宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会2014年2月19日中国证监会证监许可[2014]213号文注册募集。本基金基金合同于2014年4月10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》。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险，这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，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。基金投资人欲了解份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年10月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。本招募说明书（更新）中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：宝盈基金管理有限公司
注册地址：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
成立时间：2001年5月18日
法定代表人：李文众
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 – 83275889
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、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月在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2018年1月在中铁信托有限责任公司任副总经理；2018年1月至今在中铁信托有限责任公司任副巡视员；2015年3月至今兼任宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人）。

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；2008年03月至2018年12月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；2008年4月至2018年12月任中铁信托有限责任公司副总经理；现任中铁信托有限责任公司总经理。

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，教授，硕士研究生导师，MBA导师。1975年至1978年任职于陕西重型机器厂；1982年至1985年任职于陕西省西安农业机械厂；1987年至1989年5月任职于陕西省西安农业机械厂；1989年至2000年任职于陕西财经学院；2000年至2003年任职于西安交通大学；2003年至今，在中国政法大学任教，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，中国总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，1977年生，法学博士。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，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，在厦门大学管理学院会计系任助理教授；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。

杨凯先生，董事，1974年生，中共党员，硕士研究生。1993年7月至1998年6月，在湖南工程学院任教师；1998年7月至2001年8月，在振远科技股份有限公司任销售经理；2003年7月至2016年9月在宝盈基金管理有限公司工作，历任市场开发部总监、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。2016年9月至2019年2月在中融基金管理有限公司工作，任公司总经理。2019年3月20日起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

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、风险管理部总经理。

3、高级管理人员

李文众先生，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）。

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

肖肖先生，北京大学金融学硕士。2008年7月至2015年2月先后在联合证券有限责任公司、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、宝盈新价值灵活配置混合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历任基金经理姓名及管理本基金时间：

段鹏程，2017年1月4日至2018年11月24日。

彭敢，2014年4月10日至2017年1月4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：

丁宁先生（主席）：宝盈基金管理有限公司副总经理。

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，宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金经理。

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基金经理。

魏玲玲女士（委员）：宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

李颖女士（秘书）：宝盈基金管理有限公司权益投资部秘书。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"）
设立日期：1987年4月8日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本：252.20亿元
法定代表人：李建红
行长：田惠宇
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号
电话：0755-83199084
传真：0755-83195201
资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2018年12月31日，本集团总资产67，457.29亿元人民币，高级法下资本充足率15.68%，权重法下资本充足率13.06%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工79人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值，独创"6S托管银行"品牌体系，以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖"，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；"托管通"获得国内《银行家》2016中国金融创新"十佳金融产品创新奖"；7月荣膺2016年中国资产管理"金贝奖""最佳资产托管银行"。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖"；"全功能网上托管银行2.0"荣获《银行家》2017中国金融创新"十佳金融产品创新奖"；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖"。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司"2017年度优秀资产托管机构"奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统"金点子"方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年"最佳基金托管银行"奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖"；12月荣膺2018东方财富风云榜"2018年度最佳托管银行"、"20年最值得信赖托管银行"奖。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2018年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管422只证券投资基金。

(四) 托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，以有效防范各种风险作为内部控制的核心，体现"内控优先"的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

（五）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《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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人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支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效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，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对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。

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：李依、梁靖

2、代销机构

（1）中国农业银行股份有限公司
联系地址：北京东城区建国门内大街69号
客户服务电话：95599
公司网址：www.abchina.com

（2）中国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

（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）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

（5）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

（6）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

（7）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

（8）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

（9）中信建投证券股份有限公司
联系地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际大厦
客户服务电话：4008888108、95587
公司网址：www.csc108.com

（10）国信证券股份有限公司
联系地址：深圳市罗湖区红岭中路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

（11）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

（12）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

（13）西南证券股份有限公司
联系地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
客户服务电话：95355
公司网址：www.swsc.com.cn

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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

（18）光大证券股份有限公司
联系地址：上海市静安区新闸路 1508 号
客户服务电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

（19）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

（20）平安证券股份有限公司
联系地址：深圳市福田中心区金田路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

（21）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

（22）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

（23）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

（24）中国国际金融股份有限公司
联系地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
客户服务电话：(+86-10) 6505 1166
公司网址：www.cicc.com.cn

（25）英大证券有限责任公司
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

（26）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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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

（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）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

（33）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

（34）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

（35）众升财富（北京）基金销售有限公司
联系地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
客户联系电话：400-876-9988
公司网址：www.wy-fund.com

（36）上海汇付基金销售有限公司
联系地址： 上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元
客户服务电话：400-821-3999
公司网址：www.hotjijin.com

（37）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

（38）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.

（39）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

（40）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

（41）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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）诺亚正行基金销售有限公司
联系地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋
客户服务电话：400-821-5399
公司网址：www.noah-fund.com

（46）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

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）深圳富济基金销售有限公司
联系地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位
客户服务电话：0755-83999907
公司网址：www.fujiwealth.cn

（52）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

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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

（57）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

（58）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.zzwealth.cn

（59）深圳市金斧子基金销售有限公司
联系地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
客户服务电话：400-930-0660
公司网址：www.jfzinv.com

（60）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

（61）深圳新华信通基金销售有限公司
联系地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦1806单元
客户服务电话：400-000-5767
公司网址：www.xintongfund.com

（62）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

（63）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

（64）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

（65）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

（66）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

（67）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/

（68）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

（69）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

（70）天津万家财富资产管理有限公司
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

（71）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

（72）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

（73）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

（74）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

（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：薛竟 罗佳
联系人：罗佳

四、基金的名称

本基金名称：宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式灵活配置混合型基金

六、基金的投资目标

本基金以超越业绩比较基准为目标，在严格控制下行风险的基础上进行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较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券）、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0% - 95%，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。本基金投资于权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，具体投资比例和限制等将另行公告。

八、基金的投资策略

本本基金将实施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、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四个部分组成。

（一）大类资产配置策略

本基金大类资产配置的策略目标是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。研判宏观形势的过程中主要考虑的因素包括：

1、宏观经济指标：年度/季度GDP增速、固定资产投资总量、消费价格指数、采购经理人指数、进出口数据、工业用电量、客运量及货运量等；

2、政策因素：税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策、利率水平、货币净投放等货币政策；

3、市场指标：市场整体估值水平、市场资金的供需以及市场的参与情绪等因素。

基金管理人将结合以上因素以及对全球宏观经济的研判，并且参考Black-Litterman Model和美林投资时钟等大类资产配置模型，在严格控制投资组合风险的前提下，动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例，力图规避市场风险，提高配置效率。

为了达到投资目标，本基金将采取审慎的配置策略，严防过于激进的投资决策。在通过以上指标与模型难以准确判断市场方向的时期，本基金将采取缩短固定收益类组合久期和降低股票仓位等方法最大限度的规避下行风险。

（二）股票投资策略

本基金的股票投资采取行业配置与"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，精选具有持续成长能力、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来构建备选股票库。

1、行业配置策略

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，结合基金管理人对波动率、相关性的定量研究，同时参考内部与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的敏感度定义的行业周期属性、行业景气度指标（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）、行业估值指标（P/E，P/B，EV/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，备选股票库的构建由定量筛选和定性筛选两部分组成。

（1）首先，使用定量分析的方法，通过财务和运营数据进行企业价值评估，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、成长能力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。

③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。

（2）其次，使用定性分析的方法，从持续成长性、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的精选。

持续成长性的分析。通过对上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入研究，评估具有持续成长能力的上市公司。具体为：产能利用率、原材料的自给率、生产规模在行业的占比较高；公司产品核心竞争力、营销渠道、品牌竞争力等方面在行业中表现较强；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。

（三）固定收益类资产投资策略

在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略、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，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

本管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

5、资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、中小企业私募债券的投资策略

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分析、收益率预期、收益率利差、收益率曲线变动、相对价值评估等策略，结合中小企业私募债券对基金资产流动性影响的分析，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别关注中小企业私募债券的信用风险分析。通过对宏观经济进行研判，根据经济周期的景气程度，合理增加或减少中小企业私募债券的整体配置比例，降低宏观经济系统性风险。本基金同时通过对发行主体所处行业、发行主体自身经营状况以及债券增信措施的分析，选择风险调整后收益最具优势的个券，保证本金安全并获得长期稳定收益。

本基金同时关注中小企业私募债券的流动性风险。在投资决策中，根据基金资产现有持仓结构、资产负债结构、基金申赎安排等，充分评估中小企业私募债券对基金资产流动性的影响，并通过分散投资等措施，提高中小企业私募债券的流动性。

（四）权证投资策略

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具：

1、运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能，构建权证与标的股票的组合，主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益；

2、构建权证与债券的组合，利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性，形成保本投资组合；

3、针对不同的市场环境，构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合，形成多元化的盈利模式；

4、在严格风险监控的前提下，通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究，谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深300指数选样科学客观，流动性高，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠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有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

十一、基金投资组合报告（截至2019年3月31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	951，638，181.16	94.32
	其中：股票	951，638，181.16	94.32
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	50，001，414.23	4.96
8	其他资产	7，299，209.86	0.72
9	合计	1，008，938，805.25	100.00

2、期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	204，199，357.00	20.35
B	采矿业	94，157，316.00	9.38
C	制造业	287，082，601.36	28.61
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	32，902.94	0.00
J	金融业	95，653，533.00	9.53
K	房地产业	270，512，470.86	26.96
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	951，638，181.16	94.85

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	002714	牧原股份	1，672，700	105，898，637.00	10.56
2	300498	温氏股份	2，421，200	98，300，720.00	9.80
3	601318	中国平安	1，238，900	95，519，190.00	9.52
4	601225	陕西煤业	10，567，600	94，157，316.00	9.38
5	000002	万 科A	2，996，126	92，040，990.72	9.17
6	600519	贵州茅台	103，790	88，635，622.10	8.83
7	600872	中炬高新	2，395，693	87，634，449.94	8.73
8	601155	新城控股	1，907，786	86，136，537.90	8.59
9	001979	招商蛇口	1，904，656	43，883，274.24	4.37
10	600048	保利地产	3，066，600	43，668，384.00	4.35

注：报告期末受市场波动及基金规模变动等影响，本基金持有的牧原股份占基金资产净值比例被动超过10%。本基金管理人将严格按照法律法规及基金合同的相关规定及时进行调整。

4、期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

6、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1)报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2)本基金所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	173，394.16
2	应收证券清算款	6，110，150.16
3	应收股利	-
4	应收利息	11，569.29
5	应收申购款	1，004，096.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7，299，209.86

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

本基金基金合同生效日为2014年4月10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3月31日）：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014年4月10日-2014年12月31日	15.30%	0.27%	37.26%	0.79%	-21.96%	-0.52%
2015年度	123.09%	3.29%	6.94%	1.61%	116.15%	1.68%
2016年	-18.36%	2.08%	-7.51%	0.91%	-10.85%	1.17%
2017年	0.29%	1.00%	12.43%	0.42%	-12.14%	0.58%
2018年	-28.43%	1.59%	-15.47%	0.87%	-12.96%	0.72%
2019年一季度	41.62%	1.43%	18.17%	1.00%	23.45%	0.43%

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的相关账户的开户及维护费用；
7、基金的证券交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

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

H＝E×1.5%÷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。经管理人与托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经管理人与托管人核对无误后，自产品成立一个月内由托管人从基金财产中划付，如资产余额不足支付该开户费用，由管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付，托管人不承担垫付开户费用义务。

4、上述"一、基金费用的种类"中第3-9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

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）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

(六)与基金销售有关的费用

1、申购费

费 用	费率（设申购金额为M）	
申购费	M<50万	1.50%
	50万≤M<200万	1.00%
	200万≤M<500万	0.80%
	M ≥500万	固定费用1000元

2、赎回费

本基金赎回费率最高不超过1.5%，按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

费 用	费率		
赎回费	持有期限<7日	1.50%	全额计入基金资产
	7日≤持有期限<30日	0.75%	全额计入基金资产
	30日≤持有期限<3个月	0.50%	75%计入基金资产
	3个月≤持有期限<6个月	0.50%	50%计入基金资产
	6个月≤持有期限	0.25%	25%计入基金资产

3、转换费

基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下部分基金在直销机构和部分代销机构的基金转换业务，具体内容详见2014年5月28日发布的《宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金开放日常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》、《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"第三部分 基金管理人"部分，更新了基金管理人概况、证券投资基金管理情况和主要人员情况的相应内容。

3）. 在"第四部分 基金托管人"部分，更新了基金托管人的相应内容。

4）. 在"第五部分 相关服务机构"部分，更新了代销机构的相应内容。

5）. 在"第八部分 基金份额的申购与赎回"中，更新了基金转换的相应内容。

6）. 在"第九部分 基金的投资"部分，更新了基金投资组合报告的内容。

7）. 在"第十部分 基金的业绩"部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。

8）. 在"第二十二部分 其他应披露事项"部分，披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司

二〇一九年五月二十四日