

宝盈人工智能主题股票型证券投资基金

更新招募说明书摘要

宝盈人工智能主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2018 年 4 月 17 日中国证监会证监许可[2018]719 号文注册募集。本基金基金合同于 2018 年 8 月 15 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。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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，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（或申购）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，由投资人自行承担。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债券发行人为中小微、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券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。

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、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，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证本基金一定盈利，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26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。

基金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

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基金经理、宝盈人工智能主题股票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

（一）基金托管人情况

1、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

2、主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，工商银行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

4、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017 共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

(1) 内部风险控制目标

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

（2）内部风险控制组织结构

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

（3）内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

（4）内部风险控制措施实施

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

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

3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、

“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

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

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

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

(5) 资产托管部内部风险控制情况

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

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

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

4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建

立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

5、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

法定代表人：马永红

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) 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

(4) 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

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(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) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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>

(34) 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

(35) 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

(36) 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

(37) 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

(38) 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

(39) 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/>

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(62) 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

(63) 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

(64) 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

(65) 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

(66) 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

(67) 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

(68) 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

(69) 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

(70) 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

(71) 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

(72) 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

(73) 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

(74) 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

(75) 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

(76) 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

客户服务电话：400-930-0660

公司网址：www.jfzinv.com

(77) 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

(78) 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

(79) 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) 注册登记机构

登记机构名称：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

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

电话：0755-83276688

传真：0755-83516044

联系人：陈静瑜

(三) 律师事务所和经办律师

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1405室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、张雯倩

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：宝盈人工智能主题股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式股票型基金

六、基金的投资目标

本基金主要投资于人工智能主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求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良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、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（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票）投资占基金资产的比例为80%-95%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的50%，投资于人工智能主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金

后，保持现金或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。

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

本基金的投资策略由以下六部分组成：

（一）大类资产配置策略

本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，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，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内（A股）和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。研判宏观形势的过程中主要考虑的因素包括：

（1）宏观经济环境

- ①季度GDP及其增长速度；
- ②月度工业增加值及其增长率；
- ③月度固定资产投资完成情况及其增长速度；
- ④月度社会消费品零售总额及其增长速度；
- ⑤月度居民消费价格指数、工业品价格指数以及主要行业价格指数；
- ⑥月度进出口数据以及外汇储备等数据；
- ⑦货币供应量M0、M1、M2的增长率以及贷款增速。

（2）政策环境

- ①财政政策；
- ②货币政策；
- ③产业政策；
- ④证券市场监管政策。

（3）市场指标

- ①市场整体估值水平；
- ②市场资金的供需；
- ③市场的参与情绪；
- ④两地市场估值/资金差异性。

（二）股票投资策略

1、人工智能主题的界定

人工智能（Artificial Intelligence）是研究、开发用于模拟、延伸和扩展人的智能的理

论、方法、技术及应用系统的一门技术科学。其技术体系分为基础层、技术层和应用层，具体内容包括：

- 1) 基础层：核心处理器芯片、底层算法、大数据等；
- 2) 技术层：语音识别、图像识别、生物识别、学习能力、逻辑能力等；
- 3) 应用层：自动驾驶、智能安防、无人系统、服务机器人等。

随着关键技术的突破和产业政策的扶持，人工智能技术与应用的发展出现了向上的拐点。本基金界定的人工智能主题包括以下两类上市公司：

(1) 直接提供人工智能基础资源、技术以及应用支持的公司，具体包括信息采集技术及设备商、人工智能认知技术提供商、人工智能硬件提供商及相应供应链、人工智能应用支持商以及其他相关领域的上市公司；

(2) 利用人工智能技术提升产品与服务智能化水平的智能制造（高档数控机床、工业机器人、智能传感与控制系统等）、智能物流（无人化仓储、智能装备与配送等）、智能家居（安防系统、照明控制、智能家居等）和智能医疗（辅助诊断系统、临床应用系统等）领域的上市公司。

未来如果由于经济发展、技术进步或政策调整造成人工智能主题的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，可以对上述界定进行调整和修订。

2、子行业配置策略

行业配置方面，本基金着重分析人工智能主题涵盖的各子行业技术成熟度、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个股。

(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行业内具备一定技术壁垒的公司。

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。

4、港股通标的股票投资策略

本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

本基金将对港股通标的股票进行系统性分析，在采用子行业配置策略和个股精选策略的基础上，结合香港股票市场情况，重点投资于港股通标的股票范围内受惠于我国人工智能产业发展，且处于合理价位的具备核心竞争力的上市公司股票。

（三）债券投资策略

在进行债券投资时，本基金将会分析利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略和可转换债券投资策略，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。

（四）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。

（五）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，力争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。

（六）衍生品投资策略

1、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) 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；

(3) 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。

2、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证人工智能主题指数收益率×60% +恒生综合指数收益率×25%+中证综合债券指数收益率×15%。

中证人工智能主题指数由中证指数有限公司编制，从为人工智能提供基础资源、技术以及应用支持的公司中选取规模和流动性较好的公司股票作为样本股，可以较好地反映沪深两市人工智能主题公司的整体表现；恒生综合指数由恒生指数服务有限公司编制，覆盖了香港联合交易所主板上市总市值前95%的股票标的，能够反映香港股票市场的整体走势；中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，是一个综合反映交易所和银行间市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果相关法律法规发生变化，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，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，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资

标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	173,327,103.70	78.04
	其中：股票	173,327,103.70	78.04
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	42,066,612.01	18.94
8	其他资产	6,702,768.21	3.02
9	合计	222,096,483.92	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为21,411,372.17元，占基金资产净值比例10.19%。

2、期末按行业分类的股票投资组合

（1）期末按行业分类的境内股票投资组合

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	99,554,394.42	47.40
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	41,043,990.84	19.54
J	金融业	5,830,722.27	2.78
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	-	-
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	5,486,624.00	2.61
S	综合	-	-
	合计	151,915,731.53	72.33

(2) 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	10,391,155.20	4.95
I 电信服务	11,020,216.97	5.25
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	21,411,372.17	10.19

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

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	160,500	11,345,745.00	5.40
2	00700	腾讯控股	37,000	11,020,216.97	5.25
3	300113	顺网科技	570,100	10,632,365.00	5.06
4	300782	卓胜微	27,900	10,461,105.00	4.98
5	02382	舜宇光学科技	100,000	10,391,155.20	4.95
6	300450	先导智能	289,600	9,759,520.00	4.65
7	002475	立讯精密	359,530	9,621,022.80	4.58
8	002463	沪电股份	364,500	8,930,250.00	4.25
9	002138	顺络电子	402,100	8,729,591.00	4.16
10	002916	深南电路	49,600	7,489,600.00	3.57

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。

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。

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、期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎

原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

10、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) 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、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）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	26,327.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,428.36
5	应收申购款	6,670,011.90

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,702,768.21

(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

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

(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8月15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):

宝盈人工智能股票 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8月15日至2018年12月31日	-5.05%	1.23%	-14.42%	1.49%	9.37%	-0.26%
2019年上半年	23.36%	1.92%	22.47%	1.52%	0.89%	0.40%
2019年三季度	23.96%	1.69%	4.26%	1.29%	19.70%	0.40%

宝盈人工智能股票 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8月15日至2018年12月31日	-5.34%	1.23%	-14.42%	1.49%	9.08%	-0.26%
2019年上半年	22.86%	1.92%	22.47%	1.52%	0.39%	0.40%

2019年 三季度	23.71%	1.69%	4.26%	1.29%	19.45%	0.40%
--------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、与本基金业绩比较基准相关的使用费用；
- 12、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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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%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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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 0.80%。

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 0.80%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—12 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的各项纳税主体，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。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

（五）与基金销售有关的费用

1、申购费

投资者在申购 A 类基金份额时需交纳申购费，费率随申购金额的增加而递减，如下表所示：

申购金额 (M)	A 类基金份额申购费率
M<100 万	1.50%
100 万≤M<300 万	1.00%
300 万≤M<500 万	0.50%
M≥500 万	固定费用 1000 元/笔

投资人可以多次申购本基金，A 类基金份额的申购费率按每笔申购申请单独计算。

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 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者在申购 C 类基金份额时不需交纳申购费。

2、赎回费

本基金对 A、C 类基金份额收取赎回费，费率随持有期限的增加而递减。

本基金 A 类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限 (N)	A 类基金份额赎回费率	
N<7 日	1.50%	全额计入基金资产
7 日≤N<30 日	0.75%	
30 日≤N<90 日	0.50%	75%计入基金资产
90 日≤N<180 日	0.50%	50%计入基金资产
180 日≤N<365 日	0.50%	25%计入基金资产
365 日≤N<730 日	0.25%	

N \geq 730日	0%	
---------------	----	--

本基金C类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（N）	C类基金份额赎回费率	
N<7日	1.50%	全额计入基金资产
7日 \leq N<30日	0.50%	
N \geq 30日	0%	

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，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2018年9月12日发布的《宝盈人工智能主题股票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26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，更新了相关服务机构的相应内容。
- 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、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》，在重要提示及风险揭示章节增加基金投资于科创板股票的相关提示。

9、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。

10、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

二〇一九年十二月二十六日