

宝盈安泰短债债券型证券投资基金

更新招募说明书摘要

宝盈安泰短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 8 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予宝盈安泰短债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2018〕1371 号）进行募集。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。

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。投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、债券收益率曲线变动风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规风险、人员流失风险、本基金的特定风险等。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券。中小企业私募债券存在因市场交易量不足而不能迅速、低成本地转变为现金的流动性风险，以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险，可能影响基金资产变现能力，造成基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则，审慎参与中小企业私募债券的投资，严格控制中小企业私募债券的投资风险。

本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产所产生的现金流或权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，可能面临信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险低于股票型基金、混合型基金，

高于货币市场基金。

本基金发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于发售面值，基金投资可能出现亏损。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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》。

本基金本次更新招募说明书对基金合同变更的相关信息进行更新，基金合同变更相关信息截止日为2019年12月9日。本招募说明书有关财务数据和净值表现截止日为2019年9月30日，其他所载内容截止日为2019年11月25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、涉及托管业务相关的更新信息已经基金托管人复核。

招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

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：马永红

总经理：杨凯

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：邹明睿

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和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、公司董事、监事及高级管理人员

（1）董事会

马永红先生，董事长。曾任中铁三局集团有限公司会计员、科长、处长、高级会计师、总会计师等职务；中铁置业集团有限公司董事、财务总监、副总经理。现任中铁信托有限责任公司党委书记、董事长；宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人）。

李文众先生，董事。曾任中国人民银行成都市支行解放中路办事处职员；中国工商银行成都市信托投资公司委托代理部、证券管理部经理；成都工商信托投资有限责任公司部门经理、总经理助理；中铁信托有限责任公司副总经理；宝盈基金管理有限公司董事长。现任中铁信托有限责任公司副巡视员；宝盈基金管理有限公司董事。

陈恪先生，董事。曾任中铁信托有限责任公司研究发展部职员、部门总经理助理。现任中铁信托有限责任公司证券投资部副总经理（主持工作）。

刘洪明先生，董事。曾任天津师范大学助教；中亚证券天津业务部部门经理；中化集团战略规划部职员；中国对外经济贸易信托有限公司战略管理部总经理、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。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。曾任职于陕西重型机器厂、陕西省西安农业机械厂、陕西省西安农业机械厂、陕西财经学院、西安交通大学。现任中国政法大学商学院高层管理教育中心（EEP）主任，中国政法大学商学院财务会计系教授，中国政法大学法务会计研究中心主任；中国会计学会会员（CFE）兼北京分会副会长，中国注册会计师协会法务会计师认证项目专家小组副组长，北京注册会计师协会法律专家小组副组长，教育部学位与研究生教育发展中心学位论文评议专家，国家自然科学基金委项目同行评议专家，国家社会科学基金委项目同行评议专家。

廖振中先生，独立董事。曾任西南财经大学法学院讲师。现任西南财经大学法学院副教授，四川诚方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设计专家委员会成员。

王艳艳女士，独立董事。曾任美国休斯敦大学博士后；厦门大学财务与会计研究院助理教授；厦门大学管理学院副教授。现任厦门大学管理学院教授。

徐加根先生，独立董事。曾任职于中国石化。现任西南财经大学教授、金融创新与产品设计研究所副所长。

杨凯先生，董事。曾任湖南工程学院教师；振远科技股份有限公司销售经理；宝盈基金管理有限公司市场开发部总监、特定客户资产管理部总监、公司总经理助理、研究部总监、基金经理、公司副总经理；中融基金管理有限公司总经理。现任宝盈基金管理有限公司总经理、经营管理层董事。

（2）监事会

陈林先生，监事会主席。曾任中铁二局会计员、项目财务主管、云南分公司财务科长、机电公司财务部长、副总会计师；中曼投资有限公司副总经理；中铁二局地产集团郫县项目副总经理、财务总监；中铁置业长沙公司副总经理、财务总监；成都分公司副总经理、财务总监。现任中铁信托有限责任公司内控审计部副总经理（主持工作）。

王法立先生，监事。曾任中国对外经济贸易信托有限公司财富管理中心管理部产品经理、投资管理部信托经理；诺安基金管理有限公司董事会秘书。现任中国对外经济贸易信托有限公司投资管理事业部-股权管理部副总经理（主持工作）。

魏玲玲女士，监事。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。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）高级管理人员

马永红先生，董事长（简历请参见董事会成员）。

杨凯先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

邹纯余先生，副总经理。曾任职于中铁二局、中铁信托有限责任公司。现任宝盈基金管理有限公司党委书记、副总经理、工会主席、董事会秘书。

葛俊杰先生，副总经理。曾任深圳市政府外事办公室主任科员；深圳市政府金融发展服务办公室主任科员、副处长；宝盈基金管理有限公司研究员、总经理办公室主任、专户投资部总监、投资经理。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。

张磊先生，督察长。曾任职于广东茂名石化公司、新疆邮政储汇局、新疆邮政局、中国证监会新疆监管局、华融证券股份有限公司、上海石上投资管理有限公司。现任宝盈基金管理有限公司督察长、纪委书记。

张献锦先生，首席信息官。曾任职于铁道部株洲车辆厂、深圳大学通信技术研究所、中国平安保险（集团）股份有限公司、博时基金管理有限公司。现任宝盈基金管理有限公司首席信息官兼信息技术部总经理。

2、基金经理简历

邓栋先生，清华大学土木工程硕士，具有9年证券从业经历。2008年3月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自2010年1月至2017年8月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017年8月加入宝盈基金管理有限公司，现任固定收益部总经理，宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

高宇先生，厦门大学投资学硕士。2008年6月至2009年8月任职于第一创业证券资产管理部，担任研究员；2009年8月至2010年10月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师，获首届金牛分析师第五名（团队）；2010年10月至2016年6月任职于博时基金，先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理，并负责信用团队；2016年7月至2017年8月任职于天风证券，担任机构业务总部总经理助理。2017年8月加入宝盈基金管理有限公司。现任宝盈基金固定收益部副总经理，宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰

短债债券型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理。

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成员包括：

杨凯先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

葛俊杰先生（委员）：宝盈基金管理有限公司副总经理。

张志梅女士（委员）：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和宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

邓栋先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益部总经理，宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券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、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈中证100指数增强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、宝盈品牌消费股票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。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

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2019年9月30日，本集团总资产73,059.25亿元人民币，高级法下资本充足率15.44%，权重法下资本充足率12.86%。

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，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工87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）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

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，推出国内首个托管大数据平台，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”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“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月招商银行再度荣膺《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”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

（二）主要人员情况

李建红先生，招商银行董事长、非执行董事，2014年7月起担任招商银行董事、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，招商银行行长、执行董事，2013年5月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。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。

汪建中先生，招商银行副行长。1991年加入招商银行；2002年10月至2013年12月历任招商银行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任招商银行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任招商银行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任招商银行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任招商银行副行长。

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2019年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管510只证券投资基金。

（四）托管人的内部控制制度

1、 内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，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；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：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、 内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

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

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，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能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管

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。

(6) 防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

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

(8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、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。

4、 内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、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在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(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、托管业务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，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，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管理。

(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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等

情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人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支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，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律法规及基金合同允许的调整期限。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。基金管理人对于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。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

直销机构：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

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

法定代表人：马永红

总经理：杨凯

成立日期：2001 年 5 月 18 日

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

公司网站：www.byfunds.com

（二）其他相关机构

1、注册登记机构

登记机构名称：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

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

法定代表人：马永红

联系人：陈静瑜

电话：0755-83276688

传真：0755-83516044

2、代销机构

(1) 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

(2) 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

(3) 中国银行股份有限公司

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

(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) 招商银行股份有限公司

联系地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(6) 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：www.bank.pingan.com

(7) 东莞农村商业银行股份有限公司

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

(8) 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

（9）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：4008888108、95587

公司网址：www.csc108.com

（10）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 A 座 39—45 层

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（11）中信证券股份有限公司

联系地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

客户服务电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（12）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：4008888001、95553

公司网址：www.htsec.com

（13）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

（14）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：4008888999、95579

公司网址：www.95579.com

（15）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 楼

客户服务电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

(16) 万联证券股份有限公司

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：95322

公司网址：www.wlzq.com.cn

(17) 渤海证券股份有限公司

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：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

(18) 中信证券（山东）有限责任公司

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

客户服务电话：0532-85022313

公司网址：www.zxwt.com.cn

(19) 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）6、10、12、15、16 层

客户服务电话：95309

公司网址：www.dxzq.net

(20) 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

(21) 长城证券股份有限公司

联系地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

客户服务电话：4006666888

公司网址：www.cgws.com

(22) 光大证券股份有限公司

联系地址：上海市静安区新闻路 1508 号

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(23) 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 楼、20 楼

客户服务电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(24) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

(25) 平安证券股份有限公司

联系地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

客户服务电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

(26) 东海证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

客户服务电话：95531、400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

(27) 申万宏源西部证券有限公司

联系地址：新疆乌鲁木齐市新市区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(28) 中泰证券股份有限公司

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

(29) 第一创业证券股份有限公司

联系地址：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

(30) 财通证券股份有限公司

联系地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、

1701-1716

客户服务电话：95336

网址：www.ctsec.com

(31) 西藏东方财富证券股份有限公司

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

客户服务电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

(32) 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

(33) 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

(34) 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 号泛利大厦 10 层

客户服务电话：010-85650688

公司网址：www.hexun.com

(35) 江苏汇林保大基金销售有限公司

联系地址：南京市新街口中山东路 9 号天时国际商贸大厦 11 楼 E 座

客户服务电话：025-56663409

公司网址：www.huilinbd.com

(36) 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

(37) 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：400-699-7719

公司网址：<http://www.xiquefund.com/>

(38) 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

(39) 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

(40) 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

(41) 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：95021 或 400-181-8188

公司网址：www.1234567.com.cn

(42) 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：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

(43) 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

(44) 上海长量基金销售有限公司

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.cn

(45) 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

(46) 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

(47) 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.snjjin.com

(48) 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

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

(49) 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

(50) 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

(51) 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.com

(52) 北京植信基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙苑 10 号楼 10 号

客户服务电话：4006-802-123

公司网址：www.zhixin-inv.com

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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

(59) 上海联泰基金销售有限公司

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

(60) 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.

(61) 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

(62) 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.zhongzhengfund.com

(63) 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

(64) 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

(65) 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

(66) 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

(67) 珠海盈米基金销售有限公司

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

(68) 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

(69) 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

(70) 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

(71) 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

公司网址：www.kenterui.jd.com

(72) 中民财富基金销售（上海）有限公司

联系地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

客户服务电话：400-876-5716

公司网址：www.cmiwm.com

(73) 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

(74) 北京蛋卷基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层 7

客户服务电话：400-159-9288

公司网址：danjuanapp.com

(75) 万家财富基金销售有限公司

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

(76) 联储证券有限责任公司

联系地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

客户服务电话：400 620 6868

公司网址：www.lczq.com

3、律师事务所和经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

4、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：宝盈安泰短债债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金重点投资短债主题证券，在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公开发行的次级债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、资产支持证券、货币市场工具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。

本基金不参与股票、权证等权益类资产投资，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得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。

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，基金管理人可在履行适当程序后，做出相应调整。

本基金所指的短债主题证券是指剩余期限不超过1年（含）的债券资产，主要包括国内依法发行上市的国债、金融债、公开发行的次级债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券等金融工具。

八、基金的投资策略

本基金采用的投资策略主要包括：债券资产配置策略、组合久期策略、行业配置策略、公司配置策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债投资策略等。

1、债券资产配置策略

本基金主要通过以下几个方面研究，确定组合杠杆率、存单及信用类债券的配置比例。

（1）宏观经济变量（包括但不限于宏观增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业

周期等)、流动性条件、行业基本面等研究;

(2) 银行存单及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究;

(3) 宏观流动性环境及货币市场流动性研究;

(4) 大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。

2、组合久期策略

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。

3、行业配置策略

基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法,并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究,本基金以分散化配置模式为基础,实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异,在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上,合理地决定不同行业的配置比例。

4、公司配置策略

基于公司价值研究的重要性,本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况,在充分考虑组合流动性特征的前提下,结合行业周期研究,甄别具有估值优势、基本面改善的公司,以分散化配置模式为基础策略。

5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

6、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债券票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征,选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证短债指数收益率×80%+活期存款利率（税后）×20%

中证短债指数是综合反映银行间和交易所市场剩余期限在1年以下的国债、金融债、企业债、央行票据和短期融资券的整体价格变动趋势的指数。本基金投资于短债主题证券（指剩余期限不超过1年的债券资产）比例不低于非现金基金资产的80%，选择上述指数作为本基金的业绩比较基准能够比较准确地体现本基金的投资目标。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准的构成因子停止发布或变更名称，本基金管理人可以在符合法律法规的规定和基金合同的约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险低于股票型基金、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2019年9月30日）

1、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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,280,384,800.00	97.34
	其中：债券	2,280,384,800.00	97.34
	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	18,339,096.44	0.78
8	其他资产	43,908,112.42	1.87
9	合计	2,342,632,008.86	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,999,000.00	0.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,380,000.00	6.96
	其中：政策性金融债	129,380,000.00	6.96
4	企业债券	197,691,000.00	10.63
5	企业短期融资券	1,468,761,000.00	79.00
6	中期票据	474,553,800.00	25.52
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,280,384,800.00	122.66

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101759033	17 苏国资 MTN001	600,000	60,726,000.00	3.27
2	101575001	15 金融街 MTN001	500,000	50,595,000.00	2.72
3	101464018	14 湘高速 MTN001	500,000	50,570,000.00	2.72
4	112556	17 广发 02	500,000	50,495,000.00	2.72
5	011901633	19 国新控股 SCP008	500,000	50,035,000.00	2.69

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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

本基金本报告期末投资国债期货。

10、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 17 广发 02 的发行主体广发证券股份有限公司外未受到公开谴责、处罚。

2018 年 12 月 3 日，浙江证监局对广发证券股份有限公司台州白云山西路证券营业部采取责令改正措施，指出该营业部在 2017 年 9 月 30 日之前存在从业人员替客户办理证券交易操作、私自违规为客户的融资活动提供便利、营业部现场使用和管理电脑等设备不符合公司内部管理规定等问题，反映出该营业部内部控制存在薄弱环节，经营管理存在风险。上述情形违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款、《证券经纪人管理暂行规定》第十三条的有关规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，决定责令该营业部限期对上述问题进行改正，达到如下要求：营业部要切实加强从业人员执业行为管理，督促从业人员勤勉尽责，防范从业人员从事违法违规、超越权限的业务行为，进一步夯实内部控制，提升合规水平，做好风险管理，维护客户合法权益。

2019 年 3 月 27 日，广东证监局向广发证券股份有限公司出具《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]20 号），指出公司存在对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定；广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，决定对公司采取责令改正的行政监管措施，公司应于 2019 年 6 月 30 日之前予以改正，并向广东局提交书面整改报告。具体整改措施包括：一是充分履行股东职责，依法参与境外子公司的法人治理，健全对境外子公司的风险管控，形成权责明确、流程清晰、制衡有效的管理机制。二是加强信息系统投入和人员配备，提高合规风控与内部控制管理水平。三是建立健全对境外子公司的稽核审计制度，检查和评估境外子公司内部控制的有效性等。四是严格追究导致境外子公司出现重大风险的相关责任人员责任，并向广东局书面报告问责结果。公司应切实采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

2019 年 4 月 22 日，广东证监局向广发证券股份有限公司出具《关于对广发证券股份有

限公司采取责令改正措施的决定》(广东监管局行政监管措施决定书[2019]28号),指出公司存在以低于成本价格参与公司债券项目投标的情形,违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条、第三十八条的规定。依照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条、第六十三条第一项规定的规定,决定对公司采取责令改正的行政监管措施。公司应于2019年5月30日前予以改正,并提交书面整改报告。公司应严格追究相关责任人员责任,并认真吸取教训,切实加强债券承销业务尤其是承揽环节的内部控制,严格遵守执业规范和监管规则。

2019年8月5日,中国证监会广发证券股份有限公司出具《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》,指出公司存在以下问题:一是对广发控股(香港)有限公司(以下简称广发控股香港或者香港子公司)风险管控缺失,包括对香港子公司新业务风险管控不足,风控系统未实现对香港子公司风险数据的全覆盖,对香港子公司风控要求执行情况的监督检查力度不够等;二是对广发控股香港合规管理存在缺陷,对香港子公司合规管理有效性缺乏监督;三是对广发控股香港内部管控不足,包括财务、组织架构管控不力等;四是作为数据报送的责任主体,未做好广发控股香港月度数据统计工作,向我会报送的数据不准确。上述情况违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、第六十九条,《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第二十四条,《证券公司风险控制指标管理办法》第六条,《证券公司全面风险管理规范》第十八条、第二十二、第三十一条的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,决定对公司采取限制增加场外衍生品业务规模6个月、限制增加新业务种类6个月的行政监管措施。

本基金投资17广发02的投资决策程序符合公司投资制度的规定,同时认为相关处罚措施对公司的正常经营影响可控,对偿付能力不会产生负面影响。后续将持续关注公司在内控治理方面的改善。

(2) 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,329.49
2	应收证券清算款	13,990,027.22
3	应收股利	-
4	应收利息	28,075,202.77
5	应收申购款	1,831,552.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	43,908,112.42

(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

本基金本报告期末未持有股票。

(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 2018 年 12 月 7 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 2019 年 9 月 30 日)

宝盈安泰短债债券 A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
2018 年 12 月 7 日至 2018 年 12 月 31 日	0.19%	0.02%	0.10%	0.01%	0.09%	0.01%
2019 年 上半年	2.45%	0.02%	1.37%	0.01%	1.08%	0.01%
2019 年 三季度	0.99%	0.01%	0.66%	0.01%	0.33%	0.00%

宝盈安泰短债债券 C

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
2018 年 12 月 7 日至 2018 年 12 月 31 日	0.17%	0.02%	0.10%	0.01%	0.07%	0.01%
2019 年 上半年	2.31%	0.02%	1.37%	0.01%	0.94%	0.01%
2019 年 三季度	0.92%	0.01%	0.66%	0.01%	0.26%	0.00%

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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的业绩基准使用费（若有）；
- 11、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月初五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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月初五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。费用自动扣划后，基金管理

人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。

本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月初五个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第4—11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

下列费用不列入基金费用：

- 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。

(六)与基金销售有关的费用

1、申购费率

本基金A类基金份额在申购时收取申购费，C类基金份额在申购时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金A类基金份额的申购费率随申购金额的增

加而递减，如下表所示：

费用类别	费率（设申购金额为 M）	
申购费	M<100 万	0.40%
	100 万≤M<500 万	0.20%
	M≥500 万	固定费用 1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的申购费用由投资人承担，在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。投资人重复申购的，适用费率按单笔分别计算。

2、赎回费率

本基金赎回费率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：

费用类别	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	0.10%	25%计入基金资产
	持有期限≥30 日	0%	---

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在投资人赎回本基金份额时收取，其中未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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2019年1月4日发布的《宝盈安泰短债债券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》、《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》、《公开募集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、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定和本公司于 2019 年 12 月 9 日发布的《宝盈基金管理有限公司旗下四只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的公告》更新了招募说明书的有关内容。

2、在“重要提示”部分，更新了本招募说明书所载各项内容的截止时间。

3、在“第三部分 基金管理人”中，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”中，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”中，更新了销售机构的相应内容。
- 6、在“第九部分 基金的投资”中，更新了基金投资组合报告的相应内容。
- 7、在“第十部分 基金的业绩”中，更新了基金的投资业绩。
- 8、在“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”中，更新了网上交易服务的相关内容。
- 9、在“第二十二部分 其他应披露事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司

二〇一九年十二月九日