宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈转型动力灵活配置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 2 月 4 日中国证监会证监许可[2015]205 号文注册募集。本基金基金合同于 2015 年 4 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》。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业,存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险,这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

本摘要根据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》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2018 年 10 月 29 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日。本招募说明书(更新)中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。

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 号深圳特区报业大厦 15 层

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 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:张志刚

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、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。

刘洪明先生,董事,1970 年生,硕士研究生。1996 年 9 月至 1997 年 3 月,在天津师范大学任职;1997 年 4 月至 2000 年 12 月,在中亚证券天津业务部任职;2002 年 8 月至 2011 年 4 月,在中化集团战略规划部任职;2011 年 5 月起加入中国对外经济贸易信托有限公司,先后担任战略管理部总经理、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等职务,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,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。现任职中国对外经济贸易信托有限公司运营稽核部(原内控稽核部、审计稽核部)总经理

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经理。

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经理、风险管理部总经理。

3、其他高级管理人员

李文众先生,董事长(简历请参见董事会成员)。

张啸川先生,总经理(简历请参见董事会成员)。

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 月起担任宝盈基金管理有限公司党工委、纪工委书记,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。

4、基金经理简历

黎晓晖先生,香港中文大学 MBA。2009 年 6 月至 2013 年 6 月任职于嘉实基金管理有限公司,担任交易员;2013 年 7 月至 2017 年 8 月任职于银华基金管理有限公司,先后担任研究员、投资经理。2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司。现任宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

宝盈转型动力灵活配置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:

盖俊龙,2016 年 8 月 20 日至 2017 年 12 月 9 日。

杨凯,2015 年 4 月 29 日至 2016 年 8 月 20 日。

5、本公司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成员包括:

丁宁先生(主席):宝盈基金管理有限公司副总经理。

张志梅女士(秘书长):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、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

葛俊杰先生(委员):宝盈基金管理有限公司副总经理、投资经理。

邓栋先生(委员):宝盈基金管理有限公司固定收益部总经理。

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。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人:周慕冰

成立日期:2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本:32,479,411.7 万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名,其中具有高级职称的专家 30 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2018 年 9 月 30 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 419 只。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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;业务管理实行严格的复核、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

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:李文众

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

2、代销机构

(1)中国农业银行股份有限公司

联系地址:北京东城区建国门内大街 69 号

客户服务电话:95599

公司网址:www.abchina.com

(2)中国工商银行股份有限公司

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

(3)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

(4)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

(5)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:bank.pingan.com

(6)东莞农村商业银行股份有限公司

联系地址:广东省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

(7)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 层

客户服务电话:95517

公司网址:www.essence.com.cn

(8)渤海证券股份有限公司

联系地址:天津市南开区宾水西道 8 号

客户服务电话:400-6515-988

公司网址:www.bhzq.com

(9)第一创业证券股份有限公司

联系地址:广东省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

(10)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 B 座 6、10、12、15、16 层

客户服务电话:95309

公司网址:www.dxzq.net

(11)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

(12)光大证券股份有限公司

联系地址:上海市静安区新闸路 1508 号

客户服务电话:95525

公司网址:www.ebscn.com

(13)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 层、20 层

客户服务电话:95396

公司网址:www.gzs.com.cn

(14)国信证券股份有限公司

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)平安证券股份有限公司

联系地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

客户服务电话:95511-8

公司网址:stock.pingan.com

(16)长城证券股份有限公司

联系地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

客户服务电话:400-6666-888

公司网址:www.cgws.com

(17)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:95579 或 4008-888-999

公司网址:www.95579.com

(18)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:4008-888-108、95587

公司网址:www.csc108.com

(19)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 39-45 层

客户服务电话:95565

公司网址: www.newone.com.cn

(20)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:95553、4008888001

公司网址:www.htsec.com

(21)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

(22)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

(23)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 47 楼

客户服务电话:40018-40028

公司网址:www.wkzq.com.cn

(24)中泰证券股份有限公司

联系地址:山东省济南市经七路 86 号

客户服务电话:95538

公司网址:www.zts.com.cn

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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.comn

(29)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:400-700-9665

公司网址:www.ehowbuy.com

(30)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.cn

(31)上海长量基金销售投资顾问有限公司

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

(32)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

(33)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

(34)珠海盈米财富管理有限公司

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

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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 号中青大厦七层楼

客户服务电话:400-066-8586

公司网址:www.igesafe.com

(42)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

(43)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

(44)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

(45)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

(46)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

(47)上海联泰资产管理有限公司

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

(48)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

(49)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

(50)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

(51)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

(52)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

(53)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.zzwealth.cn

(54)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

(55)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

(56)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.hotjijin.com

(57)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:400-1818-188

公司网址:www.1234567.com.cn

(58)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

(59)北京蛋卷基金销售有限公司

联系地址: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:400-159-9288

公司网址:danjuanapp.com

(60)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

(61)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.snjijin.com

(62)天津万家财富资产管理有限公司

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

(63)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(个人业务)、400-0888-816(企业业务)

公司网址:www.kenterui.jd.com

(64)北京植信基金销售有限公司

联系地址:北京市朝阳区四惠盛世龙源国食苑 10 号楼

客户服务电话:4006-802-123

公司网址:www.zhixin-inv.com

(65)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

(66)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 6997-719

公司网址:www.xiquefund.com

(67)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

(68)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

(69)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

(70)中民财富基金销售(上海)有限公司

客户服务电话:400-876-5716

公司网址:www.cmiwm.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

联系人:刘佳

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

四、基金的名称

本基金名称:宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式灵活配置混合型基金

六、基金的投资目标

本基金在对我国经济结构转型和产业升级进行深入研究的基础上,积极投资于符合经济发展趋势、质地良好的上市公司证券,在严格控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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,但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%,其中投资于转型动力主题相关的上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%;本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,可以做出相应调整。

八、基金的投资策略

本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。

(一)大类资产配置策略

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。主要考虑的因素包括:

1、宏观经济指标:年度/季度 GDP 增速、固定资产投资总量、消费价格指数、采购经理人指数、进出口数据、工业用电量、客运量及货运量等;

2、政策因素:税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策,利率水平、货币净投放等货币政策;

3、市场指标:市场整体估值水平、市场资金的供需以及市场的参与情绪等因素。

(二)股票投资策略

1、“转型动力”股票的界定

经济转型是我国经济发展的必经之路。在经济转型过程中,将会涌现出结构性投资机会。本基金将会以经济转型作为股票投资的主线,结合对上市公司基本面和估值水平的分析,重点投资受益于经济转型、具有较高成长性及盈利质量的行业及个股,力争实现基金资产的长期稳定增值。经济转型是一个多层次、长周期的过程,在这一过程中的相关领域及其上下游企业将在经济总量中处于支柱地位,经济转型的重点领域主要体现在以下三个方面:

第一,经济结构调整对应的提高消费服务占比,相关领域包括:食品饮料、家用电器等消费行业;医疗保健、金融保险、旅游、娱乐等服务行业。

第二,产业结构优化升级对应的新兴产业占比提升和传统产业的升级改造,相关领域包括:节能环保、高端装备制造、新能源、新材料、新一代信息技术和生物技术等新兴产业;农林牧渔、采掘、建筑、电力、交通运输和房地产等传统产业。

第三,区域结构优化对应的中西部经济占比及城镇化率的提高,相关领域包括:公用事业、机械设备、商业贸易、房地产、建筑建材等。

2、行业配置策略

在行业配置方面,本基金着重分析经济转型方向以及行业技术成熟度、行业所处生命周期、行业内外竞争空间、行业盈利前景、行业成长空间及行业估值水平等多层面的因素,在此基础上判断行业的可持续发展能力,从而确定本基金的行业配置。

3、个股精选策略

本基金在行业配置的基础上,通过定性分析与定量分析相结合的方法,精选优质上市公司进行投资。

(1)使用定性分析的方法,从竞争优势、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

竞争优势分析:一是考察上市公司的市场优势,包括市场地位和市场份额、在细分市场的领先地位、品牌号召力与行业知名度以及营销渠道的优势和潜力等;二是考察上市公司的资源优势,包括物质和非物质资源,例如市场资源、技术资源等;三是考察上市公司的产品优势,包括专利保护、产品竞争力、产品创新能力和产品定价能力等优势。

市场前景分析: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。

公司治理分析: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。

(2)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。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。

(三)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、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略,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)、同一市场的同一品种、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。

5、资产支持证券投资策略

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。

6、中小企业私募债券投资策略

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、收益率预测、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。

(四)权证投资策略

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具:

1、运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益;

2、构建权证与债券的组合,利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性,形成保本投资组合;

3、针对不同的市场环境,构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利模式;

4、在严格风险监控的前提下,通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究,谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

九、基金的业绩比较基准

中证 800 指数收益率×70% + 中证综合债券指数收益率×30%

中证 800 指数是由中证指数公司开发的中国 A 股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场。中证 800 指数成分股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成分股,综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况,具有一定权威性。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。本基金是混合型基金,基金在运作过程中将维持 0% - 95%的股票投资,其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。因此,“中证 800 指数收益率×70% + 中证综合债券指数收益率×30%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,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。

十一、基金投资组合报告(截至 2018 年 9 月 30 日)

1、期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,550,008,072.84	88.82
	其中:股票	1,550,008,072.84	88.82
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	79,990,239.99	4.58
	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	113,870,260.02	6.53
8	其他资产	1,256,637.09	0.07
9	合计	1,745,125,209.94	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,490,370.00	1.31
C	制造业	686,483,227.13	39.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,956,660.00	0.98
E	建筑业	108,232.20	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	141,889,382.00	8.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,862,773.78	9.75
J	金融业	352,313,191.25	20.46
K	房地产业	53,432,678.00	3.10
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	91,363,108.80	5.30
R	文化、体育和娱乐业	17,108,449.68	0.99
S	综合	-	-
	合计	1,550,008,072.84	89.99

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	002202	金风科技	8,100,731	97,289,779.31	5.65
2	002044	美年健康	5,302,560	91,363,108.80	5.30
3	600036	招商银行	2,692,024	82,618,216.56	4.80
4	300059	东方财富	7,200,298	81,003,352.50	4.70
5	600030	中信证券	3,972,548	66,301,826.12	3.85
6	601939	建设银行	8,926,989	64,631,400.36	3.75
7	000001	平安银行	5,767,300	63,728,665.00	3.70
8	002456	欧菲科技	4,416,400	59,577,236.00	3.46
9	601398	工商银行	9,884,600	57,034,142.00	3.31
10	300003	乐普医疗	1,869,676	56,744,666.60	3.29

4、期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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、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持有股指期货。

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

10、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持有国债期货。

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。

11、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除欧菲科技外未受到公开谴责、处罚。

欧菲科技股份有限公司(以下简称“欧菲科技”)于 2018 年 1 月收到《深圳证监局关于对欧菲科技股份有限公司采取监管谈话措施的决定》,主要原因是子公司苏州欧菲光科技有限公司在 2016 年 2 月 3 日与苏州市相城区签订框架性意向协议后未能及时的信息披露。考虑到上述投资协议的签署及后续投资未对公司的资产、负债、权益和经营成果产生重要影响,并且上市公司在短期也采取了签订《补充协议》并予以公告的补救措施,根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条第二项的规定,监管机构对公司采取了监管谈话的行政监管措施。

欧菲科技股份有限公司(以下简称“公司”)于 2018 年 5 月 14 日收到深圳证券交易所中小板公司管理部向公司出具的《关于对欧菲科技股份有限公司 2017 年年报的问询函》。后于 2018 年 6 月 1 日,公司披露《关于会计差错更正的公告》,称在 2017 年度报告中,误将控股股东业绩承诺补偿金额 220,233,953.14 元确认为营业外收入,对应的所得税影响 33,035,092.97 元确认为所得税费用。本次会计差错更正调减公司 2017 年度合并资产负债表未分配利润项目 179,097,645.74 元,调增资本公积项目 187,198,860.17 元,调减盈余公积项目 8,101,214.43 元;调减公司 2017 年度合并利润表营业外收入、所得税费用、净利润项目分别为 220,233,953.14 元、33,035,092.97 元、187,198,860.17 元,净利润项目调整金额占更正后当年净利润的比例为 22.8%。深圳交易所称上述行为违反了《股票上市规则(2018 年修订)》第 1.4 条和第 2.1 条的规定,因此给予监管关注。

本基金关注到以上事件是欧菲科技公司在管理细节上的问题,在事件发生后,欧菲科技也立即启动了签订补充协议的措施,事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注欧菲科技自身业务发展的同时,也会持续关注公司在公司治理方面的改善,并将公司治理加入到对该公司的长期价值评估中。

(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库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	962,803.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,892.11
5	应收申购款	235,941.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,256,637.09

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限。

(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。

十二、基金的业绩

本基金基金合同生效日为 2015 年 4 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 2018 年 9 月 30 日):

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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 4 月 29 日-2015 年 12 月 31 日	-11.40%	3.59%	-9.92%	1.95%	-1.48%	1.64%
2016 年	-17.61%	2.03%	-8.36%	1.07%	-9.25%	0.96%
2017 年	2.19%	0.90%	10.60%	0.46%	-8.41%	0.44%
2018 年上半年	-14.21%	1.21%	-8.67%	0.82%	-5.54%	0.39%
2018 年三季度	-8.28%	1.53%	-1.99%	0.92%	-6.29%	0.61%

十三、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的相关账户的开户及维护费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、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

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:

$H=E\times1.5\%\div$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。经管理人与托管人双方核对无误后,基金托管人于次月前 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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

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:

$H=E\times0.25\%\div$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。经管理人与托管人双方核对无误后,基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3-9 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

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)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

(六)与基金销售有关的费用

1、申购费

费 用	费率(设申购金额为 M)	
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

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%,按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下:

费 用	费率		
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%	

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 30 日发布的《宝盈转型动力灵活配置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“第二部分 释 义”部分,更新了银行业监督管理机构的相关释义。

3). 在“第三部分 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和主要人员情况的相应内容。

4). 在“第四部分 基金托管人”部分,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”部分,更新了代销机构的相应内容。

6). 在“第八部分 基金份额的申购与赎回”中,更新了申购与赎回的数额限制、基金转换的相应内容。

7). 在“第九部分 基金的投资”部分,更新了基金投资组合报告的内容。

8). 在“第十部分 基金的业绩”部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

9). 在“第二十二部分 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

二〇一八年十二月十二日