www.dtfunds.com

(76) 上海凯石财富基金销售有限公司

联系地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

客服电话: 4006-433-389

公司网址: www.lingxianfund.com

(77) 上海利得基金销售有限公司

联系地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

客户服务电话: 400-067-6266

公司网址：www.leadfund.com.cn

(78) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

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

(79) 北京格上富信投资顾问有限公司

联系地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

(80) 浙江金观诚财富管理有限公司

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

客户服务电话：400-068-0058

网址：www.jincheng-fund.com

(81) 和耕传承基金销售有限公司

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层

客户服务电话：400-555-671

网址：www.hgccpb.com

(82) 北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

(83) 上海万得投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

客户服务电话：400-821-0203

(84) 深圳富济财富管理有限公司

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

客户服务电话：0755-83999907

公司网址：www.jinqianwo.cn

(85) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

客户服务电话：021-52822063

网址：www.66zichan.com

(86) 天津国美基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

客户服务电话：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

(87) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

客户服务电话：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

(88) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司

办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼

客户服务电话：400-810-5919

网址：www.fengfd.com

(89) 北京乐融多源投资咨询有限公司

办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

客户服务电话: 400-618-0707

网址: www.hongdianfund.com

(90) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

办公地址: 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

网址: www.cd121.com

(91) 上海中正达广投资管理有限公司

办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

客户服务电话: 400-6767-523

网址: www.zzwealth.cn

(92) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

办公地址: 深圳市南山区科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

客户服务电话: 400-9500-888

网址: www.jfzinv.com

(93) 奕丰金融服务(深圳)有限公司有限公司

办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115-1116 室

客户服务电话: 400-684-0500

网址: www.ifastps.com.cn

(94) 深圳新华信通资产管理有限公司

办公地址: 深圳市福田区深南大道 2003 号华嵘大厦 1808 单元

网址: www.xintongfund.com

(95) 北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

客户服务电话: 4000-618-518

网址: danjuanapp.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: 李文众

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: 上海源泰律师事务所

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人: 廖海

经办律师: 廖海、刘佳

电话: (021) 51150298

传真: (021) 51150398

(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：薛竞、周祎

联系人：周祎

四、基金的名称

本基金名称：宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金。

五、基金类别

本基金类型：契约型开放式混合型基金。

六、基金的投资目标

本基金通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司，有效分享中国经济快速增长的成果，在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。

七、基金的投资范围和对象

本基金投资对象为国内依法公开上市的股票、债券、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金财产中股票投资比例的变动范围为 60%—95%，债券投资比例的变动范围为 0—35%；现金或持有期限为 1 年以内政府债券的投资比例不低于 5%。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。本基金非现金资产中，不低于 80% 的资金将投资于在泛沿海区域注册的上市公司发行的证券。同时，本基金将根据区域经济发展情况、证券市场的阶段性变化，以不超过非现金资产 20% 的部分投资于泛沿海区域以外地区注册的、具有持续增长潜力的上市公司证券。

八、投资策略

本基金采取自上而下进行资产配置和行业及类属资产配置，自下而上精选个股的积极投资策略。

1、资产配置策略

在整体资产配置层面，本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。

2、区域资产及行业权重配置策略

在区域资产配置及行业权重层面，本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。

3、个股选择策略

在个股选择层面，本基金以 PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。具体选股程序为：

（1）区域选股

从沪、深两市所有 A 股中选择注册地在泛沿海区域的上市公司，剔除 ST、*ST 股票、亏损股票及正在接受监管部门调查的问题股票，构成本基金的泛沿海区域基础股票备选库；

（2）数量选股

将基础股票备选库中的所有股票，先按每股现金流量排序，选择每股现金流量较高的 70% 的股票，再从中选择预期 PEG 低于行业平均水平的股票构成投资股票备选库；投资股票备选库每年在 4 月 30 日上市公司年度报告出齐后整体调整一次，日常则可根据股票价格变动情况进行微调。

预期 PEG 值的计算公式如下：

其中：P 为计算日股票的收盘价，EPS 为上市公司最新年报的每股收益，为根据上市公司历史财务数据、实地调研、财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务利润增长率。

对于每年 5 月至下一年度 4 月上市的新股，本基金将其作为一个特殊资产分类，由基金管理人根据具体市场情况决定投资。

（3）基本面选股

由基金管理人的研究人员对投资备选股票库中的股票进行基本面价值评估，选择预期具有持续增长潜力的公司构建最终股票组合。

4、债券投资策略

本基金的债券投资采取主动投资策略，运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。

5、产品风险以及管理

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，属于中高收益/风险特征的基金。本基金运用宝盈量化风险管理系统和宝盈基金绩效评估系统进行风险管理。

6、投资决策

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、法规和基金契约的有关规定；

2、决策程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，投资决策程序如下：

（1）在基金合同规定的投资方向、投资理念和投资限制的范围内，基金经理根据公司投资部和外部专业研究机构对宏观经济、政策取向、市场趋势和特点进行的深入研究，在此基础上制定资产配置策略和投资策略建议，经过投资决策委员会讨论通过后作为进行整体资产配置的决策依据；

（2）公司投资部行业研究员和金融工程部数量分析研究员对上市公司进行详细分析、调研的基础上，构建基金投资备选库，推荐给基金经理。基金经理根据基金契约规定、整体资产配置方案，适当参考外部专业研究机构的投资建议报告，在公司统一的备选股票池中选择合适的投资品种。

（3）基金经理结合自己对市场的分析和判断制定投资组合草案，提交投资决策委员会审议。投资组合草案包括计划投资股票的清单和数量范围；

（4）投资决策委员会对基金经理的投资组合草案进行讨论和表决，通过后形成投资组合方案；如草案不获通过，基金经理负责对草案进行修改后，提交投资决策委员会继续讨论；

（5）基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，构建投资组合；

（6）金融工程部对投资组合进行风险评估，并将评估结果和调整建议向投资决策委员会反馈；

（7）投资决策委员会和基金经理根据市场变化和风险评估结果对基金投资组合进行调整。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

上证 A 股指数 80%+上证国债指数 20%

当市场出现合适的全市场统一指数时，本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。

十、基金的风险收益特征

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，属于中高收益/风险特征的基金。本基金运用宝盈量化风险管理系统和宝盈基金绩效评估系统进行风险管理。

十一、基金投资组合报告（截至 2017 年 6 月 30 日）

（一）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 1,131,655,733.44 85.71

其中：股票 1,131,655,733.44 85.71

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 187,866,836.16 14.23

8 其他资产 760,940.49 0.06

9 合计 1,320,283,510.09 100.00

（二）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 967,140,719.21 73.56

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 83,813,578.24 6.37

F 批发和零售业 18,249,702.72 1.39

G 交通运输、仓储和邮政业 43,290,000.00 3.29

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 18,837,431.58 1.43

J 金融业 187,943.49 0.01

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 41,847.12 0.00

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 40,688.48 0.00

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 53,822.60 0.00

S 综合 --

合计 1,131,655,733.44 86.07

(三) 基金投资前十名股票明细

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	000811	烟台冰轮	3,749,817	65,434,306.65	4.98
2	000830	鲁西化工	9,000,000	62,100,000.00	4.72
3	300403	地尔汉宇	3,320,000	60,357,600.00	4.59
4	300316	晶盛机电	4,678,800	58,438,212.00	4.44
5	603186	华正新材	1,350,000	57,739,500.00	4.39
6	601717	郑煤机	7,599,835	57,378,754.25	4.36
7	002051	中工国际	2,760,000	57,214,800.00	4.35
8	600089	特变电工	4,734,451	48,906,878.83	3.72
9	000820	神雾节能	1,100,000	41,778,000.00	3.18
10	600582	天地科技	8,199,999	37,637,995.41	2.86

(四) 按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

(五) 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

本基金本报告期末未持有债券

(六) 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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、报告期内，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未受到公开谴责、处罚。

2、本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票。

3、其他资产明细

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1 存出保证金 642,466.74

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 39,620.44

5 应收申购款 78,853.31

6 其他应收款 -

- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 760,940.49

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、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	601717	郑煤机	57,378,754.25	4.36	重大事项

6、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

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效日为 2005 年 3 月 8 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 2017 年 6 月 30 日)

阶段	净值增长率	净值增长标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
----	-------	---------	-----------	--------------

2005 年 3 月 8 日-2005 年 12 月 31 日	3.21%	0.57%	-7.41%	1.10%
---------------------------------	-------	-------	--------	-------

2006 年度	105.78%	1.40%	96.64%	1.08%
---------	---------	-------	--------	-------

2007 年度	97.67%	1.84%	72.93%	1.76%
---------	--------	-------	--------	-------

2008 年度	-54.07%	2.20%	-55.69%	2.28%
---------	---------	-------	---------	-------

2009 年度	35.43%	1.78%	61.36%	1.52%
---------	--------	-------	--------	-------

2010 年度	-24.04%	1.49%	-10.83%	1.14%
---------	---------	-------	---------	-------

2011 年度	-23.03%	1.22%	-16.85%	0.92%
---------	---------	-------	---------	-------

2012 年度	4.07%	1.32%	3.41%	0.87%
---------	-------	-------	-------	-------

2013 年度	13.46%	1.23%	-4.72%	0.92%
---------	--------	-------	--------	-------

2014 年度	21.56%	1.28%	42.12%	0.87%
---------	--------	-------	--------	-------

2015 年度	45.69%	2.97%	9.94%	1.96%
---------	--------	-------	-------	-------

2016 年度	-18.82%	2.10%	-8.96%	1.16%
---------	---------	-------	--------	-------

2017 年

上半年	-3.14%	1.05%	2.41%	0.44%
-----	--------	-------	-------	-------

十三、基金的费用概览

(一) 基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的证券交易费用；
- 4、基金合同生效后与本基金相关的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与本基金相关的会计师费和律师费；
- 7、银行汇划手续费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \times \text{当年天数}$$

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，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 9 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

（三）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资产的损失，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。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。

十四、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，更新了本基金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，更新了基金管理人概况、证券投资基金管理情况、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、基金的投资部分，更新了本基金投资组合报告的内容。
- 6、在十、基金的业绩部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 7、在二十二、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

二零一七年十月二十一日