宝盈鸿利收益证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈鸿利收益证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2002年8月9日证监基金字2002[53]号文批准公开发售。本基金基金合同于2002年10月8日正式生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的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合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其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；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人保证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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年4月8日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日。基金托管人中国农业银行股份有限公司对本招募说明书(更新)中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1、基金管理人基本情况

名称：宝盈基金管理有限公司
注册地址：深圳市深南路6008号特区报业大厦1501
成立时间：2001年5月18日
法定代表人：李文众
总经理：汪钦
办公地址：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
注册资本：10000万元人民币
电话：0755—83276688
传真：0755—83515599
联系人：王中宝

2、基金管理人股权结构及组织结构

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。

公司下设投资部、固定收益部、海外投资部、特定客户资产管理部、研究部、金融工程部、集中交易部、市场部、营销中心、电子商务部、信息技术部、基金事务部、监察稽核部、公司财务部、总经理办公室等15个部室和北京办事处、上海办事处；此外，还设立了投资决策委员会和风险管理委员会。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

（1）董事会

李文众先生，董事长，1959年生，中共党员，经济师。1978年12月至1985年5月在中国人民银行成都市支行解放中路办事处工作；1985年6月至1997年12月在中国工商银行成都市信托投资公司任职，先后担任委托代理部、证券管理部经理；1997年12月至2002年11月成都工商信托投资有限责任公司任职，历任部门经理、总经理助理；2002年11月至今在中铁信托投资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。

马宏先生，董事，1967年生，硕士研究生。1989年7月至1991年9月，在中国新兴（集团）总公司工作；1994年7月至1995年12月，在中化财务公司证券部工作；1995年12月至1997年6月，在中国对外经济贸易信托投资有限公司证券部工作；1997年7月至2001年3月，在中化国际贸易股份有限公司投资部担任副总经理；2001年3月至今，在中国对外经济贸易信托有限公司任职，先后担任资产管理二部副总经理、投资发展部副总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部总经理。

贺颖奇先生，独立董事，1962年生，中共党员，管理学博士。 1986年至1992年，在河北大学经济系任教；1995年至2001年，在厦门大学管理学院任教；2001年至2003年在清华大学经济管理学院管理学博士后流动站从事博士后研究工作；2003年7月至2010年4月，在清华大学会计研究所从事教学与科研工作，任清华大学会计研究所党支部书记，副教授；2010年5月至今，在北京国家会计学院任副教授，兼任福建星网锐捷公司独立董事。

屈文洲先生，独立董事，1972年生，中共党员，金融学博士。1995至1997年，任厦门建发信托投资公司海滨证券营业部投资信息部主任； 1997至2001年，任厦门建发信托投资公司投资银行部经理；1998至1999年，借调中国证监会厦门特派办上市公司监管处； 2001至2003年任厦门市博亦投资咨询有限公司总经理；2003至2005年任深圳证券交易所研究员；2005至今，在厦门大学管理学院从事教学与研究工作。现任厦门大学管理学院教授、博士生导师，厦门大学中国资本市场研究中心主任，厦门大学管理学院财务学系副主任，兼任厦门空港、山东航空、莱宝高科的独立董事。

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。

汪钦先生，董事，1966年生，中共党员，经济学博士。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处、海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三亚东方实业股份有限公司副总经理、国信证券股份有限公司研究所所长、长城基金管理有限公司副总经理。2010年11月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。

张新元先生，员工监事，1973年生，硕士。曾就职于黄河证券有限责任公司周口营业部、民生证券有限责任公司周口营业部、长城基金管理有限公司。2011年7月起至今，在宝盈基金管理有限公司工作，曾任总经理办公室主任、机构业务部总监，现任宝盈基金管理有限公司创新业务部总监。

（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。

杨凯先生，1974年生，中山大学岭南学院MBA。2003年7月至今，在宝盈基金管理有限公司工作，先后担任市场部总监助理、市场部总监、特定客户资产管理部总监、研究部总监、总经理助理。目前，其担任宝盈基金管理有限公司副总经理兼鸿阳证券投资基金基金经理。

储诚忠先生，1962年生，经济学博士。曾任武汉大学期货证券研究中心主任、金融系副主任、副教授，国信证券有限公司投资研究中心特级研究员、综合研究部总经理，中融基金管理有限公司（现国投瑞银基金管理有限公司）研究部总监、金融工程总监，国投瑞银基金管理有限公司产品开发部总监、渠道服务部总监，长盛基金管理有限公司北京分公司总经理兼营销策划部总监、华南营销中心总经理兼深圳注册地负责人。2011年加入宝盈基金管理有限公司，任总经理助理，现任宝盈基金管理有限公司副总经理、产品规划部总监。

2、基金经理简历

张小仁先生，1981年4月生，中山大学经济学硕士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理，现任宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。曾任宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理（2013年8月23日至2014年9月26日）。

宝盈鸿利收益证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

彭敢，2013年8月1日至2014年9月13日；
高峰，2010年2月12日至2013年8月1日；
陆万山，2008年12月24日至2010年9月2日；
刘丰元，2007年4月11日至2008年12月22日；
赵龙，2006年8月30日至2007年4月13日；
陈鹏，2004年12月17日至2006年8月30日；
杨军：2003年9月5日至2004年12月17日；
方晔，2002年10月8日至2003年9月5日。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

杨凯先生：宝盈基金管理有限公司副总经理兼鸿阳证券投资基金基金经理。

彭敢先生：宝盈基金管理有限公司投资部总监、宝盈资源优选股票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基金经理、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理。

段鹏程先生：宝盈基金管理有限公司研究部总监。

陈若劲女士：宝盈基金管理有限公司固定收益部总监、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理。

张小仁先生：宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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：刘士余
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛

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，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”。

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，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，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140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2015年3月31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254只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深300指数型证券投资基金、前海开源沪深300指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、招商招利1个月期理财债券型证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、中证500医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、鹏华先进制造股票型证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、华润元大富时中国A50指数型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、南方理财金交易型货币市场基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金、前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金、国开泰富货币市场证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金、鹏华可转债债券型证券投资基金、华夏沪深300指数增强型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

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

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

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

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

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：宝盈基金管理有限公司
住所：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
法定代表人：李文众
电话：0755-83276688
传真：0755-83515880
联系人：陈坤

2、代销机构

(1)中国农业银行
联系地址：北京市海淀区复兴路甲23号
客户服务电话：95599
公司网址： www.abchina.com

(2)中国工商银行
联系地址：北京市西城区复兴门内大街55号
客户服务电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

(3)中国银行
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)中国建设银行
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

(5)交通银行
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

(6)招商银行
联系地址：深圳市福田区深南大道7088号
客户服务电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

(7)中信银行
联系地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
客户服务电话：95558
公司网址：www.ecitic.com

(8)中国民生银行
联系地址：北京市西城区复兴门内大街2号
客户服务电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

(9)中国邮政储蓄银行
联系地址：北京市西城区金融大街3号
客户服务电话：95580
公司网址：www.psbc.com

(10)北京银行
联系地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
客户服务电话：95526
公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

(11)平安银行
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

(12)国泰君安证券
联系地址：上海市延平路135号
客户服务电话：95521
公司网址：www.gtja.com

(13)中信建投证券
联系地址：北京市东城区朝内大街188号
客户服务电话：4008888108、95587
公司网址：www.csc108.com

(14)国信证券
联系地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

(15)招商证券
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

(16)广发证券
联系地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
客户服务电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

(17)中信证券
联系地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦三层
客户服务电话：400-889-5548
公司网址：www.cs.ecitic.com

(18)银河证券
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

(19)海通证券
联系地址：上海市淮海中路98号金钟广场19层
客户服务电话：4008888001、95553
公司网址：www.htsec.com

(20)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
客服电话：95523或4008895523
公司网址：www.swhysc.com

(21)兴业证券
联系地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦
客户服务电话：95562
公司网址：www.xyzq.com.cn

(22)长江证券
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.cjsc.com.cn

(23)安信证券
联系地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
客户服务电话：4008001001
公司网址：www.essence.com.cn

(24)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

(25)中信证券（浙江）
联系地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
客户服务电话：0571-96598
公司网址：www.bigsun.com.cn

(26)万联证券
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：4008888133
公司网址：www.wlzq.com.cn

(27)国元证券
联系地址：安徽省合肥市寿春路179号
客户服务电话：95578
公司网址：www.gyzq.com.cn

(28)渤海证券
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：4006515988
公司网址：www.bhzq.com

(29)中信证券（山东）
联系地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
客户服务电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

(30)东吴证券
联系地址：江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
客户服务电话：0512-96288
公司网址：www.dwjq.com.cn

(31)东方证券
联系地址：上海市中山南路318号2号楼
客户服务电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn

(32)长城证券
联系地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
客户服务电话：4006666888
公司网址：www.cc168.com

(33)国联证券
联系地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层
客户服务电话：95570
公司网址：www.glsc.com.cn

(34)浙商证券
联系地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座
客户服务电话：967777
公司网址：www.stocke.com.cn

(35)平安证券
联系地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦
客户服务电话：95511
公司网址：www.stock.pingan.com

(36)国都证券
联系地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
客户服务电话：4008188118
公司网址：www.guodu.com

(37)东海证券
联系地址：上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼
客户服务电话：95531、400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn

(38)国盛证券
联系地址：江西省南昌市永叔路15号
客户服务电话：400-822-2111
公司网址：www.gsstock.com

(39)华西证券
联系地址：四川省成都市陕西街239号
客户服务电话：4008888818
公司网址：www.hx168.com.cn

(40)齐鲁证券
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.qlzq.com.cn

(41)第一创业证券
联系地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
客户服务电话：400-888-1888
公司网址：www.firstcapital.com.cn

(42)金元证券
联系地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
客户服务电话：4008888228
公司网址：www.jyzq.com.cn

(43)中航证券
联系地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
客户服务电话：4008866567
公司网址：www.scstock.com

(44)中投证券
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

(45)天源证券
联系地址：深圳市民田路新华保险大厦18楼
客户服务电话：400-654-3218
公司网址：www.tyzq.com.cn

(46)厦门证券
联系地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
客户服务电话：0592-5161816
公司网址：www.xmzq.cn

(47)世纪证券
联系地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40/42层
客户服务电话：0755-83199511
公司网址：www.csco.com.cn

(48)中金公司
联系地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
客户服务电话：010-65051166
公司网址：www.cicc.com.cn

(49)信达证券
联系地址： 北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
客户服务电话：4008008899
公司网址：www.cindasc.com

(50)英大证券
联系地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十层
客户服务电话：400-018-8688
公司网址：www.ydsc.com.cn

(51)华福证券
联系地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
客户服务电话：0591-96326
公司网址：www.hfzq.com.cn

(52)天相投顾
联系地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505
客户服务电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com

(53)光大证券
联系地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼
客户服务电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

(54)华泰证券
联系地址：江苏省南京市中山东路90号
客户服务电话：4008895597、95597
公司网址：www.htsc.com.cn

(55)东莞农村商业银行
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

(56)五矿证券
联系地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47-49层
客户服务电话：40018-40028
公司网址：www.wkzq.com.cn

(57)上海长量基金销售
联系地址：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：400-089-1289
公司网址：www.erichfund.com.

(58)深圳众禄基金销售
联系地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25层
客户服务电话：4006788887
公司网址：www.jjmmw.com

(59)上海天天基金销售
联系地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
客户服务电话：4001818188
公司网址：www.1234567.com.cn

(60)杭州数米基金销售
联系地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
客户服务电话：4000766123
公司网址：www.fund123.cn

(61)国海证券
联系地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
客户服务电话：4008888100、95563
公司网址：www.ghzq.com.cn

(62)上海好买基金销售
联系地址：上海市浦东新区浦东南路1118号903-906室
客户服务电话：400-700-9665
公司网站：www.ehowbuy.com

(63)中期时代基金销售（北京）
联系地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
客户服务电话：95162
公司网址：www.cifcofund.com

(64)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1002室
客户服务电话：400-920-0022
公司网址：www.hexun.com

(65)万银财富（北京）基金销售有限公司
联系地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
客户联系电话：400-808-0069
公司网址：www.wy-fund.com

(66)广州证券
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：961303
公司网址：www.gzs.com.cn

(67)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
联系地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A座303
客户服务电话：4008199868
公司网站：www.tdyhfund.com

（二）注册登记机构：
注册登记人名称：宝盈基金管理有限公司
住所：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
法定代表人：李文众
电话：0755-83276688
传真：0755-83515466
联系人：陈静瑜

（三）律师事务所和经办律师
律师事务所名称：上海源泰律师事务所
注册地址：上海市浦东新区浦东南路256 号华夏银行大厦14 楼
办公地址：上海市浦东新区浦东南路256 号华夏银行大厦14 楼
负责人： 廖海
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：宝盈鸿利收益证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为收益型基金，投资目标是为基金投资者谋求稳定的现金红利分配和长期资本增值收益，以中信综合指数×80%＋上证国债指数×20%（国内A股统一指数推出后则变更为国内A股统一指数×80%＋国债指数×20%）为投资的参照基准，在投资收益率的波动小于或等于参照基准波动的条件下，争取更高的收益率。

七、基金的投资方向

本基金投资的标的物为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票，债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资的主要对象为业绩优良并能稳定增长，现金流状况良好，有满意的红利分配政策或调整后市盈率较低的上市公司的股票。

八、基金的投资策略

1、决策依据：

（1）国内国际宏观经济环境是本基金进行投资决策的基础；

（2）根据国家有关法律、法规和基金合同的有关规定，依法决策是本基金进行投资的前提；

（3）财政货币政策、利率走势、证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况是进行投资决策的重要参考；

（4）上市公司的行业发展状况、公司的经营竞争优势和盈利能力、对公司综合价值的评估是投资决策的关键因素。

2、决策程序：

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，投资决策程序如下：

（1）在基金合同规定的投资方向、投资理念和投资限制的范围内，基金经理根据公司研究部、投资部和外部专业研究机构对宏观经济、政策取向、市场趋势和特点进行的深入研究，在此基础上制定资产配置策略和投资策略建议，经过投资决策委员会讨论通过后作为进行整体资产配置的决策依据；

（2）公司研究部行业研究员和金融工程部数量分析研究员对上市公司进行详细分析、调研的基础上，构建基金投资备选库，推荐给基金经理。基金经理根据基金契约规定、整体资产配置方案，适当参考外部专业研究机构的投资建议报告，在公司统一的备选股票池中选择合适的投资品种。

（3）基金经理结合自己对市场的分析和判断制定投资组合草案，提交投资决策委员会审议。投资组合草案包括计划投资股票的清单和数量范围；

（4）投资决策委员会对基金经理的投资组合草案进行讨论和表决，通过后形成投资组合方案；如草案不获通过，基金经理负责对草案进行修改后，提交投资决策委员会继续讨论；

（5）基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，构建投资组合；

（6）金融工程部对投资组合进行风险评估，并将评估结果和调整建议向投资决策委员会反馈；

（7）投资决策委员会和基金经理根据市场变化和风险评估结果对基金投资组合进行调整。

3、投资组合管理的方法和标准

本基金为收益型基金， 主要通过以下投资策略追求基金投资的长期稳定的现金红利分配和资本增值收益：

战略资产配置策略。基金正常运作时期，本基金债券投资占基金净值的比例不低于20%，股票投资占基金净值的比例不高于75%，其余为现金资产；在上述比例范围之内，基金管理人根据宏观经济形势、证券市场总体市盈率水平等指标，对不同市场的风险收益状况做出判断，据此调整股票、债券和现金资产的配置比例。

行业资金配置策略。首先由行业分析师估计各行业今后两到三年的期望增长速度，以行业增长率对该行业上市公司的总体市盈率进行调整，寻找总体投资价值被相对低估的行业。根据调整后不同行业的市盈率作为主要参考指标，结合经济发展不同阶段对不同行业的影响，决定股票投资中资金在行业之间的配置比例。

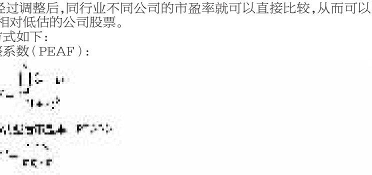
公司选择策略。本基金对上市公司投资价值的判断，主要依赖于两方面的基础工作：一是以行业专家和财务专家的角度对公司发展、经营和财务状况进行深入调查研究，二是选择适当的估值模型。在此过程中，更强调公司长期（3-5年）的发展和竞争优势、稳定成长的市场、可持续的主营业务利润、良好的现金流和满意的红利分配政策。根据对上市公司投资价值的判断，本基金在公司选择中采取积极的策略。在对行业内上市公司进行合理排序的基础上，决定资金在个股间的分配。重点投资于位于行业前列的上市公司，较少投资于排序靠后的上市公司。排序所依据的主要指标为红利收益率和增长率调整后的市盈率，本基金根据指标排序情况，选择符合以下条件的收益型公司，构建基金股票投资组合的备选库，基金投资于符合稳定收益型条件的公司的比例，不低于股票投资总额的80%。

（1）稳定收益型公司的选择依据。稳定收益型公司指主营业务收入稳定增长，在行业内有一定的竞争优势，现金流与主营业务收入同步增长，有满意的红利分配政策的上市公司。本基金选择稳定收益型公司的主要指标包括：红利收益率、主营业务利润率、每股经营性现金流、主营业务利润贡献率、资产负债率。基金管理人对上述5项指标进行加权评分，选择排序位于前1/2的公司。

（2）价值相对低估型公司选择依据。资本市场上，不同的公司有不同的市盈率，公司之间市盈率差别的两个根本原因是市场对其预期的增长率和风险的差别，因此，不同公司的市盈率不具有直接的可比性。为此，本基金引入“市盈率调整系数（PEAF）”，对公司市盈率进行增长率和风险调整，计算增长率及风险调整后市盈率（PEAG）。经过调整后，同行业不同公司的市盈率就可以直接比较，从而可以对公司相对投资价值进行排序，寻找价值被相对低估的公司股票。

具体计算方式如下：

市盈率调整系数（PEAF）：



本基金主要通过以下方法估计上市公司的期望增长率：

分析师在对公司经营状况和历史财务数据深入了解的基础上，区分不同的公司类型（成长型、成熟型、衰退型、周期型等），采用定性分析、因果分析、时间序列等方法，结合对未来融资结构分析，预测公司未来3到5年的每股利润增长率；

上市公司公开信息批露（招股说明书、配股或增发说明书、年报、中报、业绩预测等）中预计的增长率，根据历史上预测数据与实现数据的差异进行调整；

留存收益比率与净资产利润率的乘积计算理论的收益增长率，根据历史实现的增长率与理论增长率的差异进行调整；

收集跟踪该上市公司证券分析师对公司增长率的预测值，根据不同分析师的经验、历史业绩等分配不同权重，得出外部分析师对公司增长率预测的期望值。

本基金综合考虑以上对增长率的预测值，估计公司的期望增长率、乐观预测和悲观预测的波动范围，从而确定[illegible]及风险调整因子r。以上任何预测值发生变化时，本基金将及时对[illegible]进行调整。

在固定收益投资方面，本基金将在严格控制信用风险和长期利率风险的前提下，主要根据到期收益率的高低，选择能带来满意收益水平的投资组合买入并持有。并根据不同期限债券即期收益率、远期收益率以及到期收益率结构积极寻找无风险套利或风险套利机会。

本基金的投资组合还应当符合下列规定：

（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；

（2）投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%；

（3）持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的10%，本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的10%；

（4）遵守中国证监会规定的其他比例限制；

（5）除符合以上规定外，本基金将根据市场情况制定投资操作策略，在基金成立后六个月内完成投资组合的构建，达到本基金契约的规定，即在基金正常运作时期，本基金债券投资占基金净值的比例不低于20%；股票投资占基金净值的比例不高于75%，其中不低于80%投资于符合稳定收益型条件的公司。由于基金规模或市场变化导致的投资组合不符合上述规定的比例时，本基金将及时制定相应的投资组合调整策略，在三个月内完成调整，以重新达到上述规定。法律法规另有规定的，从其规定。

九、基金的业绩比较基准

以中信综合指数×80%＋上证国债指数×20%（国内A股统一指数推出后则变更为国内A股统一指数×80%＋国债指数×20%）为投资的参照基准。

十、基金的风险收益特征

本基金属于收益型基金，风险水平和期望收益水平相对较高。

十一、基金投资组合报告（截至2015年3月31日）

(1)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	1,185,565,385.62	73.19
	其中：股票	1,185,565,385.62	73.19
2	固定收益投资	325,249,618.00	20.08
	其中：债券	325,249,618.00	20.08
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	79,358,993.79	4.90
7	其他资产	29,617,549.72	1.83
8	合计	1,619,791,547.13	100.00

（2）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	547,108,332.78	34.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,025,000.00	8.41
E	建筑业	8,260,000.00	0.52
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	178,137,416.25	11.26
J	金融业	89,420,600.00	5.65
K	房地产业	24,387,146.37	1.54
L	租赁和商务服务业	34,422,257.72	2.18
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	170,804,632.50	10.80
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,185,565,385.62	74.95

（3）基金投资前十名股票明细

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	000791	甘肃电投	8,500,000	133,025,000.00	8.41
2	002549	凯美特气	5,276,750	109,703,632.50	6.93
3	300059	东方财富	2,240,000	93,184,000.00	5.89
4	002368	太极股份	1,200,755	84,953,416.25	5.37
5	002698	博实股份	2,270,000	78,519,300.00	4.96
6	601318	中国平安	1,000,000	78,240,000.00	4.95
7	300206	理邦仪器	2,266,634	74,957,586.38	4.74
8	300187	永清环保	1,550,000	61,101,000.00	3.86
9	000810	创维数字	1,731,564	57,868,868.88	3.66
10	002522	浙江众成	1,500,000	56,250,000.00	3.56

（4）按券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	82,670,073.00	5.23
2	央行票据	–	–
3	金融债券	242,579,545.00	15.33
	其中：政策性金融债	242,579,545.00	15.33
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	325,249,618.00	20.56

（5）基金投资前五名债券明细

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	018001	国开1301	1,700,000	174,148,000.00	11.01
2	010107	21国债(7)	789,590	82,670,073.00	5.23
3	018002	国开1302	638,950	68,431,545.00	4.33

（6）本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（7）本基金本报告期末未持有贵金属。

（8）本基金本报告期末未持有权证。

（9）本基金本报告期末未投资股指期货。

（10）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发行主体在报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除中国平安（代码：601318.SH）、凯美特气（代码：002549.SZ）外未受到公开谴责、处罚。

2014年12月8日，中国证监会发布《中国证监会行政处罚决定书》（〔2014〕103号），因海联讯科技股份有限公司（以下简称“海联讯”）上市项目，对平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）给予警告，没收其“海联讯”发行上市项目中的保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2，867万元，并处以440万元罚款。平安证券在中国平安业务收入中占比很小，此次处罚不影响对于中国平安业务发展的判断。作为基金管理人，我们长期看好中国平安金融平台业务的持续发展。以上操作符合相关法规和本基金投资策略的要求。

报告期内本基金所投资的股票凯美特气于2014年5月24日公告披露， 公司因隐瞒全资子公司长岭凯美特遭上游中石化长岭分公司"断气"而停产的事实，被湖南省证监局责令整改。公司在收到监管函后，在中石化总公司的协调下，迅速与中石化长岭分公司举行了多次谈判，并取得初步结果。6月13日，公司公告称双方对相关内容已初步达成了一致的共识。目前长岭分公司正在对该协议进行流程审批，待长岭分公司审批完成后，公司将及时公告协议具体事项。现长岭凯美特处于开车运行前的生产准备状态， 待接到长岭分公司向长岭凯美特供气的指令，随时可以投入生产运行。2014年12月8日，凯美特气发布公告，称与中国石油化工股份有限公司长岭分公司价格及供气异议达成一致协议，并对2014年的经营业绩没有影响。我们认为，该事项是我国特有的体制内问题，并没有影响公司投资价值。当然公司在公司运营中，确有忽视中小股东知情权的事实。通过这件事情，公司认识到作为上市公众公司与普通公司的区别，提高了认识水平。我们继续看好公司的长期投资价值，因此在公告后未做减持。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产明细

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	979,758.09
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,859,158.59
5	应收申购款	24,778,633.04
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	29,617,549.72

4、本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本基金本报告期末前十名股票中流通受限情况说明。

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300059	东方财富	93,184,000.00	5.89	重大事项

6、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

本基金合同生效日为2002年10月8日， 基金合同生效以来完整会计年度的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：(截至2015年3月31日)

阶段	净值增长率①	净值增长标准差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
2002年	-5.27%	0.53%	-11.75%	0.99%	6.49%	-0.46%
2003年	14.58%	0.66%	-2.63%	0.87%	17.21%	-0.21%
2004年	-6.37%	1.00%	-13.78%	1.08%	7.41%	0.08%
2005年	-4.79%	0.95%	-6.69%	1.14%	1.90%	-0.19%
2006年	142.93%	1.37%	83.28%	1.12%	59.65%	0.25%
2007年	93.91%	1.76%	122.35%	1.81%	-28.44%	-0.05%
2008年	-47.47%	1.65%	-53.33%	2.42%	5.86%	-0.77%
2009年	9.37%	1.25%	80.19%	1.63%	-70.82%	-0.38%
2010年	1.11%	1.16%	-1.70%	1.25%	2.81%	-0.09%
2011年	-20.94%	1.12%	-22.38%	1.07%	1.44%	0.05%
2012年	6.07%	1.08%	5.39%	1.06%	0.68%	0.02%
2013年	11.06%	1.03%	3.11%	1.07%	7.95%	-0.04%
2014年	53.89%	1.05%	38.54%	0.89%	15.35%	0.16%
2015年一季度	20.95%	1.20%	19.15%	1.20%	1.80%	0.00%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、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）基金交易佣金；
（4）基金证管费、印花税；
（5）基金信息披露费用；
（6）基金持有人大会费用；
（7）与基金相关的会计师费用和律师费用；
（8）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

本基金费用由基金托管人从基金财产中支付。

2、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以基金资产净值1.5%的年费率计提。具体计算方法如下：

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数。H为每日应付的基金管理费，E为前一日的基金资产净值。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日），按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的2.5‰ 的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×2.5‰÷当年天数。H为每日应支付的基金托管费，E为前一日的基金资产净值。

基金托管人的托管费每日计算，基金托管费计算逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

（3）其他费用

上述1款中其他费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定， 按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，无须召开基金持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1.基金认购费用

本基金认购费率不超过1%。

本基金只接受金额认购，认购金额包括认购费用和净认购金额。其中，

认购费用 ＝ 认购金额×认购费率
净认购金额 ＝ 认购金额－认购费用
认购份额 ＝ 净认购金额/基金份额面值

认购的有效份额保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

本基金的认购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2.申购费

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额＝申购金额/(1+申购费率)@申购费用＝申购金额-净申购金额@申购份额＝净申购金额/T日基金份额净值

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购金额（含申购费）	费率
100万元以下	1.5%
100万元—500万元（含100万元）	1.2%
500万元—1000万元（含500万元）	0.6%
1000万元以上（含1000万元）	1000元/笔

本基金的申购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

3.赎回费

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额＝赎回份数×T日基金份额净值
赎回费用＝赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回费根据持有人持有基金的期限递减，最高不超过赎回总额的0.25%，作为注册登记费。费率表如下：

持有基金份额的期限	费率
1年以内	0.25%
1年—2年（含1年）	0.2%
2年以上（含2年）	免收

在持有期内持有人多次申购基金的，赎回时按照先进先出的原则计算。

赎回费归入基金财产的比例规定为赎回费总额的百分之二十五。余额为注册登记费和其他手续费。

4.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2007年4月27日发布的《关于宝盈鸿利收益证券投资基金和宝盈策略增长股票型证券投资基金开放转换业务的公告》和其他有关基金转换公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”部分，更新了本招募说明书所载内容和相关财务数据的截止时间。
2、在“三、基金管理人”部分，更新了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，更新了代销机构和律师事务所和经办律师的相应内容。
5、在“九、基金的申购与赎回”部分，更新了基金的转换的相应内容。
6、在“十、基金的投资”部分，更新了本基金投资组合报告的内容。
7、在“十一、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
8、在“十三、基金资产的估值”部分，更新了估值方法。
9、在“二十三、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
二〇一五年五月二十二日

宝盈基金管理有限公司
关于从业人员在子公司兼职情况的公告

宝盈基金管理有限公司新增1名从业人员在旗下子公司中铁宝盈资产管理有限公司兼职， 根据《证券投资基金管理公司子公司管理暂行规定》的要求，现将具体兼职情况公告如下：

宝盈基金管理有限公司特定客户资产管理部曹松涛兼任中铁宝盈资产管理有限公司投资经理。

上述人员未在中铁宝盈资产管理有限公司持有股份，中铁宝盈资产管理有限公司暂不向以上人员支付薪酬。

特此公告。

宝盈基金管理有限公司
2015年5月22日

宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，宝盈基金管理有限公司（以下简称本公司）自2008年9月16日起，对本公司旗下基金持有的长期停牌股票等估值日没有市价，且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，采用“指数收益法”确定公允价值。

经与托管银行协商一致，自2015年5月21日起，本公司旗下基金持有的“中国南车”（股票代码：601766）、“京威股份”（股票代码：002662）、“康恩贝”（股票代码：600572）、“星星科技”（股票代码：300256）和“智慧能源”（股票代码：600869）采用“指数收益法”进行估值。待该股票交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

特此公告。

宝盈基金管理有限公司

2015年5月22日