宝盈祥泰混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈祥泰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2015年5月11日中国证监会证监许可[2015]864号《关于核准宝盈祥泰混合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2015年5月29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。

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。

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2019年5月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31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：广东省深圳市福田区深圳特区报业大厦第15层
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
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：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。

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、其他高级管理人员

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、本基金基金经理

高宇先生，厦门大学投资学硕士。2008年6月至2009年8月任职于第一创业证券资产管理部，担任研究员；2009年8月至2010年10月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师，获首届金牛分析师第五名（团队）；2010年10月至2016年6月任职于博时基金，先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理，并负责信用团队；2016年7月至2017年8月任职于天风证券，担任机构业务总部总经理助理。2017年8月加入宝盈基金管理有限公司。现任宝盈基金固定收益部副总经理，宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金基金经理、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。

宝盈祥泰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：

陈若劲，2015年5月29日至2017年11月11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基金经理、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)。

2018年6月末，本集团资产总额228，051.82亿元，较上年末增加6，807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1，814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1，474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

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。

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2018年二季度末，中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”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”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（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）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，如有必要将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
注册地址：深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层
法定代表人：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）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

（3）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

（4）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

（5）国泰君安证券股份有限公司
联系地址：上海市静安区南京西路768号
客户服务电话：95521
公司网址：www.gtja.com

（6）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

（7）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

（8）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

（9）海通证券股份有限公司
联系地址：上海市广东路689号
客户服务电话：4008888001、95553
公司网址：www.htsec.com

（10）申万宏源证券有限公司
联系地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
客户服务电话：021-33389888
公司网址：www.swhysc.com

（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）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

（14）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

（15）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

（16）信达证券股份有限公司
联系地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
客户服务电话：95321
公司网址：www.cindasc.com

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

（25）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

（26）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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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

（31）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

（32）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

（33）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

（34）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

（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号太平金融大厦1503室
客户服务电话：400-820-5369
公司网址：www.jiyufund.com.

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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

（40）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

（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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）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)东风南路东、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

（46）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

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）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

（52）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

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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

（57）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

（58）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

（59）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

（60）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

（61）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

（62）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

（63）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

（64）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/

（65）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

（66）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

（67）万家财富基金销售有限公司
联系地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
客户服务电话：010-59013895
公司网址：www.wanjiawealth.com

（68）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

（69）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

（70）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

（71）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

（72）江苏汇林保大基金销售有限公司
联系地址：南京市新街口中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座
客户服务电话：025-56663409
公司网址：www.huilinbd.com

（73）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市生态大街6666号
客户服务电话：95360
网址：www.nesc.cn

（74）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

（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：宝盈祥泰混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式混合型基金

六、基金的投资目标

本基金采取稳健的投资策略，在控制下行风险的前提下，确定大类资产配置比例，通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益，适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资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

1、宏观形势研判

本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。

本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略。研判宏观形势的过程中主要考虑的因素包括：

（1）宏观经济环境

①季度GDP及其增长速度；

②月度工业增加值及其增长率；

③月度固定资产投资完成情况及其增长速度；

④月度社会消费品零售总额及其增长速度；

⑤月度居民消费价格指数、工业品价格指数以及主要行业价格指数；

⑥月度进出口数据以及外汇储备等数据；

⑦货币供应量M0、M1、M2的增长率以及贷款增速。

（2）政策环境

①财政政策；

②货币政策；

③产业政策；

④证券市场监管政策。

（3）市场资金环境

①居民储蓄进行证券投资的增量；

②货币市场利率；

③券商自营规模变动额；

④QFII、RQFII新增投资额；

⑤新股扩容；

⑥增发、配股所需资金；

⑦可转债所需资金；

⑧印花税和佣金；

⑨其他投资资金变动额等。

2、股票资产的仓位控制

为控制下行风险，本基金将以会计年度作为仓位控制策略的执行周期，以基金份额净值作为基准，确定股票资产的投资仓位上限。具体而言，本基金以上一会计年度末的基金份额净值作为基准（《基金合同》生效日所在年度基准为基金份额发售面值）设置仓位调整阀值，当基金份额净值与本会计年度单位累计分红金额之和连续5个交易日达到仓位调整阀值，则触发仓位调整基准。本基金应根据对未来市场的判断，在合理期限内将股票仓位调整至规定范围内。股票资产的仓位调整阀值和对应的股票仓位上限如下表所示：

仓位调整阀值	股票仓位上限
NAV1+D<0.97×NAV0	20%
0.97×NAV0≤NAV1+D<1.03×NAV0	30%
NAV1+D≥1.03×NAV0	40%

注：NAV0为上一会计年度年末基金份额净值（《基金合同》生效日所在年度，NAV0为基金份额发售面值），NAV1为当前基金份额净值，D为本会计年度单位累计分红金额（基金除权日在本会计年度的累计分红金额）。

（二）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。

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。

（三）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）以及投资人情绪等。

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、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。

（四）金融衍生品投资策略

1、权证投资策略

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

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

（2）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。

2、股指期货投资策略

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

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+1%。

上述“一年期银行定期存款利率（税后）”是指当年1 月1 日中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。《基金合同》生效日所在年度以《基金合同》生效日中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”为准。

本基金采用上述业绩比较基准的理由是：本基金追求长期稳定投资回报，上述业绩比较基准能够较好地体现本基金的投资目标，并易于被投资者理解和接受。

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。

八、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，属于中等收益/风险特征的基金。

九、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	9，504，390.00	30.58
	其中：股票	9，504，390.00	30.58
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	12，662，778.78	40.74
	其中：债券	12，662，778.78	40.74
	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	8，774，640.10	28.23
8	其他资产	139，548.63	0.45
9	合计	31，081，357.51	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	7，983，390.00	27.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	1，521，000.00	5.22
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	9，504，390.00	32.62

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	600887	伊利股份	70，000	2，037，700.00	6.99
2	600872	中炬高新	50，000	1，829，000.00	6.28
3	600309	万华化学	30，000	1，365，900.00	4.69
4	601633	长城汽车	160，000	1，252，800.00	4.30
5	600519	贵州茅台	1，000	853，990.00	2.93
6	601318	中国平安	10，000	771，000.00	2.65
7	601128	常熟银行	100，000	750，000.00	2.57
8	002508	老板电器	20，000	644，000.00	2.21

4、期末按债券品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	2，201，000.00	7.55
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	10，461，778.78	35.90
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	12，662，778.78	43.46

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

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	019537	16国债09	22，010	2，201，000.00	7.55
2	128052	凯龙转债	14，992	1，917，326.88	6.58
3	110047	山鹰转债	15，000	1，773，300.00	6.09
4	113014	林洋转债	16，000	1，691，680.00	5.81
5	110042	航电转债	12，200	1，501，210.00	5.15

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

10、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)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	61，117.35
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	64，613.92
5	应收申购款	12，817.36
6	其他应收款	1，000.00
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	139，548.63

(4)期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113014	林洋转债	1，691，680.00	5.81
2	110042	航电转债	1，501，210.00	5.15
3	128036	金农转债	1，152，700.00	3.96

(5)期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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、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2015年5月29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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2015年5月29日–2015年12月31日	3.60%	0.08%	1.93%	0.01%	1.67%	0.07%
2016年	0.58%	0.10%	2.50%	0.01%	–1.92%	0.09%
2017年	2.21%	0.08%	2.50%	0.01%	–0.29%	0.07%
2018年	–0.66%	0.28%	2.50%	0.01%	–3.16%	0.27%
2019年一季度	4.54%	0.58%	0.62%	0.01%	3.92%	0.57%

十一、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、仲裁费和诉讼费；

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、期货交易费用；

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

（五）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降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

（六）与基金有关的费用

1、申购费

本基金申购费率最高不高于1.5%，且随申购金额的增加而递减。投资人重复申购的，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

费用类别	费率（设申购金额为M）	
申购费	M<100万	1.50%
	100万≤M<200万	1.00%
	200万≤M<500万	0.80%
	M ≥500万	固定费用1000元

基金管理人网上交易平台详细费率标准及费率标准调整，请查阅网上交易平台及相关公告。

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%	
	30日≤持有期限<90日	0.50%	75%计入基金资产
	90日≤持有期限<180日	0.50%	50%计入基金资产
	180日≤持有期限<365日	0.20%	25%计入基金资产
	365日≤持有期限<730日	0.10%	
	持有期限≥730日	0%	

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2015年6月11日发布的《宝盈祥泰养老混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》和其他有关基金转换公告。

十三、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“第五部分 相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构、代销机构的相应内容。

4）. 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。

5）. 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。

6）. 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。

7）. 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
二〇一九年七月十二日