宝盈中证100指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈中证100指数增强型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会2009年11月23日中国证监会证监许可[2009]1218号《关于核准宝盈中证100指数增强型证券投资基金募集的批复》批准公开发售。本基金基金合同于2010年2月8日正式生效。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。

基金管理人的过往业绩并不预示其未来业绩。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年8月8日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。基金托管人中国建设银行对本招募说明书(更新)中涉及与托管业务相关的更新信息进行了复核确认。

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：广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第15层

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

法定代表人：李文众

总经理：张啸川

组织形式：有限责任公司

成立时间：2001年5月18日

注册资本：1亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：（0755）83276688

传真：（0755）83515599

联系人：张志刚

股权结构：本基金管理人是经中国证监会证监基金字[2001]9号文批准发起设立，现有股东包括中铁信托有限责任公司、中国对外经济贸易信托有限公司。其中中铁信托有限责任公司持有本公司75%的股权，中国对外经济贸易信托有限公司持有25%的股权。

（二）主要人员情况

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。

刘洪明先生，董事，1970年生，硕士研究生。1996年9月至1997年3月，在天津师范大学任职；1997年4月至2000年12月，在中亚证券天津业务部任职；2002年8月至2011年4月，在中化集团战略规划部任职；2011年5月起加入中国对外经济贸易信托有限公司，先后担任战略管理部总经理、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等职务，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，1957年生，中共党员，博士研究生。1975年12月到1978年3月，在陕西重型机器厂任职；1982年7月到1985年9月，在陕西省西安农业机械厂任助理工程师；1987年7月到1989年5月，在陕西省西安农业机械厂任工程师、车间副主任；1989年5月到2000年4月，在陕西财经学院财会学院任教授、系主任；2000年4月到2003年3月，在西安交通大学会计学院任教授、系主任；2003年3月到2016年12月在中国政法大学民商经济法学院财税金融法研究所任副所长、教授、研究生导师，2016年12月至今在中国政法大学商学院会计研究所任教授、研究生导师。

廖振中先生，独立董事，1977年生，法学硕士研究生。2003年到2014年，在西南财经大学法学院任讲师；2014年至今，在西南财经大学法学院任副教授。兼任四川亚峰律师事务所兼职律师，成都市传媒集团新闻实业有限公司外部董事，乐山市嘉州民富村镇银行独立董事，成都市中级人民法院专家调解员，四川省住建厅海绵城市建设专家委员会成员。

王艳艳女士，独立董事，1980年生，中共党员，会计学博士。2007年8月到2008年8月，在美国休斯敦大学从事博士后研究工作；2008年6月到2010年12月，在厦门大学财务与会计研究院任助理教授；2011年1月到2014年7月，在厦门大学管理学院任副教授；2014年8月至今，在厦门大学管理学院任教授。

徐加根先生，独立董事，1969年生，中共党员，西南财经大学教授。1991年至1996年在中国石化湖北化肥厂工作；1996年至1999年，在西南财经大学学习；1999年至今，在西南财经大学任教，现任西南财经大学金融创新与产品设计研究所副所长。

张啸川先生，董事，1978年生，中共党员，经济学博士。2005年3月-2005年5月任职于中国证监会市场监管部结算监管处。2005年5月至2009年11月任职于中国证监会股权分置改革领导小组办公室。2009年11月至2011年8月担任中国证监会市场监管部市场监控处副处长。2011年8月至2012年5月担任中国证监会市场监管部综合处副处长。2012年5月至2015年7月担任中国证监会市场监管部交易监管处处长。2015年7月至2017年4月担任博时基金管理有限公司高级顾问兼北京分公司总经理、博时资本管理有限公司董事。2017年4月14日起任宝盈基金管理有限公司总经理。

2、监事会

张建华女士，监事，1969年生，高级经济师。曾就职于四川新华印刷厂、成都科力风险投资公司、成都工商信托有限公司、衡平信托有限责任公司。现任中铁信托有限责任公司金融同业部总经理。

刘郁飞先生，监事，1973年生，中国注册会计师、ACCA。曾就职于中国林业科学研究院、中林绿源科技有限责任公司、同新会计师事务所、中国德仁集团有限公司、毕马威华振会计师事务所。现任职中国对外经济贸易信托有限公司运营稽核部（原内控稽核部、审计稽核部）总经理。

魏玲玲女士，监事，1970年生，中级经济师。曾任职于深圳石化集团股份有限公司、华夏证券深圳振华路营业部。现任宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

汪亢先生，监事，1983年生。曾任职于宝盈基金管理有限公司监察稽核部、融通基金管理有限公司监察稽核部，现任宝盈基金管理有限公司监察稽核部总经理。

3、高级管理人员

李文众先生，董事长，简历同上。

张啸川先生，总经理，简历同上。

张瑾女士，督察长，1964年生，工学学士。曾任职于中国工商银行安徽省分行科技处、华安证券有限公司深圳总部投资银行部、资产管理总部。2001年加入宝盈基金管理有限公司，历任监察稽核部总监助理、副总监、总监，2013年12月起任宝盈基金管理有限公司督察长。

丁宁先生，副总经理，1976年生，硕士，高级经济师。1998年8月至2001年7月任职于安徽省马鞍山钢铁股份有限公司。2003年6月至2010年9月担任中铁信托有限责任公司综合管理部、人力资源部副总经理。2010年9月至2016年11月担任中铁信托有限责任公司综合管理部、人力资源部总经理。2015年12月起担任宝盈基金管理有限公司党工委、纪工委书记，现任宝盈基金管理有限公司副总经理、党工委书记、纪工委书记、董事会秘书。2017年3月起兼任中铁宝盈资产管理有限公司董事长。

葛俊杰先生，副总经理，1973年生，硕士。曾任职于深圳市政府外事办公室、深圳市政府金融发展服务办公室。2007年加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、总经理办公室主任、专户投资部总监，现任副总经理、投资经理。

4、基金经理简历

蔡丹女士，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011年9月至2017年7月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017年7月加入宝盈基金管理有限公司，现任宝盈中证100指数增强型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理。

宝盈中证100指数增强型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

郭骁，2015年8月27日至2017年8月17日；

盖俊龙，2015年7月10日至2016年8月20日；

温胜普，2010年2月8日至2015年7月10日；

张小仁，2013年8月23日至2014年9月26日；

余述胜，2011年8月17日至2013年8月1日。

5、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：

张啸川先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

张志梅女士（秘书长）：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、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

葛俊杰先生（委员）：宝盈基金管理有限公司副总经理、投资经理。

邓栋先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益部总经理。

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基金经理。

段鹏程先生（委员）：宝盈基金管理有限公司权益投资部执行总经理，宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216，920.67亿元，较上年末增加7，283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现净利润总额1，720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1，390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》"2016中国最佳银行"，《环球金融》"2016中国最佳消费者银行"、"2016亚太区最佳流动性管理银行"，《机构投资者》"人民币国际化服务钻石奖"，《亚洲银行家》"中国最佳大型零售银行奖"及中国银行业协会"年度最具社会责任金融机构奖"。本集团在英国《银行家》2016年"世界银行1000强排名"中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》"中国最佳托管银行"、"中国最佳次托管银行"、"最佳托管专家——QFII"等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统"，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，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开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层

法定代表人：李文众

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：梁靖、李依

2、代销机构

(1) 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

(2) 中国农业银行股份有限公司

联系地址：北京市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

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(6) 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8号富华大厦C座

客户服务电话：95558

公司网址：www.ecitic.com

(7) 中国民生银行股份有限公司

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

(8) 北京银行股份有限公司

联系地址：北京市西城区金融大街丙17号首层

客户服务电话：95526

公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

(9) 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

(10) 国泰君安证券股份有限公司

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

(11) 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

客户服务电话：4008888108、95587

公司网址：www.csc108.com

(12) 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

(13) 广发证券股份有限公司

联系地址：广州市天河区天河北路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

(14) 中信证券股份有限公司

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

(15) 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

(16) 海通证券股份有限公司

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

(17) 申万宏源证券有限公司

联系地址：上海市长乐路989号世纪商贸广场45层

客户服务电话：95523 4008895523

公司网址：www.sywg.com

(18) 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.cjsc.com.cn

(19) 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层、28层A02单元

客户服务电话：4008001001

公司网址：www.essence.com.cn

(20) 上海汇付基金销售有限公司

联系地址：上海市黄浦区中山南路100号19层

客户服务电话：400-820-2819

公司网址： tty.chinapnr.com

(21) 万联证券股份有限公司

联系地址：广东省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

(22) 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：4006515988

公司网址：www.bhzq.com

(23) 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号楼第20层

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(24) 东吴证券股份有限公司

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

(25) 东方证券股份有限公司

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.cc168.com

(26) 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14、16、17层

客户服务电话：4006666888

公司网址：www.cgws.com

(27) 国联证券股份有限公司

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

(28) 浙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

客户服务电话：967777

公司网址：www.stocke.com.cn

(29) 平安证券股份有限公司

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

(30) 国都证券股份有限公司

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（100007）

客户服务电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(31) 东海证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东区东方路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

(32) 国盛证券有限责任公司

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

(33) 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

(34) 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18楼

客户服务电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

(35) 金元证券股份有限公司

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

(36) 中航证券有限公司

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：400-8866-567

公司网址：www.scstock.com

(37) 中国中投证券有限责任公司

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04、18层至21层

客户服务电话：4006008008、95532

公司网址：www.china-invs.cn

(38) 长城国瑞证券有限公司

联系地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼

客户服务电话：400-0099-886

公司网址：https://www.gwgsc.com/m

(39) 世纪证券有限责任公司

联系地址：深圳市福田区深南大道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

(40) 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27层及28层

客户服务电话：010-65051166

公司网址：www.cicc.com.cn

(41) 信达证券股份有限公司

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

(42) 华福证券有限责任公司

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

(43) 光大证券股份有限公司

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

(44) 天相投资顾问有限公司

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

(45) 国元证券股份有限公司

联系地址：安徽省合肥市寿春路179号

客户服务电话：4008888777

公司网址：www.gyzq.com.cn

(46) 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

(47) 国信证券股份有限公司

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：8008108868

公司网址：www.guosen.com.cn

(48) 华泰证券股份有限公司

联系地址：江苏省南京市中山东路90号

客户服务电话：4008888168、95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(49) 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47-49层

客户服务电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(50) 郑州银行股份有限公司

联系地址：郑州市郑东新区商务外环22号郑银大厦

客户服务电话：4000967585

公司网址：www.zzbank.cn

(51) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

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：400-089-1289

公司网址： www.erichfund.com

(52) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

(53) 上海天天基金销售有限公司

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

(54) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

联系地址：浙江省杭州市西湖区学院路28号德力西大厦1号楼12楼小邮局

客户服务电话：4000766123

公司网址：www.fund123.cn

(55) 九州证券股份有限公司

联系地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心D座5层

客户服务电话：400-654-3218

公司网址：www.jzsec.com

(56) 国海证券股份有限公司

联系地址：广西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

(57) 上海好买基金销售有限公司

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：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

(58) 中期时代基金销售（北京）有限公司

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

(59) 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

公司网站：www.hexun.com

(60) 众升财富（北京）基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

客户联系电话：400-059-8888

公司网址：www.zscffund.com

(61) 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：961303

公司网址：www.gzs.com.cn

(62) 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

客户服务电话：400-888-8993

公司网站：www.dxzq.net

(63) 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40号二十一世纪大厦A座303室

客户服务电话：4008199868

公司网站：www.tdyhfund.com

(64) 上海基煜基金销售有限公司

联系地址：上海市昆明路518号北美广场A1002室

客户服务电话：021-65370077

公司网址：www.jiyu.com.cn

(65) 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源10号

客户服务电话：4006-802-123

公司网址：www.zhixin-inv.com

(66) 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

(67) 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

(68) 珠海盈米财富管理有限公司

联系地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(69) 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大街11号11层1108

客户服务电话：4006-199-059

公司网站：www.fundzone.cn

(70) 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

公司网站：www.dtfunds.com

(71) 上海凯石财富基金销售有限公司

联系地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

客户服务电话：4006-433-389

公司网址：www.lingxianfund.com

(72) 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号浦江金融世纪广场

客户服务电话：400-067-6266

公司网址：www.leadfund.com.cn

(73) 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：http://www.xinlande.com.cn/

(74) 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

(75) 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号楼701内09室

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

(76) 浙江金观诚基金销售有限公司

联系地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

客户服务电话：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

(77) 和耕传承基金销售有限公司

联系地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层

客户服务电话：400-555-671

公司网址：www.hgccpb.com

(78) 北京新浪仓石基金销售有限公司

联系地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

(79) 上海万得基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

客户服务电话：400-821-0203

(80) 深圳富济基金销售有限公司

联系地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

客户服务电话：0755-83999907

公司网址：www.jinqianwo.cn

(81) 上海联泰资产管理有限公司

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：021-52822063

公司网址：www.66zichan.com

(82) 天津国美基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

客户服务电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

(83) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

联系地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

客户服务电话：400-890-9998

公司网址：www.jnlc.com

(84) 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

(85) 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302室

客户服务电话：400-6767-523

公司网址：www.zzwealth.cn

(86) 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1808单元

客户服务电话：010-56202920

公司网址：www.xintongfund.com

(87) 深圳市金斧子基金销售有限公司

联系地址：深圳市南山区科苑路科兴科学园B3单元7楼

客户服务电话：400-9500-888

公司网址：www.jfzinv.com

(88) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

联系地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115-1116室

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(89) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

联系地址：北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

(90) 申万宏源西部证券有限公司

联系地址：北京市西城区太平桥大街19号客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(91) 上海挖财基金销售有限公司

办公地址： 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

客服电话：021-50810673

公司网站：www.wacaijijin.com

(92) 南京苏宁基金销售有限公司

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

客户服务电话：95177

公司网站：www.snjijin.com

(93) 北京虹点基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

客户服务电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

(94) 北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

客服电话：400-061-8518

公司网站：danjuanapp.com

(95) 天津万家财富资产管理有限公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦

客服电话：010-59013895

公司网站：www.wanjiawealth.com

(96) 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

(97) 北京肯特瑞基金销售有限公司

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座

公司网站：http://fund.jd.com

客户服务电话：400 088 8816

(98) 济安财富（北京）基金销售有限公司

办公地址：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

公司网站：www.jianfortune.com

客户服务电话：400 673 7010

(99) 喜鹊财富基金销售有限公司

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

公司网站：www.xiquefund.com

客户服务电话：400 6997 719

(100) 国金证券股份有限公司

办公地址：成都青羊区东城根上街95号

公司网站：www.gjzq.com.cn

客户服务电话：95310

(101) 成都华羿恒信基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区福中一路1001号富德生命保险大厦19楼02单元

公司网站：http://www.huayihengxin.com/

客户服务电话：4008010009

(102) 民商基金销售（上海）有限公司

办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼

公司网站：http://www.msftec.com/

客户服务电话：021-50206003

（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：宝盈中证100指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：股票指数型

六、基金的投资目标

在基金合同规定的范围内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.75%、基金总体投资业绩超越中证100指数的表现。

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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。其中，中证100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金为增强型指数基金，对指数投资部分采用完全复制法，按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。

1、资产配置策略

本基金将不低于80%的基金资产投资于中证100指数成份股和备选成份股，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5%。

本基金将根据市场的实际情况，在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例，以争取实现对标的指数的超越。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，指数化投资部分将按照中证100 指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略，通过公司内部的数量化选股模型，选出流动性高投资价值好的品种，预期股票市场向上时对该类品种进行积极配置，预期股票市场向下时对股票进行低配或者不配并视情况适当提高固定收益类产品的配置。

（2）指数化投资部分股票组合的调整

本基金所构建的指数化投资部分股票投资组合将根据中证100 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

1）定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对该部分股票投资组合及时进行调整。

2）不定期调整

①如果预期目标指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股；

②当成份股发生配股、增发、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时该部分调整股票投资组合；

③根据本基金的申购和赎回情况，对该部分股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

④因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得本基金无法依照目标指数权重购买某成份股。本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入相关的替代性股票；

⑤根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时调整，并相应对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运作；

⑥根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，并在法律法规允许的范围内辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

（3）主动投资部分股票组合的调整

1）在成份股内进行有限度调整。

本基金通过公司内部的数量化选股模型，判断成份股的流动性和投资价值。综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，本基金将有限度地对成份股进行增强性投资。

2）对非成份股进行有限度调整。

本基金在充分研究的基础上，选出流动性高投资价值好的非成份股。

在预期股票市场向上时，精选其中的部分或者大部分股票进行积极配置。

在预期股票市场向下时，对非成份股进行低配或者不配。

此外，本基金还将及时把握一级市场上新股申购与增发的盈利机会，并适度进行成份股与相应可转换债券之间的套利操作，以求提高资金运用效率。

3、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

在预期股票市场向下时，本基金也可以对包括到期日在一年以内的政府债券在内的各类固定收益类产品进行配置。

本基金债券投资将采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等策略。

4、金融衍生产品投资策略

本基金采用市场公认的定价技术，适当参与金融衍生产品的投资，以实现以下目的：

①对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险；

②适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用；

③利用金融衍生产品的杠杆作用，减少现金及债券对跟踪指数的拖累。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

中证100指数×95%+活期存款利率（税后）×5%

中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股，它流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，能够作为指数基金的标的指数。

如果中证100指数被停止编制及发布，或中证100指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致中证100指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准后予以公告。

十、基金的风险收益特征

本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的80%，预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日，本报告中的财务数据未经审计。

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	205,650,744.34	93.12
	其中：股票	205,650,744.34	93.12
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	14,888,031.96	6.74
8	其他资产	302,275.32	0.14
9	合计	220,841,051.62	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

2.1 指数投资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	7,018,221.00	3.19
C	制造业	71,561,266.83	32.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,025,429.00	2.74
E	建筑业	7,332,706.40	3.34
F	批发和零售业	1,515,008.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	4,308,023.00	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,104,179.08	1.41
J	金融业	85,636,190.94	38.95
K	房地产业	9,460,952.00	4.30
L	租赁和商务服务业	2,006,943.84	0.91
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	1,144,703.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	199,113,623.09	90.56

2.2 积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	3,597,771.26	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	243,319.85	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	786,920.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,486,864.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	341,020.00	0.16
J	金融业	-	-
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	81,226.14	0.04
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	6,537,121.25	2.97

3.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1期末指数投资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	601318	中国平安	312,290	18,293,948.20	8.32
2	600519	贵州茅台	14,400	10,533,024.00	4.79
3	600036	招商银行	295,500	7,813,020.00	3.55
4	000333	美的集团	132,150	6,900,873.00	3.14
5	000651	格力电器	139,600	6,582,140.00	2.99
6	601166	兴业银行	362,000	5,212,800.00	2.37
7	600887	伊利股份	173,700	4,846,230.00	2.20
8	600276	恒瑞医药	63,962	4,845,761.12	2.20
9	600016	民生银行	684,100	4,788,700.00	2.18
10	601328	交通银行	779,600	4,474,904.00	2.04

3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603288	海天味业	23,400	1,723,176.00	0.78
2	600009	上海机场	26,800	1,486,864.00	0.68
3	000568	泸州老窖	20,200	1,229,372.00	0.56
4	601933	永辉超市	103,000	786,920.00	0.36
5	601360	三六零	11,800	341,020.00	0.16

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.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告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投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

10.1 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。

10.2 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投资国债期货。

10.3 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

11.1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未受到公开谴责、处罚。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,755.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,303.89
5	应收申购款	263,215.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	302,275.32

11.4 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。

11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

11.6 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

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效日为2010年2月8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2018年6月30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
2010年2月8日至2010年12月31日	-10.00%	1.51%	-6.52%	1.51%	-3.48%	0.00%
2011年	-20.56%	1.19%	-19.85%	1.20%	-0.71%	-0.01%
2012年	8.25%	1.13%	10.32%	1.16%	-2.07%	-0.03%
2013年	-8.79%	1.34%	-12.38%	1.38%	3.59%	-0.04%
2014年	58.92%	1.18%	56.14%	1.26%	2.78%	-0.08%
2015年	-0.09%	2.32%	-1.07%	2.34%	0.98%	-0.02%
2016年	-3.84%	1.27%	-7.03%	1.19%	3.19%	0.08%
2017年	34.04%	0.66%	28.56%	0.65%	5.48%	0.01%
2018年一季度	-2.91%	1.20%	-3.22%	1.20%	0.31%	0.00%
2018年二季度	-6.99%	1.11%	-8.22%	1.12%	1.23%	-0.01%

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.基金财产拨划支付的银行费用；

4.基金合同生效后的基金信息披露费用；

5.基金份额持有人大会费用；

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7.基金的证券交易费用；

8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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、休息日，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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3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，支付日期顺延。

3.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购费用

根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》的规定，基金申购费用是支付给基金销售机构的手续费，按申购金额的一定比例收取，由投资人承担，不列入基金资产。本基金在申购时收取申购费用，申购费率按申购金额的增加而递减。

具体费率如下：

申购金额M	申购费率
M＜100万	1.2%
100万≤M＜300万	0.8%
300万≤M＜500万	0.3%
500万≤M	固定费用1000元

基金管理人有权规定投资者在赎回基金份额时收取该部分基金份额的申购费用，具体办理规则和费率由基金管理人届时在公告或更新的招募说明书中明确后执行。

2. 赎回费用

本基金的赎回费用按持有期递减，最高不超过赎回总金额的1.5%。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。本基金将持续持有期大于等于7日的投资者的赎回费用的75%作为注册登记费，剩余25%留作基金资产。具体费率如下：

赎回期限（N）	赎回费率
N＜7日	1.5%
7日≤N＜1年	0.5%
1年≤N＜2年	0.25%
N≥2年	0

3.转换费

目前可在宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈核心优势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、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈中证100指数增强型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新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、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈人工智能主题股票型证券投资基金二十四只基金之间实施转换。

（1）基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

①基金转换申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费低于转入基金的申购费的，补差费为转入基金的申购费和转出基金的申购费差额。转出基金金额所对应的转出基金申购费高于转入基金的申购费的，补差费为零。

②转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

（2）转换份额的计算公式

转出金额＝转入金额＝B×C×(1－D) /（1+G）+H

转入份额＝转入金额/E

其中：

B为转出的基金份额；

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D为转出基金的对应赎回费率；

G为对应的申购补差费率；

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

H为转出基金份额对应的未支付收益，若转出基金为非货币市场基金的，则H=0

例：投资者申请将持有的本基金 10,000 份转换为宝盈核心优势混合A（213006），假设转换当日本基金的基金份额净值为 1.0610 元，投资者持有该基金 7个月，对应赎回费为 0. 5%，申购费为 1.2%，宝盈核心优势混合A的基金份额净值为1.163 元，申购费为 1.5%，则投资者转换后可得到的宝盈核心优势混合A基金份额为：

转出金额＝转入金额＝10，000×1.0610×(1－0. 5%) /（1+0.3%）+0=10，525.37元

转入份额＝10，525.37/1.163＝9，050.19份

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

特别提示：

由宝盈增强收益债券A、宝盈中证100指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技30混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票转入宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长混合、宝盈策略增长混合、宝盈核心优势混合A、宝盈资源优选混合、宝盈睿丰创新混合A时，如果投资者的转入金额在500万(含)到1000万之间，在收取基金转换的申购补差费时，将直接按照转入基金的申购费收取，不再扣减申购原基金时已缴纳的1000元申购费。

（3）网上直销转换费率

根据本基金管理人2014年5月7日发布的《宝盈基金管理有限公司关于网上交易平台费率优惠方案调整的公告》，投资人在本公司网上交易平台使用除招商银行直联渠道以外的支付渠道，转换补差费率享受1折优惠；使用招商银行直联渠道转换为其他前端收费基金的，转换补差费率享受8折优惠；标准转换补差费率为固定费用的，按标准费率执行。

目前宝盈基金网上直销支持的银行卡包括：中国建设银行、中国农业银行、中国银行、招商银行、交通银行、平安银行、广发银行、中国民生银行、中信银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行、中国工商银行、银联通（上海银联）支持银行卡、汇付天下支持银行卡、快付通支持银行卡、富友支付支持银行卡。

十四、对招募说明书更新部分的说明

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

1. 在"重要提示"部分，更新了本招募说明书所载内容和相关财务数据的截止时间。

2. 在"一、绪言"中，增加了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》这一法律依据。

3. 在"二、释义"中，增加了《流动性规定》、流动性受限资产的相关释义。

4. 在"三、基金管理人"部分，更新了证券投资基金管理情况和主要人员情况的相应内容。

5. 在"五、相关服务机构"部分，更新了代销机构的相应内容。

6. 在"八、基金份额的申购和赎回"中，更新了申购与赎回的数额限制、基金的申购费与赎回费、巨额赎回的认定及处理方式、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理、基金份额的转换的相应内容。

7. 在"九、基金的投资"部分，更新了投资范围、投资限制、基金的投资组合报告的内容。

8. 在"十、基金的业绩"部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。

9. 在"十二、基金资产估值"中，更新了暂停估值的情形的相应内容。

10. 在"十六、基金的信息披露"中，增加了《流动性规定》这一法律依据，更新了基金的年度报告、半年度报告、季度报告、临时报告与公告的相应内容。

11. 在"十七、风险揭示"中，增加了本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险的相应内容。

12. 更新了"二十、基金托管协议的内容摘要"部分的内容。

13. 在"二十二、其他应披露事项"部分，披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司

二〇一八年九月二十一日