

宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

宝盈科技 30 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 6 月 10 日中国证监会证监许可〔2014〕580 号文注册募集。本基金基金合同于 2014 年 8 月 13 日正式生效。

重要提示

基金管理人保证本基金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。

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。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书及本基金基金产品资料概要，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险、投资科创板股票存在的风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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。

本基金资产投资于科创板股票，将面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规

则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、退市风险、流动性风险、投资集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

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 2019 年 12 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 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：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

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基金管理人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

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。

4、基金经理简历

张仲维先生，台湾政治大学国际贸易硕士。曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司国际部研究员、基金经理，华润元大基金管理有限公司研究员、基金经理；自2015年5月

加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员、投资经理，现任宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金、宝盈人工智能主题股票型证券投资基金基金经理。

宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

彭敢：2014 年 8 月 13 日至 2017 年 1 月 4 日。

5、投资决策委员会

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、宝盈祥颐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。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国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：34,998,303.4 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；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

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，目前内设综合管理部、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 310 名，其中具有高级职称的专家 60 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 2019 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 486 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）基金份额销售机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金份额，并在官网公示。

1、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：<http://www.byfunds.com>

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

(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) 中信银行股份有限公司

联系地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

客户服务电话：95558

公司网址：www.ecitic.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) 国信证券股份有限公司

联系地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦21楼

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(11) 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

(12) 广发证券股份有限公司

联系地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

客户服务电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(13) 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

(14) 中国银河证券股份有限公司

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

(15) 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

(16) 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：4008889999、95579

公司网址：www.95579.com

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 华泰证券股份有限公司

联系地址：江苏省南京市江东中路228号

客户服务电话：4008895597、95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 中银国际证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

客户服务电话：400-620-8889

网址：www.bocichina.com

(31) 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

(32) 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

(33) 华林证券股份有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦8楼

客服电话：400-188-3888

公司网站：www.chinalin.com

(34) 中国国际金融股份有限公司

联系地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层

客户服务电话：(+86-10) 6505 1166

公司网址：www.cicc.com.cn

(35) 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

(36) 五矿证券有限公司

联系地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47楼

客户服务电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(37) 中国中金财富证券有限公司

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

(38) 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>

(39) 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

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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/>

(44) 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.msftc.com

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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.snjjjin.com

(55) 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

(56) 浦领基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

客服电话：400-012-5899

公司网址：www.zscffund.com

(57) 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

(58) 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

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(62) 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

(63) 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

(64) 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

(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) 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

(67) 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

(68) 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

(69) 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

(70) 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

(71) 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

(72) 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

(73) 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

(74) 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

(75) 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

(76) 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

(77) 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

(78) 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

(79) 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

(80) 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

(81) 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

(82) 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

(83) 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

(84) 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

(85) 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

(86) 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

(87) 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

(二) 其他相关机构

1、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：马永红

电话：0755-83276688

传真：0755-83516044

联系人：陈静瑜

2、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

联系人：刘佳

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

3、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

宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于以科技创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、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%，其中投资于基金持仓比例最高的前30只科技主题股票的资产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

本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，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。

结合对全球宏观经济的研判，本基金将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。

（二）股票投资策略

1、科技主题上市公司股票的界定

科技进步是经济增长的不竭动力，科技的发展深刻地、不可逆转地改变着社会面貌和经济活动的方式。从长远来看，科技将是经济社会发展的永恒主题；从短期来看，相关的产业与行业也面临着历史性的发展机遇。根据《国家“十二五”科学和技术发展规划》，“努力攻克和掌握核心关键技术，推动高新技术产业化，加快培育发展战略性新兴产业”已经成为“十二五”期间科技发展规划的基本要求之一。因此在中国的经济转型之路上，掌握核心技术、以科技创新为动力的企业将会具有更大的增长潜力。

参照《国家中长期科学和技术发展规划纲要（2006-2020）》、《国家“十二五”科学和技术发展规划》以及《国务院关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》，本基金所指的科技

类上市公司，其主营业务应当属于节能环保、新一代信息技术、生物技术、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车、现代农业技术、现代服务业技术和民生科技等十大产业。

未来如果由于经济发展、技术进步或政策调整造成科技主题的覆盖范围发生变动，基金管理人有权对上述界定进行调整和修订。

2、个股精选策略

本基金主要采取“自下而上”的选股策略，基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量，使用定性与定量相结合的方法精选出 30 只左右的股票进行集中投资，使前 30 大科技主题重仓股的投资比例合计不低于非现金基金资产的 80%。

(1) 首先，使用定性分析的方法，从科研能力、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。

在科研能力方面，选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定护城河的公司。

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。

(2) 其次，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。本基金主要从行业景气度、盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。

1) 行业景气度

本基金通过一系列定量指标对行业景气度进行研判。这些指标包括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。通过与历史和市场平均水平进行比较，并结合定性分析的结果来评判行业的景气度水平。

2) 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。

3) 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。

4) 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）、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

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

中证800指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%

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，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证综合债券指数是一个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，适合作为本基金债券部分的业绩基准。

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。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为60%和40%，并用中证综合债券指数收益率代表债券资产收益率。因此，“中证800指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%”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，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 | 2,010,750,991.84 | 82.21 |
| | 其中：股票 | 2,010,750,991.84 | 82.21 |
| 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 | 370,323,002.55 | 15.14 |
| 8 | 其他资产 | 64,691,747.27 | 2.65 |
| 9 | 合计 | 2,445,765,741.66 | 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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,383,114,536.48 | 57.25 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 439,760,676.23 | 18.20 |
| J | 金融业 | 75,776,936.67 | 3.14 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 67,002,362.46 | 2.77 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 45,096,480.00 | 1.87 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,010,750,991.84 | 83.24 |

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 | 600745 | 闻泰科技 | 2,615,915 | 184,919,031.35 | 7.65 |
| 2 | 300113 | 顺网科技 | 7,569,100 | 141,163,715.00 | 5.84 |
| 3 | 300782 | 卓胜微 | 345,800 | 129,657,710.00 | 5.37 |
| 4 | 002463 | 沪电股份 | 5,181,509 | 126,946,970.50 | 5.25 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 4,431,370 | 118,583,461.20 | 4.91 |
| 6 | 300567 | 精测电子 | 2,519,335 | 117,778,911.25 | 4.88 |
| 7 | 300450 | 先导智能 | 3,167,052 | 106,729,652.40 | 4.42 |
| 8 | 002916 | 深南电路 | 699,794 | 105,668,894.00 | 4.37 |
| 9 | 600588 | 用友网络 | 3,140,061 | 96,996,484.29 | 4.02 |
| 10 | 603960 | 克来机电 | 3,500,000 | 95,305,000.00 | 3.95 |

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闻泰科技、顺网科技外未受到公开谴责、处罚。

2019年1月9日，闻泰科技股份有限公司收到上海证券交易所出具的《关于对闻泰科技股份有限公司和有关责任人予以监管关注的决定》，具体情况如下：2018年4月28日，闻泰科技股份有限公司披露了2017年度内部控制审计报告。根据上述报告，2017年1月5日，公司子公司徐州中茵置业有限公司与关联方西藏中茵集团有限公司签订《借款合同》，约定自2017年1月1日起，中茵集团向徐州中茵提供的借款利率由银行同期贷款利率4.35%改为年利率11.15%，借款期限展期为2017年1月1日至2018年12月21日止。根据公司七届十一次董事会决议，从2011年1月1日起，凡公司及控股子公司向实际控制人及其关联企业借款，一律按银行同等利率计提支付计息。截至2017年12月31日，公司2017年度根据上述关联方借款协议计提的关联方借款利息超过同期银行贷款利率部分金额为52,769,113.34元，占公司2016年经审计净资产的1.22%，占公司2016年经审计净利润的109.98%，金额较大。根据公司内部的《关联交易制度》，上述关联借款事项应提交董事会审议通过，但公司未就上述关联借款提交董事会审议，截至公司2017年年报出具日仍未履行审批程序。据此，公司2017年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。同时，根据公司于2017年10月31日披露的2017年半年度报告问询函回复公告，截至2017年1月1日，中茵集团向徐州中茵提供的借款余额为588,753,350.68元，按照当时约定的借款利率计算，预计2017年全年借款利息65,645,998.60元。上述借款利息占公司最近一期经审计净资产的1.53%，达到应当披露的标准。公司应当在2017年1月签订借款合同时及时

披露相关公告，但公司迟至回复 2017 年半年报问询函公告中才予以披露。公司未就上述关联交易事项及时履行信息披露义务。公司于 2017 年 1 月 5 日签订上述关联借款合同时，未及时履行内部决策程序及相应信息披露义务，导致公司 2017 年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 1.4 条、第 2.1 条、第 10.2.4 条等有关规定，对闻泰科技股份有限公司予以监管关注。本基金注意到，以上事件是闻泰科技公司在管理细节上的问题，事件本身不影响公司主营业务的发展。本基金在关注闻泰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。

2018 年 12 月 25 日，因未及时披露股东质押信息，杭州顺网科技股份有限公司收到深圳证券交易所出具的《关于对杭州顺网科技股份有限公司的监管函》，具体情况如下：公司控股股东华勇于 2018 年 12 月 5 日补充质押 2,154 万股，于 12 月 12 日再次质押 990 万股、质押展期 1,250 万股，合计占公司总股本比例为 6.34%。华勇在办理上述质押业务后已及时告知公司，但公司披露时间为 2018 年 12 月 17 日，因此受到监管关注处分，同时要求公司董事会应充分重视问题，吸取教训，及时整改，采取切实有效措施杜绝此类违规行为的再次发生。根据公司公告，截止 2019 年 5 月 11 日，公司股东华勇已质押 2.06 亿股，占公司总股本的 29.7%，占其持有公司股份数的 73.67%。公司对相关信息均做了及时准确的披露，有效地杜绝了类似事件的再次发生。《监管函》所揭露的问题已经得到有效整改，对公司业务正常经营不构成影响。

(2) 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 | 905,914.80 |
| 2 | 应收证券清算款 | 56,456,118.85 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 63,362.44 |
| 5 | 应收申购款 | 7,266,351.18 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 64,691,747.27 |

(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

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 8 月 13 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)

| 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 |
|----------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 2014 年 8 月 13 日-2014 年 12 月 31 日 | 14.10% | 1.27% | 25.42% | 0.77% | -11.32% | 0.50% |
| 2015 年 | 67.92% | 3.38% | 14.19% | 1.50% | 53.73% | 1.88% |
| 2016 年 | -23.12% | 2.06% | -6.77% | 0.92% | -16.35% | 1.14% |
| 2017 年 | 8.21% | 1.09% | 9.10% | 0.39% | -0.89% | 0.70% |
| 2018 年 | -26.16% | 1.84% | -14.38% | 0.80% | -11.78% | 1.04% |
| 2019 年上半年 | 19.29% | 2.01% | 15.68% | 0.94% | 3.61% | 1.07% |
| 2019 年三季度 | 24.64% | 1.82% | 0.47% | 0.59% | 24.17% | 1.23% |

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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。

（五）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可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<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/笔 |

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 2014 年 9 月 16 日发布的《宝盈科技 30 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》、《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. 根据本公司于2019年6月22日发布的《宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告》更新了本招募说明书的有关内容。

2. 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23日发布的《宝盈基金管理有限公司旗下五只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的公告》更新了本招募说明书的有关内容。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

6. 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。

7. 在“第八部分 基金份额的申购与赎回”中，更新了基金转换的相应内容。

8. 在“第九部分 基金的投资”部分，更新了基金的投资组合报告的内容。

9. 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。

10. 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

二〇一九年十二月二十三日