

宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

宝盈新价值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2014年2月19日中国证监会证监许可[2014]213号文注册募集。本基金基金合同于2014年4月10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本基金基金合同的当事人，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 2017 年 10 月 10 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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 - 83275889

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。

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管处副处长。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。

（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、创新业务部总经理、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

段鹏程先生，厦门大学生物学硕士。曾任职于厦门国际信托投资公司，天同证券深圳中心营业部总经理助理、副总经理，诺安基金管理有限公司基金经理，特定客户资产管理部总监。2004年5月加入宝盈基金管理有限公司，历任特定客户资产管理部投资经理、副总监，研究部核心研究员、副总监、总监，权益投资部总监。现任权益投资部执行总经理，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。

宝盈新价值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：

彭敢，2014年4月10日至2017年1月4日。

3、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（试行）成员包括：

张啸川先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

孙海波先生（秘书长）：权益投资部总经理、研究部总经理。

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。

段鹏程先生（委员）：宝盈基金管理有限公司权益投资部执行总经理、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。

陈若劲女士（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益一部总经理、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。

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基金经理。

高宇先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益二部副总经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理。

方佳佳女士（秘书）：宝盈基金管理有限公司研究员，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2017年6月30日，本集团总资产61,996.90亿元人民币，高级法下资本充足率14.59%，权重法下资本充足率11.85%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工74人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银

行奖”，“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006 年 3 月至 2008 年 6 月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008 年 6 月至 2012 年 6 月，任北京分行行长、党委书记；2012 年 6 月至 2013 年 11 月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013 年 11 月至 2014 年 12 月，任招商银行总行行长助理；2015 年 1 月起担任本行副行长；2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 6 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 301 只开放式基金。

（四）托管人的内部控制制度

1、 内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、 内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励

机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

（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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

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：李文众

电话：0755-83276688

传真：0755-83515880

联系人：李依、梁靖

2、代销机构

(1) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

服务热线：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(2) 中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(3) 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

网址：www.icbc.com.cn

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

客服热线：95599

公司网址：www.abchina.com

(5) 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

(6) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

(7) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

客服热线：95511-3

公司网址：bank.pingan.com

(8) 东莞农村商业银行

注册地址：广东省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

(9) 安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

客服电话：400-8001-001

公司网址：www.essence.com.cn

(10) 渤海证券股份有限公司

地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

客服热线：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

(11) 第一创业证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

客服热线：400-8881-888

公司网址：www.fcsc.cn

(12) 东兴证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

客服电话：4008888993

网址：www.dxzq.net

(13) 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闸路 1508 号

客服热线：95525

公司网址：www.ebscn.com

(14) 广州证券股份有限公司

办公地址：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：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

(15) 国信证券股份有限公司

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

客服热线：95536

公司网站：www.guosen.com.cn

(16) 平安证券股份有限公司

地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

客服热线：95511-8

公司网址：stock.pingan.com

(17) 长城证券股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

客服热线：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

(18) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

客户服务网站：www.95579.com

(19) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

客服热线：4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

(20) 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

(21) 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

(22) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

客服电话：400-059-8888

公司网址：www.wy-fund.com

(23) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

客服电话：400-910-1166

公司网站：www.cicc.com.cn

(24) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市经七路 86 号

联系人：许曼华

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(25) 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

(26) 深圳众禄金融控股股份有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行 25 层 IJ 单元

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

(27) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

客服电话：400-819-9868

公司网址：www.tdyhfund.com

(28) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(29) 上海基煜基金销售有限公司

地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

客服电话：021-65370077

传真：021-55085991

公司网址：www.jiyu.com.cn

(30) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

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：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

(31) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：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

网址：www.lufunds.com

(32) 浙江同花顺基金销售有限公司

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

(33) 珠海盈米财富管理有限公司

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

(34) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

公司网站：www.fundzone.cn

客户服务电话：4006-199-059

(35) 大泰金石投资管理有限公司

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

公司网站：www.dtfunds.com

客户服务电话：400-928-2266

(36) 上海凯石财富基金销售有限公司

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

(37) 上海利得基金销售有限公司

办公地址：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

网址：www.leadfund.com.cn

(38) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：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

网址：www.jrj.com.cn

(39) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋

客户服务电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(40) 北京格上富信投资顾问有限公司

办公地址：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

网址：www.igesafe.com

(41) 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

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 奕丰金融服务（深圳）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

(55) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：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

(56) 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

客服热线：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(57) 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

客户服务电话：010-56202920

网址：www.xintongfund.com

(58) 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

(59) 上海挖财金融信息服务有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

客户服务电话：400-711-8718

网址：www.wacaijijin.com/contact

（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

传真：（021）23238800

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：宝盈新价值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

本基金以超越业绩比较基准为目标，在严格控制下行风险的基础上进行有效的资产配置与投资标的精选，力争实现资产的稳定增值。

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%，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%，本基金投资于权证及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，具体投资比例和限制等将另行公告。

八、基金的投资策略

本基金将实施积极主动的投资策略，运用多种方法进行资产配置。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个部分组成。

（一）大类资产配置策略

本基金大类资产配置的策略目标是一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。

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。研判宏观形势的过程中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。

基金管理人将结合以上因素以及对全球宏观经济的研判，并且参考 Black-Litterman

Model 和美林投资时钟等大类资产配置模型，在严格控制投资组合风险的前提下，动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例，力图规避市场风险，提高配置效率。

为了达到投资目标，本基金将采取审慎的配置策略，严防过于激进的投资决策。在通过以上指标与模型难以准确判断市场方向的时期，本基金将采取缩短固定收益类组合久期和降低股票仓位等方法最大限度的规避下行风险。

（二）股票投资策略

本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式构建备选股票库。

1、行业配置策略

本基金的行业配置策略以规避下行风险、降低组合波动率为目标，结合基金管理人对波动率、相关性的定量研究，同时参考内部与外部的定性研究成果，做出行业配置决策。

在进行行业配置的过程中，基金管理人主要关注的指标包括但不限于：由行业盈利对经济周期的敏感度定义的行业周期属性、行业景气度指标（行业销售收入增长率、行业毛利率和净利率、原材料和成品价格指数以及库存率等）、行业估值指标（P/E，P/B，EV/EBITDA等），以及投资者情绪等。

2、个股精选策略

本基金主要采取“自下而上”的选股策略，备选股票库的构建由定量筛选和定性筛选两部分组成。

（1）首先，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备选库。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。

(2) 其次，使用定性分析的方法，从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行进一步的精选。

持续成长性的分析。通过对上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入研究，评估具有持续成长能力的上市公司。具体为：产能利用率、原材料的自给率、生产规模在行业的占比较高；公司产品核心竞争力、营销渠道、品牌竞争力等方面在行业中表现较强；公司的主营业务收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率、每股收益增长率等方面在行业中具有领先优势。

在市场前景方面，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。

(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、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略，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）、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。

5、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。

6、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。

（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

沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深 300 指数选样科学客观，流动性高，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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，而无需召开基金份额持有人大会。

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2017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	1,388,735,881.79	91.05
	其中：股票	1,388,735,881.79	91.05
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	135,592,009.60	8.89
8	其他资产	911,828.45	0.06
9	合计	1,525,239,719.84	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	39,793.60	0.00
C	制造业	1,144,250,207.19	75.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	73,555.60	0.00
F	批发和零售业	26,380.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,741,468.03	2.56
J	金融业	158,107,409.00	10.43
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	81,588.27	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	51,196.08	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	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	47,192,317.78	3.11
S	综合	-	-
	合计	1,388,735,881.79	91.60

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	002773	康弘药业	2,174,316	113,042,688.84	7.46
2	603589	口子窖	1,600,000	78,208,000.00	5.16
3	300476	胜宏科技	3,000,000	75,900,000.00	5.01
4	600884	杉杉股份	3,058,502	73,771,068.24	4.87
5	601601	中国太保	1,981,300	73,169,409.00	4.83
6	000063	中兴通讯	2,499,900	70,747,170.00	4.67
7	002050	三花智控	4,200,000	67,536,000.00	4.45
8	002236	大华股份	2,800,000	67,396,000.00	4.45
9	600549	厦门钨业	2,089,319	67,129,819.47	4.43
10	000970	中科三环	3,200,000	57,312,000.00	3.78

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发行主体中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库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	528,374.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,875.17
5	应收申购款	354,578.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	911,828.45

(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的股票。

(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 2014 年 4 月 10 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 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
2014 年 4 月 10 日-2014 年 12 月 31 日	15.30%	0.27%	37.26%	0.79%	-21.96%	-0.52%
2015 年度	123.09%	3.29%	6.94%	1.61%	116.15%	1.68%
2016 年	-18.36%	2.08%	-7.51%	0.91%	-10.85%	1.17%
2017 年上半年	-3.65%	0.82%	6.13%	0.38%	-9.78%	0.44%
2017 年三季度	5.13%	1.10%	2.96%	0.38%	2.17%	0.72%

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:

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金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：

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

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。经基金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。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与托管人核对无误后，自产品成立一个月内由托管人从基金财产中划付，如资产余额不足支付该开户费用，由管理人于产品成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，托管人不承担垫付开户费用义务。

4、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调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

(五) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

(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<50万	1.50%
	50万≤M<200万	1.00%
	200万≤M<500万	0.80%
	M≥500万	固定费用 1000 元

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<3个月	0.50%	75%计入基金资产
	3个月≤持有期限<6个月	0.50%	50%计入基金资产
	6个月≤持有期限	0.25%	25%计入基金资产

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 2014 年 5 月 28 日发布的《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金开放日常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》、《公开募集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。
- 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，更新了直销机构和代销机构相应内容。
- 5、在“九、基金的投资”部分，更新了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
二〇一七年十一月二十二日