# 宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2015年9月21日经中国证监会证监许可[2015]2160号文注册募集。本基金基金合同于2015年12月2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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于高收益/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。本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：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、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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。

本基金基金名称包含“沪港深”字样仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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2017年12月2日，有关财务数据和净值表现截止日为2017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：张啸川
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 － 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、公司高级管理人员

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。

张栋先生，董事，1977年生，硕士研究生。2000年8月至2001年5月，在中国化工进出口总公司资产管理部投资一部任副总经理；2001年6月至2002年3月，在中化进出口总公司投资部任项目经理；2002年3月至2003年2月，在飞秒光电科技（西安）有限公司光通信事业部任总经理助理；2003年2月至2004年3月，在中化国际（控股）股份有限公司冶金能源事业总部任项目经理；2004年3月至2009年5月，在山西中化寰达事业有限责任公司任总经理；2009年6月至2010年7月，在中化石油有限公司炼化事业部任高级项目经理；2010年7月至2011年2月，在中国中化股份有限公司工程管理部控制部任副经理；2011年2月至2013年7月，在中化石油有限公司油品销售南方事业部任副总经理；2013年7月至2014年1月，在中国对外经济贸易信托有限公司资产管理一部工作；2014年1月至2014年7月，在中国对外经济贸易信托有限公司资产管理三部任总经理；2014年7月至2016年7月，在中国对外经济贸易信托有限公司基础产业部任总经理；2016年7月至今，在中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部任总经理。

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。现任职于中国对外经济贸易信托有限公司审计稽核部。

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。

汪兀先生，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）其他高级管理人员

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

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。

张新元先生，副总经理，1997年3月至2002年8月任职于黄河证券，2002年9月至2004年2月任职于民生证券，2004年3月至2011年6月任职于长城基金管理有限公司，2011年7月加入宝盈基金管理有限公司，历任总经理办公室主任、机构业务部总监、总经理助理，现任公司副总经理、创新业务部总经理、投资经理。2017年8月起兼任中铁宝盈资产管理有限公司副董事长。

2、基金经理简历

段鹏程先生，厦门大学生物学硕士。曾任职于厦门国际信托投资公司，天同证券深圳中心营业部总经理助理、副总经理，诺安基金管理有限公司基金经理，特定客户资产管理部总监。2004年5月加入宝盈基金管理有限公司，历任特定客户资产管理部投资经理、副总监，研究部核心研究员、副总监、总监，权益投资部总监。现任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和宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

3、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（试行）成员包括：

张啸川先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

孙海波先生（秘书长）：权益投资部总经理、研究部总经理。

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。

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和宝盈新价值灵活配置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基金经理。

高宇先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益二部副总经理，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、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理。

方佳佳女士（秘书）：宝盈基金管理有限公司研究员，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

## 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
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
客户服务统一咨询电话：400-8888-300（全国统一，免长途话费）
传真：0755-83515466
联系人：梁靖、李依

2、代销机构

(1) 中国建设银行
联系地址：北京市西城区金融大街25号
客户服务电话：95533
公司网址：www.ccb.com

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

(3) 中国银行
联系地址：北京市西城区复兴门内大街1号
客户服务电话：95566
公司网址：www.boc.cn

(4) 交通银行
联系地址：上海市银城中路188号
客户服务电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

(5) 平安银行
联系地址：深圳市深南东路5047号
客户服务电话：95511-3
公司网址：www.bank.pingan.com

(6) 东莞农村商业银行
联系地址：东莞市东城区鸿福东路2号
客户服务电话：0769-961122
公司网址：www.drcbank.com

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

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

(9) 国信证券
联系地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话：8008108868
公司网址：www.guosen.com.cn

(10) 招商证券
联系地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39－45层
客户服务电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn

(11) 银河证券
联系地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦c座
客户服务电话：4008888888、95551
公司网址：www.chinastock.com.cn

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

(13) 申万宏源证券
联系地址：上海市长乐路989号世纪商贸广场40层
客户服务电话：95523 或 4008895523
公司网址：www.swhysc.com

(14) 长江证券
联系地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
客户服务电话：4008888999、95579
公司网址：www.cjsc.com.cn

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

(16) 西南证券
联系地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦22－25层
客户服务电话：4008096096
公司网址：www.swsc.com.cn

(17) 渤海证券
联系地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
客户服务电话：4006515988
公司网址：www.bhzq.com

(18) 东兴证券
联系地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12－15层
客户服务电话：4008888993
公司网址：www.dxzq.net

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

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

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

(22) 广州证券
联系地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼
客户服务电话：961303
公司网址：www.gzs.com.cn

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

(24) 申万宏源西部证券有限公司
客户服务电话：400-800-0562
公司网址：www.hysec.com

(25) 中泰证券
联系地址：山东省济南市市中区经七路86号
客户服务电话：95538
公司网址：www.zts.com.cn

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

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

(28) 方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层
客服电话：95571
公司网址：www.foundersc.com

(29) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
联系地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
客户服务电话：400-166-1188
公司网址：wen.wen@jrj.com.cn

(30) 上海长量基金
联系地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
客户服务电话：400-089-1289
公司网址：www.erichfund.com.cn

(31) 深圳众禄基金
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

(32) 上海天天基金
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

(33) 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万塘路18号黄龙时代广场B座6F?
客户服务电话：4000766123
公司网址：www.fund123.cn

(34) 上海好买基金
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

(35) 唐鼎耀华
联系地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
客户服务电话：400-819-9868
公司网址：www.tdyhfund.com

(36) 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

(37) 上海陆金所资产管理有限公司
联系地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼
客户服务电话：4008-219-031
公司网址：www.lufunds.com

(38) 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
客服电话：4008-773-772
公司网址：www.5ifund.com

(39) 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
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn

(40) 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

(41) )大泰金石投资管理有限公司
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

(42) 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
客服电话：4006-433-389
公司网址：www.lingxianfund.com

(43) 上海利得基金销售有限公司
联系地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
客户服务电话：400-067-6266
公司网址：www.leadfund.com.cn

(44) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
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

(45) 北京格上富信投资顾问有限公司
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

(46) 浙江金观诚财富管理有限公司
办公地址：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
网址：www.jincheng-fund.com

(47) 和耕传承基金销售有限公司
办公地址：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
网址：www.hgccpb.com

(48) 北京新浪仓石基金销售有限公司
办公地址：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
网址：www.xincai.com

(49) 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

(50) 深圳富济财富管理有限公司
办公地址：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

(51) 上海联泰资产管理有限公司
办公地址：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
网址：www.66zichan.com

(52) 天津国美基金销售有限公司
办公地址：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
网址：www.gomefund.com

(53) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司
办公地址：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
网址：www.jnlc.com

(54) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司
办公地址：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
网址：www.fengfd.com

(55) 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

(56) 杭州科地瑞富基金销售有限公司
办公地址：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
网址：www.cd121.com

(57) 上海中正达广投资管理有限公司
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
客户服务电话：400-6767-523
网址：www.zzwealth.cn

(58) 深圳市金斧子基金销售有限公司
办公地址：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
网址：www.jfzinv.com

(59) 奕丰金融服务（深圳）有限公司
办公地址：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
网址：www.ifastps.com.cn

(60) 深圳新华信通资产管理有限公司
办公地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦1808单元
网址：www.xintongfund.com

(61) 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

(62) 上海挖财金融信息服务有限公司
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
客服电话：021-50810673
公司网站：www.wacaijijin.com

(63) 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

(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
联系人：刘佳
经办律师：廖海、刘佳
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：（021）23238888
经办注册会计师：薛竞、周祎
联系人：周祎

## 四、基金的名称

本基金名称：宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金类型：股票型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金将深入挖掘医疗健康产业发展过程中带来的投资机会，在严格控制风险的前提下，分享上市公司发展带来的投资收益，谋求基金资产的长期、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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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、股指期货、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。

本基金可参与融资业务。

基金的投资组合比例为：股票（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票）投资占基金资产的比例为80%－95%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的40%，投资于医疗健康产业相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金投资于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

本基金的投资策略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、金融衍生品投资策略和参与融资业务投资策略五部分组成。

（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剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内A股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。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）市场指标
①市场整体估值水平；
②市场资金的供需；
③市场的参与情绪；
④两地市场估值/资金差异性。

（二）股票投资策略

1、医疗健康产业的界定

随着我国人口结构的变化和经济发展水平的提升，居民日益增长的医疗需求和保健意识对医疗健康产业的发展有着极大的推动作用。本基金所指的医疗健康产业包括医疗服务产业、保健养生服务产业和健康管理产业三个方面。

（1）医疗服务产业

指与满足居民就医用药需求直接相关的行业，是医疗健康的核心，涵盖了新生物医疗技术、医疗体制改革、医疗服务信息化等投资主题。

（2）保健养生服务产业

提供预防性人体机能调节和康复性治疗安排，是对医疗服务产业的补充，是医疗健康的重要组成部分，涵盖了保健康复、养生养老产业链等投资主题。

（3）健康管理产业

强调预防和控制疾病发生与发展的前瞻性预警防范措施，是医疗健康的新兴发展方向，涵盖了互联网移动医疗、可穿戴设备、药品福利管理（PBM）等投资主题。

因此，本基金所定义的医疗健康产业包括化学原料药、化学制药、中药、生物制品、医药商业、医疗器械、医疗服务、医疗保险、医疗软件开发、养老房地产开发等子行业。

未来如果医疗健康产业的覆盖范围发生变动，基金管理人有权对上述界定进行调整和修订。

2、子行业配置策略

在行业配置方面，本基金着重分析医疗健康产业涵盖的各行业技术成熟度、行业所处生命周期、行业内外竞争空间、行业盈利前景、行业成长空间及行业估值水平等多层面的因素，在此基础上判断行业的可持续发展能力，从而确定本基金的行业配置。

3、个股精选策略

本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出医疗健康产业相关的优质上市公司进行投资。

（1）首先，使用定性分析的方法，从竞争优势、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

竞争优势分析：一是考察上市公司的市场优势，包括市场地位和市场份额、在细分市场的领先地位、品牌号召力与行业知名度以及营销渠道的优势和潜力等；二是考察上市公司的资源优势，包括物质和非物质资源，例如市场资源、技术资源等；三是考察上市公司的产品优势，包括专利保护、产品竞争力、产品创新能力和产品定价能力等优势。

市场前景分析：需要分析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。

公司治理分析：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。

（2）其次，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。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分析。

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净利润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。

4、港股通标的股票投资策略

本基金通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

本基金将对港股通标的进行系统性分析，在采用子行业配置策略和个股精选策略的基础上，结合香港股票市场情况，重点投资于港股通标的范围内受惠于我国宏观经济环境改善或医疗健康产业快速发展，且处于合理价位的具备核心竞争力的股票。

（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、资产支持证券投资策略

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务增信措施的分析，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）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。

（五）参与融资业务的投资策略

本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而更好的实现本基金的投资目标。

## 九、基金的业绩比较基准

申银万国医药生物行业指数收益率×70% ＋ 恒生综合指数收益率×20% ＋ 中证综合债券指数收益率×10%

申银万国医药生物行业指数为申银万国一级行业指数，覆盖了由上海申银万国证券研究所有限公司（以下简称“申万研究”）界定的医药生物行业上市公司标的，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。由恒生指数有限公司编制的恒生综合指数覆盖了香港联合交易所主板上市总市值前95%的股票标的，能够反映香港股票市场的整体走势，适合作为本基金港股股票组合的业绩比较基准。中证综合债券指数是一个综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，适合作为本基金债券部分的业绩基准。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

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

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于高收益/风险特征的基金。

本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

## 十一、基金投资组合报告（截至2017年9月30日）

1、期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 227,102,650.40 | 92.34 |
|  | 其中：股票 | 227,102,650.40 | 92.34 |
| 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 | 18,704,001.97 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 132,922.66 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 245,939,575.03 | 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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | － | － |
| B | 采矿业 | 39,793.60 | 0.02 |
| C | 制造业 | 199,146,202.08 | 81.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,093.44 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 73,555.60 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 26,380.90 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 25,571.91 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,468.03 | 0.01 |
| J | 金融业 | 27,450,500.00 | 11.22 |
| 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 | 81,588.27 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 51,196.08 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | － | － |
| P | 教育 | － | － |
| Q | 卫生和社会工作 | 115,299.99 | 0.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 44,000.50 | 0.02 |
| S | 综合 | － | － |
|  | 合计 | 227,102,650.40 | 92.86 |

3、期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

4、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 | 002675 | 东诚药业 | 1,789,950 | 22,463,872.50 | 9.18 |
| 2 | 300630 | 普利制药 | 390,000 | 22,386,000.00 | 9.15 |
| 3 | 600521 | 华海药业 | 800,380 | 17,944,519.60 | 7.34 |
| 4 | 600196 | 复星医药 | 500,000 | 17,095,000.00 | 6.99 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 450,000 | 16,618,500.00 | 6.79 |
| 6 | 300097 | 智云股份 | 530,000 | 15,608,500.00 | 6.38 |
| 7 | 300009 | 安科生物 | 800,000 | 14,208,000.00 | 5.81 |
| 8 | 000063 | 中兴通讯 | 500,000 | 14,150,000.00 | 5.79 |
| 9 | 000915 | 山大华特 | 380,000 | 13,094,800.00 | 5.35 |
| 10 | 002050 | 三花智控 | 800,000 | 12,864,000.00 | 5.26 |

5、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。

6、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。

7、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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9、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。

10、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。

11、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。

12、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 | 90,530.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | － |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 4,473.64 |
| 5 | 应收申购款 | 37,918.03 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 132,922.66 |

(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情况。

(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2015年12月2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2017年9月30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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2015年12月2日－2015年12月31日 | 1.10% | 0.5% | 3.64% | 0.92% | －2.54% | －0.42% |
| 2016年 | －14.05% | 1.88% | －8.97% | 1.35% | －5.08% | 0.53% |
| 2017年上半年 | 0.00% | 0.83% | 3.51% | 0.54% | －3.51% | 0.29% |
| 2017年三季度 | －0.35% | 0.89% | 1.72% | 0.53% | －2.07% | 0.36% |

## 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、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、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
10、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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷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3－10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<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12月30日发布的《宝盈医疗健康沪港深股票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、相关财务数据的截止时间，增加投资港股的相关风险提示以及基金资产并非必然投资港股的特别风险揭示。

2、在“第三部分 基金管理人”中，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”中，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” 中，更新了代销机构的相应内容。

6、在“第九部分、基金的投资” 中，增加投资港股的相关风险提示以及基金资产并非必然投资港股的特别风险揭示，更新了本基金投资组合报告的内容。

7、在“第十部分、基金的业绩” 中，更新了基金合同生效以来的投资业绩。

8、在“第十七部分、风险揭示” 中，增加了基金资产并非必然投资港股的特别风险揭示。

9、在“第二十二部分、其他应披露事项” 中，披露了本期已刊登的公告事项。

宝盈基金管理有限公司
二〇一八年一月十三日