

宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈新锐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于2015年01月16日证中证监会证监许可[2015]124号文注册备案。本基金基金合同于2015年11月4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投资价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明其对基金管理人的能力和诚信状况进行任何保证,投资者投资于本基金并不等于将资金作为存款存入银行或存款类金融机构。

基金管理人过往业绩并不预示其未来业绩。
投资有风险,投资人申购基金前应认真阅读本招募说明书。
本基金为混合基金,其预期收益及预期风险水平高于货币型基金及债券型基金,属于中收益/风险特征的基金。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: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,大量赎回或赎回导致的流动性风险,基金管理人及投资经营过程中产生的操作风险等等。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多为中小、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,在一定程度上增加基金的投资风险和流动性风险。

本招募说明书除基金合同和基金招募说明书外,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》及其他有关约定履行权利、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《基金合同》。

本招募说明书更新前所载内容截止日为2018年11月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年09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。

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:李文杰
总经理:张啸川
办公地址:深圳市福田区福华一路11号投行大厦10层
注册资本:10000万元人民币
电话:0755-83516589
传真:0755-83516599

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,股东包括中信信托有限责任公司、中国对外经济贸易信托有限公司,其中中信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
李文杰先生,董事长,1969年生,中共党员,经济师。1978年12月至1985年6月在中国人民银行成都市支行行政处中路办事处工作;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2000年11月成都二重信託投资有限公司任职,历任任经理、总经理助理;2002年11月至今在中国信托投资有限公司担任副总经理。

张啸川先生,董事,1968年生,硕士研究生,高级会计师。1985年7月至1989年10月在中铁二局筑路公司广州、深圳、珠海项目部任职,历任项目经理、会计师、审计师;1989年11月至2001年4月在中铁二局筑路公司财务科任职,历任副科长、科长、总会计师;2001年6月至2003年10月在中铁二局股份公司任财务部部长,中铁二局集团专家委员财务组组长;2003年11月至2006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,现任中信信托有限责任公司总经理。

陈亦东先生,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管理与行政学院副教授任职;1998年5月至1999年3月在四川省信托投资公司任职;1999年3月至2000年10月在陕西省信托投资公司峨边县办事处任总经理助理;2000年10月至2000年6月在兴证证券有限责任公司工作;2002年6月开始担任平安信托投资有限公司总经理助理,现任中国对外经济贸易信托有限公司总经理兼风险管理委员会主席。

刘洪明先生,董事,1970年生,硕士研究生。1996年9月至1997年8月,在天津南开大学任职;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总部总经理,现任中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部总经理。

张苏芳先生,独立董事,1967年生,中共党员,博士研究生。1975年12月至1978年3月,在陕西机电局任职;1982年2月至1985年9月,在陕西省西安农机机械厂任助理工程师;1985年9月至1988年,在陕西机电局任工程师、车间副主任;1988年5月至2000年4月,在陕西财经学院经济学院任教授、系主任;2000年4月至2003年7月,在西安交通大学会计学院任教授、系主任;2003年7月至2016年12月在中国政法大学民商经济法学院教授兼法律研究所所长、教授、博士生导师;2016年12月至今在中国政法大学商学院会计研究所任教授、博士生导师。

廖彬先生,独立董事,1977年生,法学硕士研究生。2003年至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。兼任四川润德律师事务所律师,成都市传媒集团润德润达实业有限公司法律顾问,乐山市州州民村镇行履行职务,成都市中级人民法院审判员,四川省住房和城乡建设厅专家委员会委员。

王艳艳女士,独立董事,1980年生,中共党员,会计学博士。2007年8月至2008年8月,在美国休斯敦大学从事博士后研究工作;2008年9月至2010年12月,在厦门大学会计与统计学院担任助理教授;2011年1月至2014年7月,在厦门大学(中国)大学财务与会计学院担任助理教授;2014年8月至今,在厦门大学管理学院任教。

徐旭根先生,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,在西南财经大学工作;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与研究所所长。

张凯川先生,董事,1978年生,中共党员,经济学博士。2005年3月-2006年5月任教于中国证劵业协会市场监管部监管处。2005年5月至2009年11月任职于中国证监会任职4次处室副处长小组办公室。2009年11月至2011年9月担任中国证监会市场监管部市场监管处副处长。2011年8月至2012年9月担任中国证监会市场监管部综合处副处长。2012年9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、博时资产管理有限公司董事。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
张健女士,监事,1969年生,高级经济师。曾就职于四川华阳印刷厂、成都科力风险投资公司、成都工银信托有限公司、徽平信托有限责任公司,现任中信信托有限责任公司金融管理部总经理。

刘勇先生,监事,1973年生,中国注册会计师,ACCA。曾就职于中国林业银行研究院、中林林福源科技有限责任公司,同时兼任律师事务所,中国中化集团有限公司,驻马店华联会计师事务所,现任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)主任。

魏玲女士,监事,1970年生,中级经济师。曾任职于深圳中化集团股份有限公司、华证证券深圳营业部,现任宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

汪元先生,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、风险管理部总经理。

3.其他高级管理人员
李文杰先生,董事长(简历请参见董事会成员)。
张凯川先生,总经理(简历请参见董事会成员)。
张继东先生,督察长,1964年生,工学学士。曾就职于中国工商银行安徽省科技处,华证证券有限公司深圳投资理财管理部,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。

丁广先生,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月任职于中信信托有限公司综合管理部,人力资源部副总经理。2010年9月至2016年11月担任中信信托有限公司董工兼综合管理部,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董工兼董工、董工兼董工,现任宝盈基金管理有限公司董工兼董工。

葛俊杰先生,副总经理,1973年生,硕士。曾就职于深圳市政府外事办公室,深圳市政务信息发展服务办公室。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.基金投资决策
肖丹女士,北京大学金融学硕士。2008年7月至2015年7月先后在中国证券有限责任公司、民生证券有限责任公司和方正证券股份有限公司担任研究员,自2015年2月加入宝盈基金管理有限公司研究部,担任研究员。现任研究部副总经理(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、基金创新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

宝盈新锐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:
董俊龙,2015年11月4日至2017年1月7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:
丁广先生(主席);宝盈基金管理有限公司副总经理。
张杰梅女士(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。
邓杰先生(委员);宝盈基金管理有限公司固定收益部总经理。
刘杰先生(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。
肖丹女士(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、基金创新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
魏玲女士(委员);宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。
李婉女士(秘书);宝盈基金管理有限公司权益投资部秘书。

6.上、基金持有人之间不存在近亲属关系。
7.本基金托管人
(一)基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册地:中华人民共和国政府授权批准担任境内信托或受托管理业务
法定代表人:陈四清
基金业务条线负责人:李卫
托管部门信息披露联系人:王木昆
传真:(010)65949442
中国银行客服电话:95566
(二)基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务设立于1998年,现有员工110余人,部门员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作学习或培训经历,60%以上员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、货币基金、养老金基金、期货基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者等各类基金托管品种,托管规模位居行业领先地位,并圆满服务国内外的各类企业年金基金托管。中国银行为境内、外分行开展托管业务。

(三)证券投资基金托管情况
截至2018年09月30日,中国银行已托管67只证券投资基金,其中境内基金62只,ODI基金3只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居行业前列。

中国银行托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务内部控制工作是中国银行全面风险管理工作的重要组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则,中国银行托管

业务风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估,风险控制措施设置及制度建设,内外部检查及审计等手段强化托管业务各环节、全面、全程的风险管控。
2007年起,中国银行先后聘请外部会计师事务所开展托管业务开展专项内部审计工作,先后获得基于“SAS70”、“AA0106”、“ISA0340”和“SABER10”等国际主流内控审计准则的无保留意见的审计报告。2017年,中国银行继续获得了基于“ISA0340”和“SABER16”双准则的内部控制审计报告,中国银行托管业务内控控制完善,内控控制严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

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
登记人名册: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:李文杰
客户服务统一咨询电话:400-888-300(全国统一,免长途费)
传真:0755-83516466
联系人:陈静、李欣

2.代销机构:
(1) 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:96566
公网网址:www.boc.cn
(2) 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:96533
公网网址:www.ccb.com
(3) 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:96598
公网网址:www.icbc.com.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:96599
公网网址:www.bankcomm.com
(5) 平安银行股份有限公司
联系地址:深圳市深南东路6047号
客户服务电话:95511-3
公网网址:www.pingan.com
(6) 东莞农村商业银行股份有限公司
联系地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号
客户服务电话:0769-961122
公网网址:www.drcbank.com
(7) 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36 层
客户服务电话:96517
公网网址:www.axsec.com.cn
(8) 渤海证券股份有限公司
联系地址:天津市滨海新区泰达MSD商务区C区2051
客户服务电话:400-111-0889
公网网址:www.bhsec.com.cn
(9) 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:96597
公网网址:www.htsec.com
(10) 第一创业证券股份有限公司
联系地址:广东省深圳市福田区福华一路1号投行大厦16-20楼
客户服务电话:95388
公网网址:www.firstcapital.com.cn
(11) 东吴证券股份有限公司
联系地址:北京市西城区德胜门内大街15号
客户服务电话:400-8601588
公网网址:www.dwzq.com.cn
(12) 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988号
客户服务电话:96210
公网网址:www.gtja.com
(13) 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:962588、962589
公网网址:www.ebscn.com
(14) 广州证券股份有限公司
联系地址:广州市天河区珠江东路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
客户服务电话:95968
公网网址:www.gzs.com.cn
(15) 方正证券股份有限公司
联系地址:湖南省长沙市天心区湘中路463号华远华中心C、E号楼3701-3717
客户服务电话:96571
公网网址:www.fundsecurities.com
(16) 福建证券有限责任公司
联系地址:福州市鼓楼区五四路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话:96336
公网网址:www.fjdsc.com.cn
(17) 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:96511-8
公网网址:stock.pingan.com
(18) 长城证券股份有限公司
联系地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦16、17 层
客户服务电话:400-6666-888
公网网址:www.cgws.com
(19) 招商证券股份有限公司
联系地址:深圳市福田区福华一路118号
客户服务电话:95565、4008881111
公网网址:www.newchina.com.cn
(20) 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:965336、4008880001
公网网址:www.htsec.com
(21) 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:021-33388898
公网网址:www.swhyc.com
(22) 申万宏源证券有限公司
联系地址:深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话:021-33388898
公网网址:www.swhyc.com
(23) 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:021-33388898
公网网址:www.swhyc.com
(24) 申万宏源证券有限公司
联系地址:新疆乌鲁木齐市北京南路(新市区)北京南路368号大成国际大厦20楼
客户服务电话:400-800-0662
公网网址:www.swhyc.com
(25) 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
公网网址:www.cindasc.com
(26) 五矿证券有限公司
联系地址:深圳市福田区金田路4029号国际中心办公大楼47楼
客户服务电话:40018-40028
公网网址:www.wkzq.com.cn
(27) 中泰证券股份有限公司
联系地址:山东省济南市经七路86号
客户服务电话:96538
公网网址:www.zts.com.cn
(28) 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:96551或400-888-888
公网网址:www.chinastock.com.cn
(29) 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2幢5层529室
客户服务电话:400-076-1232
公网网址:www.fund123.com
(30) 深圳众禄基金销售有限公司
联系地址:深圳市罗湖区笋岗街道Halo广场7号楼
客户服务电话:4006-788-887
公网网址:www.zlfund.com
(31) 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:400-810-9999
公网网址:www.tdyf.com.cn
(32) 珠海盈米财富管理有限公司
联系地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼楼
客户服务电话:400-700-9665
公网网址:www.yingmi.com.cn
(33) 北京汇成基金销售有限公司
联系地址:北京市朝阳区东三环中街78号A座1108室
客户服务电话:400-199-0569
公网网址:www.hcfund.com
(34) 上海好买基金销售有限公司
联系地址:上海市浦东新区世纪大道1600号14楼04单元
客户服务电话:400-883-2266
公网网址:www.howbuy.com
(35) 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号于大厦金融大厦1503室
客户服务电话:400-820-5389
公网网址:www.juyinfund.com
(36) 浙江基金基金销售有限公司
联系地址:浙江省杭州市余杭区丁桥大街19号A座1504/1505室
客户服务电话:400-810-9999
公网网址:www.zhlfund.com.cn
(37) 珠海嘉米财富管理有限公司
联系地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼楼
客户服务电话:400-700-9665
公网网址:www.yingmi.com.cn
(38) 上海联泰基金销售有限公司
联系地址:上海市浦东新区世纪大道1600号14楼04单元
客户服务电话:400-628-3288
联系人:罗佳
四、基金名称
本基金名称:宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金
五、基金类型
本基金类型:契约型开放式基金
六、基金的投资目标
本基金以稳健投资为投资目标,在严格控制下行风险的基础上,通过有效的资产配置与投资标的精选,力争实现资产的稳定增值。
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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据)、资产支持证券、分离交易可转债、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规和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0%~96%;本基金在每个交易日收盘前扣除股指期货合约的公允价值后,保持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%;权证投资比例不得超过基金资产净值的3%;

(41) 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1088号浦江国际金融广场53层
客户服务电话:400-821-7765
公网网址:www.lidifund.com
(42) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
联系地址:深圳市福田区福强街道田田路178号华融大厦27楼2704
客户服务电话:0755-88394688
公网网址:www.xinlande.com.cn
(43) 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
公网网址:www.noah-fund.com
(44) 上海天天基金销售有限公司
联系地址:北京市西城区阜成门内大街19号中银大厦七层
客户服务电话:400-066-8896
公网网址:www.11wz.com.cn
(45) 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号金诚国际10楼
客户服务电话:400-688-1888
法定代表人:李文杰
客户服务统一咨询电话:400-888-300(全国统一,免长途费)
传真:0755-83516466
联系人:陈静、李欣

2. 代销机构:
(1) 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:96566
公网网址:www.boc.cn
(2) 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:96533
公网网址:www.ccb.com
(3) 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:96598
公网网址:www.icbc.com.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:96599
公网网址:www.bankcomm.com
(5) 平安银行股份有限公司
联系地址:深圳市深南东路6047号
客户服务电话:95511-3
公网网址:www.pingan.com
(6) 东莞农村商业银行股份有限公司
联系地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号
客户服务电话:0769-961122
公网网址:www.drcbank.com
(7) 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36 层
客户服务电话:96517
公网网址:www.axsec.com.cn
(8) 渤海证券股份有限公司
联系地址:天津市滨海新区泰达MSD商务区C区2051
客户服务电话:400-111-0889
公网网址:www.bhsec.com.cn
(9) 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:96597
公网网址:www.htsec.com
(10) 第一创业证券股份有限公司
联系地址:广东省深圳市福田区福华一路1号投行大厦16-20楼
客户服务电话:95388
公网网址:www.firstcapital.com.cn
(11) 东吴证券股份有限公司
联系地址:北京市西城区德胜门内大街15号
客户服务电话:400-8601588
公网网址:www.dwzq.com.cn
(12) 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988号
客户服务电话:96210
公网网址:www.gtja.com
(13) 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:962588、962589
公网网址:www.ebscn.com
(14) 广州证券股份有限公司
联系地址:广州市天河区珠江东路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
客户服务电话:95968
公网网址:www.gzs.com.cn
(15) 方正证券股份有限公司
联系地址:湖南省长沙市天心区湘中路463号华远华中心C、E号楼3701-3717
客户服务电话:96571
公网网址:www.fundsecurities.com
(16) 福建证券有限责任公司
联系地址:福州市鼓楼区五四路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话:96336
公网网址:www.fjdsc.com.cn
(17) 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:96511-8
公网网址:stock.pingan.com
(18) 长城证券股份有限公司
联系地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦16、17 层
客户服务电话:400-6666-888
公网网址:www.cgws.com
(19) 招商证券股份有限公司
联系地址:深圳市福田区福华一路118号
客户服务电话:95565、4008881111
公网网址:www.newchina.com.cn
(20) 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:965336、4008880001
公网网址:www.htsec.com
(21) 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:021-33388898
公网网址:www.swhyc.com
(22) 申万宏源证券有限公司
联系地址:深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话:021-33388898
公网网址:www.swhyc.com
(23) 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:021-33388898
公网网址:www.swhyc.com
(24) 申万宏源证券有限公司
联系地址:新疆乌鲁木齐市北京南路(新市区)北京南路368号大成国际大厦20楼
客户服务电话:400-800-0662
公网网址:www.swhyc.com
(25) 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
公网网址:www.cindasc.com
(26) 五矿证券有限公司
联系地址:深圳市福田区金田路4029号国际中心办公大楼47楼
客户服务电话:40018-40028
公网网址:www.wkzq.com.cn
(27) 中泰证券股份有限公司
联系地址:山东省济南市经七路86号
客户服务电话:96538
公网网址:www.zts.com.cn
(28) 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:96551或400-888-888
公网网址:www.chinastock.com.cn
(29) 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2幢5层529室
客户服务电话:400-076-1232
公网网址:www.fund123.com
(30) 深圳众禄基金销售有限公司
联系地址:深圳市罗湖区笋岗街道Halo广场7号楼
客户服务电话:4006-788-887
公网网址:www.zlfund.com
(31) 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:400-810-9999
公网网址:www.tdyf.com.cn
(32) 珠海盈米财富管理有限公司
联系地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼楼
客户服务电话:400-700-9665
公网网址:www.yingmi.com.cn
(33) 北京汇成基金销售有限公司
联系地址:北京市朝阳区东三环中街78号A座1108室
客户服务电话:400-199-0569
公网网址:www.hcfund.com
(34) 上海好买基金销售有限公司
联系地址:上海市浦东新区世纪大道1600号14楼04单元
客户服务电话:400-883-2266
公网网址:www.howbuy.com
(35) 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号于大厦金融大厦1503室
客户服务电话:400-820-5389
公网网址:www.juyinfund.com
(36) 浙江基金基金销售有限公司
联系地址:浙江省杭州市余杭区丁桥大街19号A座1504/1505室
客户服务电话:400-810-9999
公网网址:www.zhlfund.com.cn
(37) 珠海嘉米财富管理有限公司
联系地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼楼
客户服务电话:400-700-9665
公网网址:www.yingmi.com.cn
(38) 上海联泰基金销售有限公司
联系地址:上海市浦东新区世纪大道1600号14楼04单元
客户服务电话:400-628-3288
联系人:罗佳
四、基金名称
本基金名称:宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金
五、基金类型
本基金类型:契约型开放式基金
六、基金的投资目标
本基金以稳健投资为投资目标,在严格控制下行风险的基础上,通过有效的资产配置与投资标的精选,力争实现资产的稳定增值。
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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据)、资产支持证券、分离交易可转债、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规和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0%~96%;本基金在每个交易日收盘前扣除股指期货合约的公允价值后,保持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%;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
本基金按照积极主动的投资策略,运用多种方法进行资产配置,具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产配置策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。
(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分析,自上而下地实施积极的大类资产配置策略。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速度;
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货币信贷政策。
(3) 市场环境
①居民储蓄存在证券投资的增量;
②货币市场利率;
③券商自营规模变动情况;
④PE、ROPI新增投资额;
⑤新股发行;
⑥增发、配股所需资金;
⑦可转债市场情况;
⑧印花税和佣金;
⑨其他投资资金变动情况等。
(二) 股票投资策略
本基金的投资策略采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法,以深入的基本面研究为基础,精选具有持续成长性、价值被低估的上市公司股票。通过定量和定性相结合的方式构建备选投资组合。
本基金的行业配置策略以规避下行风险、降低组合波动率为目标,结合基金管理人对该行业的深入研究,同时参考内部和外部的定性研究成果,做出行业配置决策。
在进行行业配置的过程中,基金管理人主要关注的指标包括但不限于:由行业盈利对经济周期敏感度的行业景气度指标、行业景气度指标、行业销售收入增长率、行业毛利率和利率、原材料和成品价格涨幅以及库存率等。行业估值指标(P/E、P/B、EY/EBITDA等)以及投资者情绪等。
2. 个股精选策略
本基金主要采取“自下而上”的选股策略,选股策略的构建由定量筛选和定性筛选两部分组成。
(1) 首先,使用定量分析方法,通过财务和运营数据进入企业价值评估,初步筛选出具备优势的股票备选库。本基金主要从盈利能力、成长性以及估值水平等方面进行考量。
①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。
②成长性上
本基金通过成长性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净利润同比增长率和主营业务收入增长率等。
③估值水平
本基金通过估值水平分析评估当前市场价格的合理性,主要参考的指标包括市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市销率比率(P/S)、自由现金流收益率(PCF、PCPB)和企业价值/EBITDA等。
(2) 其次,使用定性分析方法,从成长性、市场、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行进一步精选。
本基金通过定性分析评估上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入分析,评估其持续成长的能力。通过对上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入分析,评估其持续成长的能力。具体为:产能利用率、原材料的供给率、生产规模在行业中的占比、产品结构竞争力、营销渠道、品牌竞争力等方面在行业中表现情况;公司的主营业务收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率、每股收益增长率等方面在行业中具有领先优势。
在行业前景方面,需考虑行业的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的力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包括股权结构、薪酬激励、盈利能力以及估值水平等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。
(三) 固定收益类资产配置策略
在进行固定收益类资产投资时,本基金将参考利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券的投资策略,选择合适时机投资于低风险的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。
1. 利率预期策略
通过跟踪预期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,并据此预测通胀、货币政策和宏观经济政策取向,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。
本基金将根据对市场利率变化趋势的预期,制定出组合的久期目标,预期市场利率水平上升时,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、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,分析债券的信用风险,确定企业债券的投资的信用风险评级。
债券信用风险评级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,同时需要参考企业的生产经营环境等外部因素,着重分析企业的偿债能力,评估其违约风险。
3. 套利交易策略
在预期和判断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投资策略,选择合适品种进行套利获取投资收益。在正常情况下它们之间的收益率利差是稳定的,但是在某种情况下,比如某个行业在经济周期的某一时段期待信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,若能提前预判并进行交易,就可进行套利减少损失。
4. 可转换债券的投资策略
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,对那些有较强盈利能力和成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。
基金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,研判发行人的投资价值,基于利率水平、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,对可转换债券的投资价值进行判断,制定可转换债券的投资策略。
5. 资产支持证券投资策略
本基金将分析资产支持证券的投资特征,估计违约风险和提前偿付比率,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。本基金将严格筛选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. 中小企业私募债券的投资策略
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评估、收益率预期、收益曲线变动、相对价值评估等策略,结合中小企业私募债券与基金流动性影响的分析,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。
本基金将重点关注中小企业私募债券的信用风险,通过对宏观经济研判,跟踪经济周期的景气程度,合理配置中小企业私募债券的资产配置比例,降低宏观经济波动带来的投资风险。本基金还将通过对发行人所处行业、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股,保证本基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,根据基金资产持有结构、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) 金融衍生品投资策略
1. 权证投资策略
本基金在符合可转换债券资产进行权证投资。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) 买入权证:买入的资产可能形成的对冲冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要用来对冲标的资产价格波动带来的投资风险;
(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,构建跨币种、跨组合、跨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,积极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机构有新规定的,本基金可相应调整和相关投资策略。
九、基金的风险收益特征
沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。
沪深300指数选择科学客观,流动性强,是目前市场上最有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具有广泛市场代表性,旨在反映债券市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的投资,使用上述业绩比较基准能够更真实反映本基金的风险收益特征。
若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或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。业绩比较基准的调整须经基金管理人和基金托管人协商,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,属于中收益/风险特征的基金。
十一、基金投资组合报告(截至2018年09月30日)
1. 期末资产配置情况
表1:基金资产配置情况表

表1:基金资产配置情况表