

# 宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 38        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 7.6 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      | 42        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 42        |
| 7.8 报告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   | 42        |
| 7.9 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      | 42        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 42        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 42        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 43        |

|                                    |           |
|------------------------------------|-----------|
| <b>§ 8 基金份额持有人信息</b>               | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构              | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况           | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况  | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动</b>               | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示</b>                 | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 45        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动   | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 45        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况      | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况             | 45        |
| 10.8 其他重大事件                        | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b>         | <b>49</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 49        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 49        |
| <b>§ 12 备查文件目录</b>                 | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录                        | 49        |
| 12.2 存放地点                          | 49        |
| 12.3 查阅方式                          | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金名称            | 宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金  |                  |
| 基金简称            | 宝盈祥瑞定期开放混合         |                  |
| 基金主代码           | 006398             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型、定期开放式          |                  |
| 基金合同生效日         | 2019 年 3 月 20 日    |                  |
| 基金管理人           | 宝盈基金管理有限公司         |                  |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司         |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 1,155,128,716.09 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称:    | 宝盈祥瑞定期开放混合 A       | 宝盈祥瑞定期开放混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码:    | 006398             | 006399           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 905,858,798.46 份   | 249,269,917.63 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上,通过定期开放的形式保持适度流动性,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略 | <p>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。</p> <p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>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、股票投资策略和权证投资策略四个部分组成。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内,以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点,结合估值研究、投资者行为研究,自上而下确定组合整体杠杆率以及货币类、利率类、信用类、权益资产的配置比例。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资策略主要包括债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略。</p> <p>1) 债券资产配置策略。组合杠杆率及货币类、利率类、信用类债券的配置比例决策主要参考以下几个方面的研究:</p> <p>①宏观经济变量(包括但不限于宏观经济增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业周期等)、流动性条件、行业基本面等研究;</p> <p>②利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究;</p> <p>③宏观流动性环境及货币市场流动性研究;</p> <p>④大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。</p> <p>2) 行业配置策略。基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法,并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究,本基金以分散化配置模式为基础,实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异,在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上,合理地决定</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>不同行业的配置比例。</p> <p>3) 公司配置策略。基于公司价值研究的重要性, 本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况, 在充分考虑组合流动性特征的前提下, 结合行业周期研究, 甄别具有估值优势、基本面改善的公司, 以分散化配置模式为基础策略。</p> <p>(2) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析、公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略, 在严格控制风险的情况下, 通过信用研究和流动性管理, 选择风险调整后收益高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。</p> <p>(3) 中小企业私募债券投资策略</p> <p>中小企业私募债券票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究, 结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量, 综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征, 选择风险与收益相匹配的品种进行投资。</p> <p>(4) 可转换债券(含可交换债券)投资策略</p> <p>基于行业研究、公司研究可转债估值模型分析, 本基金在一、二级市场投资可转换债券(含可交换债券), 主要的投资策略包括行业配置策略、个券精选策略、转股策略、条款博弈策略等。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资, 控制流动性风险和非系统性风险, 追求股票投资组合的长期稳定增值。</p> <p>(1) 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作为备选投资标的。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面对股票进行考量。</p> <p>(2) 在定量分析的基础上, 基金管理人将深入调研上市公司, 并基于公司治理、公司发展战略、基本面变化、竞争优势、管理水平、估值比较和行业景气度趋势等关键因素, 评估上市公司的中长期发展前景、成长性和核心竞争力, 进一步优化备选投资标的。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内, 为了保证组合具有较高的流动性, 本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下, 投资于具有较高流动性的投资品种, 通过合理配置组合期限结构等方式, 积极防范流动性风险, 在满足组合流动性需求的同时, 尽量减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金, 预期收益和预期风险低于股票型基金, 高于货币市场基金、债券型基金, 属于中等收益/风险特征的基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|         |                              |                    |
|---------|------------------------------|--------------------|
| 名称      | 宝盈基金管理有限公司                   | 中国银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名                           | 张磊                 |
|         | 联系电话                         | 0755-83276688      |
|         | 电子邮箱                         | zhangl@byfunds.com |
| 客户服务电话  | 400-8888-300                 | 95566              |
| 传真      | 0755-83515599                | 010-66594942       |
| 注册地址    | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501     | 北京市西城区复兴门内大街 1 号   |
| 办公地址    | 广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号   |
| 邮政编码    | 518034                       | 100818             |
| 法定代表人   | 马永红                          | 刘连舸                |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报              |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com   |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人办公场所、基金托管人住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                         |
|--------|------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司 | 广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 宝盈祥颐定期开放混合 A                          | 宝盈祥颐定期开放混合 C                          |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日) | 报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 35,999,454.37                         | 9,630,837.94                          |
| 本期利润          | 37,485,003.92                         | 10,130,123.91                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0511                                | 0.0491                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.68%                                 | 4.52%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.82%                                 | 4.60%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | 85,988,552.63                         | 22,251,309.57                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0949                                | 0.0893                                |
| 期末基金资产净值      | 1,011,500,794.00                      | 276,917,356.34                        |
| 期末基金份额净值      | 1.1166                                | 1.1109                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 基金份额累计净值增长率   | 11.66%                                | 11.09%                                |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

- 2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 4、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈祥瑞定期开放混合 A

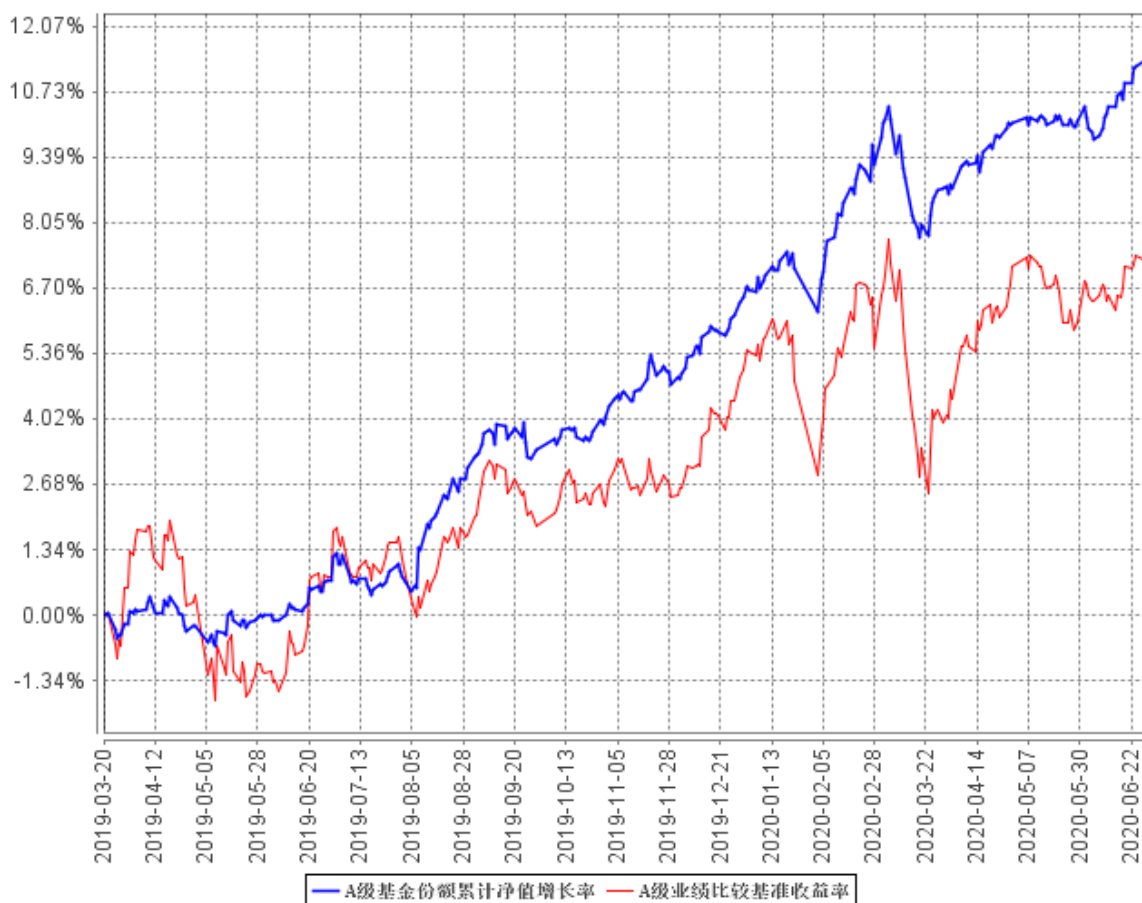
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.40%    | 0.15%       | 1.64%      | 0.27%         | -0.24% | -0.12% |
| 过去三个月      | 2.64%    | 0.14%       | 3.50%      | 0.28%         | -0.86% | -0.14% |
| 过去六个月      | 4.82%    | 0.23%       | 2.57%      | 0.43%         | 2.25%  | -0.20% |
| 过去一年       | 10.86%   | 0.20%       | 6.87%      | 0.35%         | 3.99%  | -0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.66%   | 0.19%       | 7.73%      | 0.37%         | 3.93%  | -0.18% |

宝盈祥瑞定期开放混合 C

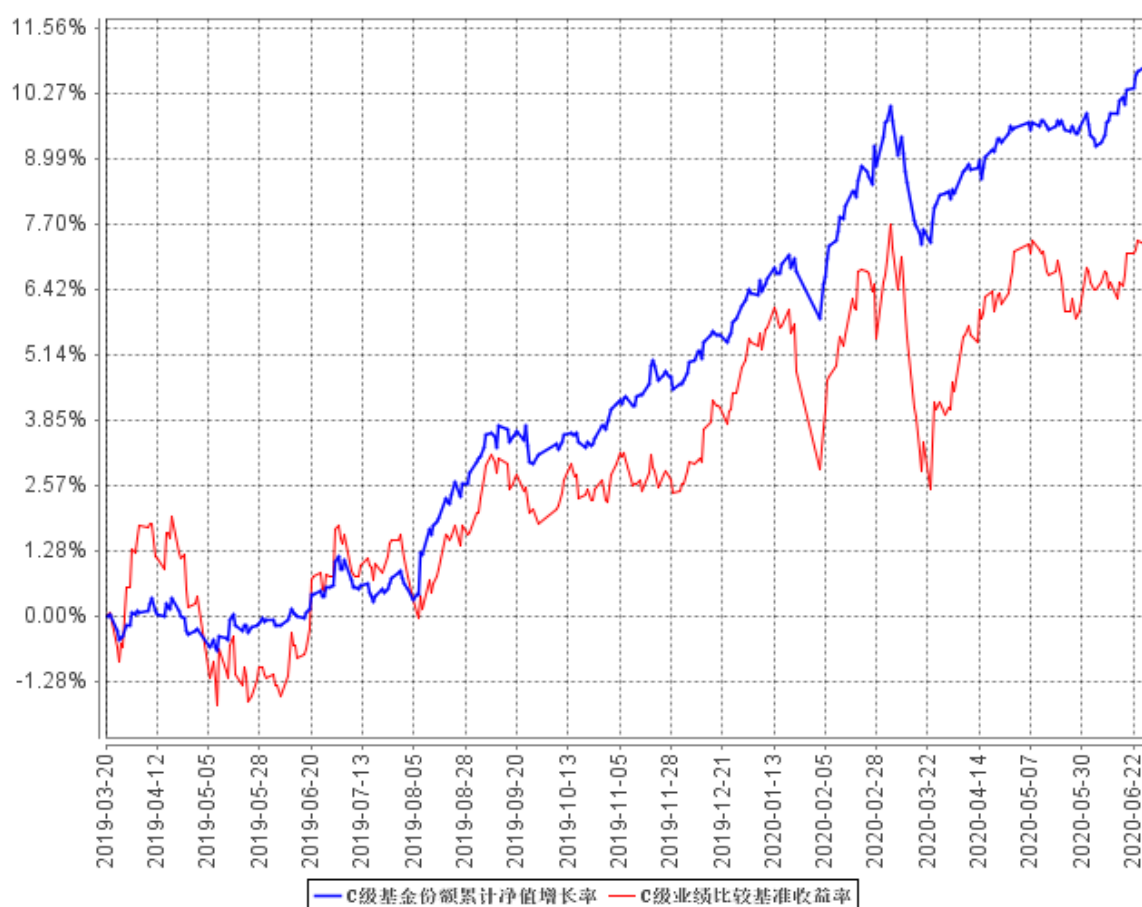
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.36%    | 0.15%       | 1.64%      | 0.27%         | -0.28% | -0.12% |
| 过去三个月      | 2.53%    | 0.14%       | 3.50%      | 0.28%         | -0.97% | -0.14% |
| 过去六个月      | 4.60%    | 0.23%       | 2.57%      | 0.43%         | 2.03%  | -0.20% |
| 过去一年       | 10.43%   | 0.20%       | 6.87%      | 0.35%         | 3.56%  | -0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.09%   | 0.19%       | 7.73%      | 0.37%         | 3.36%  | -0.18% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝

盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈盈顺纯债债券、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈辉纯债三十九只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                                                                                                                       | 任本基金的基金经理<br>（助理）期限 |                 | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                |
|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                          | 任职日期                | 离任日期            |            |                                                                                                                                                                   |
| 邓栋  | 本基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理；固定收益部总经理 | 2019 年 3 月 30 日     | -               | 10 年       | 邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008 年 3 月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自 2010 年 1 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
| 李宇昂 | 本基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金的基金经理                                                                 | 2020 年 5 月 23 日     | -               | 5 年        | 李宇昂先生，清华大学工学硕士。2015 年 7 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司固定收益部任研究员，从事宏观和信用债研究，2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任固定收益研究员、投资经理、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。                              |
| 高宇  | 本基金、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、宝盈增强收益债券型证券投资                                                                            | 2019 年 3 月 20 日     | 2020 年 5 月 23 日 | 12 年       | 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                                                                                   |

|  |                                                                  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                   |
|--|------------------------------------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈顺纯债债券型证券投资基金基金经理；固定收益部副总经理 |  |  |  | 月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师；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、基金经理等职位；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固定收益部，历任宝盈货币市场证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
|--|------------------------------------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、高宇为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2、邓栋、李宇昂非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2020 年 6 月 30 日。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害

基金持有人利益的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，权益市场受疫情、美流动性危机等事件影响出现多次波动，但核心股票仍创出历史新高，债市则走出过山车行情，4 月下旬起开始快速回调。报告期内，本基金严格遵守基金合同约定，主要以中短期限信用债作为底仓配置，将权益打新作为组合收益增厚的主要来源，辅以可转债投资，并灵活参与权益资产投资，报告期内，中短债和打新的收益一定程度降低了组合净值的波动。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥瑞定期开放混合 A 基金份额净值为 1.1166 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.82%；截至本报告期末宝盈祥瑞定期开放混合 C 基金份额净值为 1.1109 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.60%；同期业绩比较基准收益率为 2.57%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年受疫情影响宏观经济一度面临较大压力。一季度经济受疫情和经济休克疗法影响触底，从 4 月起经济开始复苏，地产投资保持较高的景气度，制造业、消费等均逐步改善。上半年 CPI、PPI 均保持相对平稳水平。货币政策保持灵活偏松，央行公开市场降息、降低存款准备金率和降准等多项政策并举，资金利率维持平稳偏低水平，4 月后资金利率一度降至历史最低水平附近。从市场表现看，上半年久期贡献最高，金融债指数强于中票，短融指数收益最低。股票市场结构性行情，盈利能力稳定的白酒、电子、养殖后周期、医药等行业仍有不错表现。

展望 2020 年下半年，我们认为主线是疫情后的经济复苏，权益的机会大于债券。目前国内经济复苏的方向已经基本确认，但幅度和持续时间有待继续观察，全球也逐渐步入复苏的过程中。国内货币政策从 4 月末开始已经明确转向，下半年基调可能是货币政策正常化。通胀压力不大，但 PPI 中枢预计有所抬升。下半年美国大选和中美的关系是重要的不确定因素，可能影响权益和债市的节奏。

目前来看，债券市场存在超跌反弹的机会，但短期内空间可能不大，中期需要等经济的下行信号。信用债绝对收益不错，中等资质高静态中短债在 2020 年下半年仍能取得不错的稳定收益。2020 年信用事件依然高发，且机构情绪较为脆弱，低等级信用风险仍需保持警惕。转债在当前时点的估值并不便宜，机会主要来自正股的带动和个体的深度挖掘。股票风险溢价不高，性价比高

于纯债，可能仍是结构性机会为主。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管（协管）领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 6,048,655.45                   | 3,325,372.15                     |
| 结算备付金           |            | 1,351,691.93                   | 1,175,601.31                     |
| 存出保证金           |            | 86,163.71                      | 71,526.43                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,499,772,549.58               | 1,205,844,338.77                 |
| 其中：股票投资         |            | 160,463,084.78                 | 139,414,838.77                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 1,289,475,464.80               | 1,066,429,500.00                 |
| 资产支持证券投资        |            | 49,834,000.00                  | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 397,569.45                     | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 20,665,564.64                  | 16,261,672.65                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,528,322,194.76               | 1,226,678,511.31                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 237,999,318.00                 | 325,660,953.00                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,045,620.10                   | 757,238.88                       |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付托管费         |          | 209,124.00       | 151,447.76       |
| 应付销售服务费       |          | 89,905.19        | 66,900.13        |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 158,784.50       | 173,119.61       |
| 应交税费          |          | 115,660.10       | 115,124.89       |
| 应付利息          |          | 181,206.39       | 170,257.60       |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 104,426.14       | 50,000.00        |
| 负债合计          |          | 239,904,044.42   | 327,145,041.87   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,155,128,716.09 | 844,958,765.57   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 133,289,434.25   | 54,574,703.87    |
| 所有者权益合计       |          | 1,288,418,150.34 | 899,533,469.44   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,528,322,194.76 | 1,226,678,511.31 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.1166 元，基金份额总额 905,858,798.46 份；宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.1109 元，基金份额总额 249,269,917.63 份。宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金基金份额总额合计为 1,155,128,716.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目              | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日(基金<br>合同生效日)至 2019 年 6<br>月 30 日 |
|------------------|------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      |            | 57,193,312.97                            | 6,334,051.35                                                |
| 1.利息收入           |            | 21,595,260.38                            | 6,092,319.47                                                |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11   | 126,975.78                               | 250,946.84                                                  |
| 债券利息收入           |            | 21,108,259.85                            | 5,416,647.05                                                |
| 资产支持证券利息收入       |            | 190,833.79                               | -                                                           |
| 买入返售金融资产收入       |            | 169,190.96                               | 424,725.58                                                  |
| 证券出借利息收入         |            | -                                        | -                                                           |
| 其他利息收入           |            | -                                        | -                                                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |            | 33,607,239.34                            | -3,449,912.08                                               |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12   | 28,199,393.19                            | -737,197.80                                                 |
| 基金投资收益           |            | -                                        | -                                                           |
| 债券投资收益           | 6.4.7.13   | 3,360,960.24                             | -3,122,304.28                                               |
| 资产支持证券投资收益       | 6.4.7.13.1 | -                                        | -                                                           |
| 贵金属投资收益          | 6.4.7.14   | -                                        | -                                                           |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -             | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 2,046,885.91  | 409,590.00   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.17   | 1,984,835.52  | 3,691,643.96 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -             | -            |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18   | 5,977.73      | -            |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 9,578,185.14  | 3,043,883.59 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 5,110,495.94  | 1,328,887.89 |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,022,099.07  | 265,777.62   |
| 3. 销售服务费                   |            | 446,994.10    | 113,079.50   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 535,186.43    | 240,568.19   |
| 5. 利息支出                    |            | 2,250,900.21  | 1,047,004.22 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,250,900.21  | 1,047,004.22 |
| 6. 税金及附加                   |            | 72,124.75     | 18,964.38    |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 140,384.64    | 29,601.79    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 47,615,127.83 | 3,290,167.76 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 47,615,127.83 | 3,290,167.76 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                    | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                  |
|---------------------------------------|---------------------------------------|----------------|------------------|
|                                       | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                       | 844,958,765.57                        | 54,574,703.87  | 899,533,469.44   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）              | -                                     | 47,615,127.83  | 47,615,127.83    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列） | 310,169,950.52                        | 31,099,602.55  | 341,269,553.07   |
| 其中：1.基金申购款                            | 1,029,493,264.83                      | 97,768,853.45  | 1,127,262,118.28 |
| 2. 基金赎回款                              | -719,323,314.31                       | -66,669,250.90 | -785,992,565.21  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值          | -                                     | -              | -                |

|                                        |                                                      |                |                  |
|----------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| 减少以“-”号填列)                             |                                                      |                |                  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 1,155,128,716.09                                     | 133,289,434.25 | 1,288,418,150.34 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |                |                  |
|                                        | 实收基金                                                 | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 475,557,489.60                                       | -              | 475,557,489.60   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                                    | 3,290,167.76   | 3,290,167.76     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -                                                    | -              | -                |
| 其中: 1.基金申购款                            | -                                                    | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                | -                                                    | -              | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                                    | -              | -                |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 475,557,489.60                                       | 3,290,167.76   | 478,847,657.36   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 杨凯       | 张献锦       | 何瑜      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宝盈祥颐定期开放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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第1381号《关于准予宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集475,345,205.91元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道验字(2019)第0169号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2019年3月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为475,557,489.60份基金份额,其中认购资金利息折合212,283.69份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、次级债、央行票据、地方

政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债纯债）、可交换债券）、股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、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。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 45%；持有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。在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。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。

本基金的基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 6,048,655.45           |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 6,048,655.45           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                  |                  |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 125,072,358.19         | 160,463,084.78   | 35,390,726.59    |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                      | —                | —                |
| 债券            | 交易所市场                  | 259,047,154.69   | 255,955,764.80   |
|               | 银行间市场                  | 1,043,063,351.21 | 1,033,519,700.00 |
|               | 合计                     | 1,302,110,505.90 | 1,289,475,464.80 |
| 资产支持证券        | 50,086,443.84          | 49,834,000.00    | -252,443.84      |
| 基金            | —                      | —                | —                |
| 其他            | —                      | —                | —                |
| 合计            | 1,477,269,307.93       | 1,499,772,549.58 | 22,503,241.65    |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 7,062.93               |
| 应收定期存款利息   | —                      |
| 应收其他存款利息   | —                      |
| 应收结算备付金利息  | 608.30                 |
| 应收债券利息     | 20,115,520.36          |
| 应收资产支持证券利息 | 542,334.25             |
| 应收买入返售证券利息 | —                      |
| 应收申购款利息    | —                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —                      |
| 应收出借证券利息   | —                      |
| 其他         | 38.80                  |
| 合计         | 20,665,564.64          |

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 128,911.19             |
| 银行间市场应付交易费用 | 29,873.31              |
| 合计          | 158,784.50             |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------|
| 应付赎回费     | —                      |
| 应付证券出借违约金 | —                      |
| 预提费用      | 104,426.14             |
| 合计        | 104,426.14             |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 宝盈祥瑞定期开放混合 A  |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 657,908,366.02                        | 657,908,366.02  |
| 本期申购          | 798,740,393.69                        | 798,740,393.69  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -550,789,961.25                       | -550,789,961.25 |
| 本期末           | 905,858,798.46                        | 905,858,798.46  |

金额单位：人民币元

| 宝盈祥瑞定期开放混合 C  |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 187,050,399.55                        | 187,050,399.55  |
| 本期申购          | 230,752,871.14                        | 230,752,871.14  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -168,533,353.06                       | -168,533,353.06 |
| 本期末           | 249,269,917.63                        | 249,269,917.63  |

注：根据《宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该日）6 个月的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）至 6 个月后的对应日的期间，本基金封闭期内不办理申购、赎回及转换等业务，也不上市交易。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 宝盈祥瑞定期开放混合 A   |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 29,502,066.92  | 13,471,384.25 | 42,973,451.17  |
| 本期利润           | 35,999,454.37  | 1,485,549.55  | 37,485,003.92  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 20,487,031.34  | 4,696,509.11  | 25,183,540.45  |
| 其中：基金申购款       | 65,278,308.73  | 11,544,429.91 | 76,822,738.64  |
| 基金赎回款          | -44,791,277.39 | -6,847,920.80 | -51,639,198.19 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 85,988,552.63  | 19,653,442.91 | 105,641,995.54 |

单位：人民币元

| 宝盈祥瑞定期开放混合 C |       |       |         |
|--------------|-------|-------|---------|
| 项目           | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 7,777,849.80   | 3,823,402.90  | 11,601,252.70  |
| 本期利润           | 9,630,837.94   | 499,285.97    | 10,130,123.91  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,842,621.83   | 1,073,440.27  | 5,916,062.10   |
| 其中：基金申购款       | 17,762,634.04  | 3,183,480.77  | 20,946,114.81  |
| 基金赎回款          | -12,920,012.21 | -2,110,040.50 | -15,030,052.71 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 22,251,309.57  | 5,396,129.14  | 27,647,438.71  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 107,164.36                            |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 19,407.10                             |
| 其他        | 404.32                                |
| 合计        | 126,975.78                            |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 162,795,902.52                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 134,596,509.33                        |
| 买卖股票差价收入   | 28,199,393.19                         |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,224,708,722.98           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,203,981,475.90           |
| 减：应收利息总额                | 17,366,286.84              |
| 买卖债券差价收入                | 3,360,960.24               |

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,046,885.91                          |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                     |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                     |
| 合计            | 2,046,885.91                          |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 1,984,835.52                          |
| ——股票投资                     | 17,204,945.83                         |
| ——债券投资                     | -14,967,666.47                        |
| ——资产支持证券投资                 | -252,443.84                           |
| ——贵金属投资                    | -                                     |
| ——其他                       | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | -                                     |
| ——权证投资                     | -                                     |
| 3. 其他                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                                     |
| 合计                         | 1,984,835.52                          |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 5,686.06                              |
| 其他      | 291.67                                |
| 合计      | 5,977.73                              |

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 515,283.93                            |
| 银行间市场交易费用 | 19,902.50                             |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 535,186.43                            |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用     | 44,753.80                             |
| 信息披露费    | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金  | -                                     |
| 其他       | 600.00                                |
| 银行汇划费用   | 17,358.50                             |
| 银行间帐户维护费 | 9,000.00                              |
| 上清所帐户维护费 | 9,000.00                              |
| 合计       | 140,384.64                            |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                    | 与本基金的关系            |
|--------------------------|--------------------|
| 宝盈基金管理有限公司(以下简称“宝盈基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机 |

|                        |              |
|------------------------|--------------|
|                        | 构            |
| 中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

- 1、本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行交易。
- 2、本基金合同生效日为 2019 年 3 月 20 日，上年度可比期间为 2019 年 3 月 20 日起至 2019 年 6 月 30 日。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日(基金合<br>同生效日)至 2019 年 6 月<br>30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,110,495.94                             | 1,328,887.89                                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,609,181.76                             | 992,555.57                                                  |

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日(基金合<br>同生效日)至 2019 年 6 月<br>30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,022,099.07                             | 265,777.62                                                  |

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|--------------------|---------------------------------------|
|--------------------|---------------------------------------|

|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |              |            |
|----------------|------------------------------------------------------|--------------|------------|
|                | 宝盈祥瑞定期开放混合 A                                         | 宝盈祥瑞定期开放混合 C | 合计         |
| 宝盈基金公司         | -                                                    | 291.60       | 291.60     |
| 中国银行           | -                                                    | 436,210.55   | 436,210.55 |
| 合计             | -                                                    | 436,502.15   | 436,502.15 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |              |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |              |            |
|                | 宝盈祥瑞定期开放混合 A                                         | 宝盈祥瑞定期开放混合 C | 合计         |
|                |                                                      |              |            |
| 宝盈基金公司         | -                                                    | 111.16       | 111.16     |
| 中国银行           | -                                                    | 111,750.51   | 111,750.51 |
| 合计             | -                                                    | 111,861.67   | 111,861.67 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日                |               |      |       |      |       |      |
|------------------------------------------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                                       | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                                      | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国银行                                                 | 40,004,372.60 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的各关联方名称                                       | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                                      | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国银行                                                 | -             | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 20 日 (基金合同生效日) 至<br>2019 年 6 月 30 日 |           |
|-------|---------------------------------------|------------|-----------------------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入     | 期末余额                                                      | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 6,048,655.45                          | 107,164.36 | 2,030,212.90                                              | 70,278.19 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                |        |       |        |          |            |            |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 688377               | 迪威尔  | 2020 年 6 月 29 日 | 2020 年 7 月 8 日 | 新股未上市  | 16.42 | 16.42  | 7,894    | 129,619.48 | 129,619.48 |    |

|        |      |                 |                  |          |       |        |       |            |            |   |
|--------|------|-----------------|------------------|----------|-------|--------|-------|------------|------------|---|
| 688027 | 国盾量子 | 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 7 月 9 日   | 新股未上市    | 36.18 | 36.18  | 2,830 | 102,389.40 | 102,389.40 | - |
| 688528 | 秦川物联 | 2020 年 6 月 19 日 | 2020 年 7 月 1 日   | 新股未上市    | 11.33 | 11.33  | 8,337 | 94,458.21  | 94,458.21  | - |
| 688600 | 皖仪科技 | 2020 年 6 月 23 日 | 2021 年 1 月 3 日   | 新股未上市    | 15.50 | 15.50  | 5,468 | 84,754.00  | 84,754.00  | - |
| 300847 | 中船汉光 | 2020 年 6 月 29 日 | 2020 年 7 月 9 日   | 新股未上市    | 6.94  | 6.94   | 1,420 | 9,854.80   | 9,854.80   | - |
| 300845 | 捷安高科 | 2020 年 6 月 24 日 | 2020 年 7 月 3 日   | 新股未上市    | 17.63 | 17.63  | 470   | 8,286.10   | 8,286.10   | - |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020 年 6 月 23 日 | 2020 年 7 月 2 日   | 新股未上市    | 10.01 | 10.01  | 751   | 7,517.51   | 7,517.51   | - |
| 300840 | 酷特智能 | 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 7 月 8 日   | 新股未上市    | 5.94  | 5.94   | 1,185 | 7,038.90   | 7,038.90   | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020 年 6 月 22 日 | 2020 年 7 月 1 日   | 新股未上市    | 3.37  | 3.37   | 1,131 | 3,811.47   | 3,811.47   | - |
| 688298 | 东方生物 | 2020 年 1 月 20 日 | 2020 年 8 月 5 日   | 科创板新股锁定期 | 21.25 | 144.17 | 5,286 | 112,327.50 | 762,082.62 | - |
| 688598 | 金博股份 | 2020 年 5 月 8 日  | 2020 年 11 月 18 日 | 科创板新股锁定期 | 47.20 | 77.94  | 7,645 | 360,844.00 | 595,851.30 | - |
| 688228 | 开普云  | 2020 年 3 月 19 日 | 2020 年 9 月 28 日  | 科创板新股锁定期 | 59.26 | 73.20  | 2,718 | 161,068.68 | 198,957.60 | - |

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的余额为 187,999,318.00 元，正回购交易中作为抵押的债券如下：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值<br>单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|----------------|------------|-----------|----------------|
| 011902610 | 19 永煤 SCP016  | 2020 年 7 月 6 日 | 100.39     | 200,000   | 20,078,000.00  |
| 102000807 | 20 南电 MTN007  | 2020 年 7 月 3 日 | 97.06      | 530,000   | 51,441,800.00  |
| 101901385 | 19 中石油 MTN006 | 2020 年 7 月 3 日 | 101.15     | 300,000   | 30,345,000.00  |
| 101801229 | 18 津保投 MTN011 | 2020 年 7 月 6 日 | 102.31     | 200,000   | 20,462,000.00  |
| 101900099 | 19 津保投 MTN001 | 2020 年 7 月 6 日 | 101.60     | 80,000    | 8,128,000.00   |
| 102000469 | 20 中石油 MTN002 | 2020 年 7 月 3 日 | 98.25      | 300,000   | 29,475,000.00  |
| 011902387 | 19 永煤 SCP014  | 2020 年 7 月 6 日 | 100.51     | 200,000   | 20,102,000.00  |
| 012000009 | 20 永煤 SCP001  | 2020 年 7 月 6 日 | 100.22     | 200,000   | 20,044,000.00  |
| 合计        |               |                |            | 2,010,000 | 200,075,800.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,000,000.00 元，截至 2020 年 7 月 14 日到期，该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等收益/风险特征的基金。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

依法发行上市的债券、股票、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金债券投资占基金资产净值比例为 103.95%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 79,873,500.00          | 60,232,000.00            |

|        |                |                |
|--------|----------------|----------------|
| A-1 以下 | -              | -              |
| 未评级    | 280,756,200.00 | 340,790,000.00 |
| 合计     | 360,629,700.00 | 401,022,000.00 |

注：未评级部分为短期融资券、国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | 148,235,000.00           |
| 合计     | -                      | 148,235,000.00           |

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 634,515,764.80         | 207,622,500.00           |
| AAA 以下 | 217,364,000.00         | 309,550,000.00           |
| 未评级    | 126,800,000.00         | -                        |
| 合计     | 978,679,764.80         | 517,172,500.00           |

注：未评级部分为短期融资券、国债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 237999318 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的

合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上          | 不计息            | 合计               |
|------------------------|----------------|-------|----------------|----------------|------------------|
| 资产                     |                |       |                |                |                  |
| 银行存款                   | 6,048,655.45   | -     | -              | -              | 6,048,655.45     |
| 结算备付金                  | 1,351,691.93   | -     | -              | -              | 1,351,691.93     |
| 存出保证金                  | 86,163.71      | -     | -              | -              | 86,163.71        |
| 交易性金融资产                | 360,629,700.00 | -     | 978,679,764.80 | 160,463,084.78 | 1,499,772,549.58 |
| 应收证券清算款                | -              | -     | -              | 397,569.45     | 397,569.45       |
| 应收利息                   | -              | -     | -              | 20,665,564.64  | 20,665,564.64    |
| 资产总计                   | 368,116,211.09 | -     | 978,679,764.80 | 181,526,218.87 | 1,528,322,194.76 |
| 负债                     |                |       |                |                |                  |
| 卖出回购金融资产款              | 237,999,318.00 | -     | -              | -              | 237,999,318.00   |
| 应付管理人报酬                | -              | -     | -              | 1,045,620.10   | 1,045,620.10     |
| 应付托管费                  | -              | -     | -              | 209,124.00     | 209,124.00       |
| 应付销售服务费                | -              | -     | -              | 89,905.19      | 89,905.19        |
| 应付交易费用                 | -              | -     | -              | 158,784.50     | 158,784.50       |
| 应付利息                   | -              | -     | -              | 181,206.39     | 181,206.39       |
| 应交税费                   | -              | -     | -              | 115,660.10     | 115,660.10       |
| 其他负债                   | -              | -     | -              | 104,426.14     | 104,426.14       |
| 负债总计                   | 237,999,318.00 | -     | -              | 1,904,726.42   | 239,904,044.42   |
| 利率敏感度缺口                | 130,116,893.09 | -     | 978,679,764.80 | 179,621,492.45 | 1,288,418,150.34 |
| 上年度末                   | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上          | 不计息            | 合计               |

| 2019 年 12 月 31 日 |                |                |            |                |                  |
|------------------|----------------|----------------|------------|----------------|------------------|
| 资产               |                |                |            |                |                  |
| 银行存款             | 3,325,372.15   | -              | -          | -              | 3,325,372.15     |
| 结算备付金            | 1,175,601.31   | -              | -          | -              | 1,175,601.31     |
| 存出保证金            | 71,526.43      | -              | -          | -              | 71,526.43        |
| 交易性金融资产          | 599,562,000.00 | 466,160,500.00 | 707,000.00 | 139,414,838.77 | 1,205,844,338.77 |
| 应收利息             | -              | -              | -          | 16,261,672.65  | 16,261,672.65    |
| 其他资产             | -              | -              | -          | -              | -                |
| 资产总计             | 604,134,499.89 | 466,160,500.00 | 707,000.00 | 155,676,511.42 | 1,226,678,511.31 |
| 负债               |                |                |            |                |                  |
| 卖出回购金融资产款        | 325,660,953.00 | -              | -          | -              | 325,660,953.00   |
| 应付管理人报酬          | -              | -              | -          | 757,238.88     | 757,238.88       |
| 应付托管费            | -              | -              | -          | 151,447.76     | 151,447.76       |
| 应付销售服务费          | -              | -              | -          | 66,900.13      | 66,900.13        |
| 应付交易费用           | -              | -              | -          | 173,119.61     | 173,119.61       |
| 应付利息             | -              | -              | -          | 170,257.60     | 170,257.60       |
| 应交税费             | -              | -              | -          | 115,124.89     | 115,124.89       |
| 其他负债             | -              | -              | -          | 50,000.00      | 50,000.00        |
| 负债总计             | 325,660,953.00 | -              | -          | 1,484,088.87   | 327,145,041.87   |
| 利率敏感度缺口          | 278,473,546.89 | 466,160,500.00 | 707,000.00 | 154,192,422.55 | 899,533,469.44   |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                        |
|----|--------------------|---------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2020 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 10,057,400.34                   | 3,754,833.02           |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -9,780,038.98                   | -3,719,380.07          |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济形势与市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极大类资产配置策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-45%；开放期内，持有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；在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 160,463,084.78         | 12.45         | 139,414,838.77           | 15.50         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                      | —             | —                        | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                      | —             | —                        | —             |
| 其他            | —                      | —             | —                        | —             |
| 合计            | 160,463,084.78         | 12.45         | 139,414,838.77           | 15.50         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类公允价值占基金净资产比例为 14.45%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 160,463,084.78   | 10.50         |
|    | 其中：股票             | 160,463,084.78   | 10.50         |
| 2  | 基金投资              | —                | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,339,309,464.80 | 87.63         |
|    | 其中：债券             | 1,289,475,464.80 | 84.37         |
|    | 资产支持证券            | 49,834,000.00    | 3.26          |
| 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      | 7,400,347.38     | 0.48          |
| 8  | 其他各项资产            | 21,149,297.80    | 1.38          |
| 9  | 合计                | 1,528,322,194.76 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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              | 101,459,265.29 | 7.87          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32      | 0.00          |
| 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  | 34,385,521.17  | 2.67          |
| J  | 金融业              | 11,809,560.00  | 0.92          |
| K  | 房地产业             | 12,795,972.00  | 0.99          |
| 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        | 160,463,084.78 | 12.45 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 000661 | 长春高新 | 56,000  | 24,376,800.00 | 1.89         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 14,500  | 21,211,760.00 | 1.65         |
| 3  | 600570 | 恒生电子 | 183,300 | 19,741,410.00 | 1.53         |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 246,369 | 14,730,402.51 | 1.14         |
| 5  | 002624 | 完美世界 | 250,400 | 14,433,056.00 | 1.12         |
| 6  | 300760 | 迈瑞医疗 | 45,600  | 13,939,920.00 | 1.08         |
| 7  | 300463 | 迈克生物 | 226,700 | 13,200,741.00 | 1.02         |
| 8  | 001914 | 招商积余 | 416,400 | 12,795,972.00 | 0.99         |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 386,800 | 12,041,084.00 | 0.93         |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 165,400 | 11,809,560.00 | 0.92         |
| 11 | 688298 | 东方生物 | 5,286   | 762,082.62    | 0.06         |
| 12 | 688598 | 金博股份 | 7,645   | 595,851.30    | 0.05         |
| 13 | 688228 | 开普云  | 2,718   | 198,957.60    | 0.02         |
| 14 | 688377 | 迪威尔  | 7,894   | 129,619.48    | 0.01         |
| 15 | 603087 | 甘李药业 | 1,076   | 107,922.80    | 0.01         |
| 16 | 688027 | 国盾量子 | 2,830   | 102,389.40    | 0.01         |
| 17 | 688528 | 秦川物联 | 8,337   | 94,458.21     | 0.01         |
| 18 | 688600 | 皖仪科技 | 5,468   | 84,754.00     | 0.01         |
| 19 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954   | 26,789.34     | 0.00         |
| 20 | 300842 | 帝科股份 | 455     | 18,527.60     | 0.00         |
| 21 | 600956 | 新天绿能 | 2,533   | 12,766.32     | 0.00         |
| 22 | 300839 | 博汇股份 | 502     | 11,751.82     | 0.00         |
| 23 | 300847 | 中船汉光 | 1,420   | 9,854.80      | 0.00         |
| 24 | 300845 | 捷安高科 | 470     | 8,286.10      | 0.00         |
| 25 | 300843 | 胜蓝股份 | 751     | 7,517.51      | 0.00         |
| 26 | 300840 | 酷特智能 | 1,185   | 7,038.90      | 0.00         |
| 27 | 300846 | 首都在线 | 1,131   | 3,811.47      | 0.00         |

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 001914 | 招商积余 | 12,694,610.00 | 1.41           |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 12,686,479.00 | 1.41           |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 12,684,825.76 | 1.41           |
| 4  | 300760 | 迈瑞医疗 | 11,935,345.08 | 1.33           |
| 5  | 002624 | 完美世界 | 11,554,535.00 | 1.28           |
| 6  | 300463 | 迈克生物 | 11,319,025.00 | 1.26           |
| 7  | 601688 | 华泰证券 | 9,278,115.00  | 1.03           |
| 8  | 300601 | 康泰生物 | 9,249,022.00  | 1.03           |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 9,175,379.00  | 1.02           |
| 10 | 603993 | 洛阳钼业 | 9,078,898.00  | 1.01           |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 7,529,972.10  | 0.84           |
| 12 | 688111 | 金山办公 | 4,985,080.91  | 0.55           |
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 2,538,098.00  | 0.28           |
| 14 | 688169 | 石头科技 | 1,459,167.84  | 0.16           |
| 15 | 688266 | 泽璟制药 | 1,439,762.72  | 0.16           |
| 16 | 688396 | 华润微  | 1,048,460.80  | 0.12           |
| 17 | 688177 | 百奥泰  | 987,976.08    | 0.11           |
| 18 | 688599 | 天合光能 | 836,065.44    | 0.09           |
| 19 | 688158 | 优刻得  | 687,861.00    | 0.08           |
| 20 | 688318 | 财富趋势 | 467,877.96    | 0.05           |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 002624 | 完美世界 | 15,181,925.00 | 1.69           |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 13,574,905.86 | 1.51           |
| 3  | 600585 | 海螺水泥 | 12,600,060.56 | 1.40           |
| 4  | 001914 | 招商积余 | 9,098,259.00  | 1.01           |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 8,884,307.00  | 0.99           |
| 6  | 688111 | 金山办公 | 8,770,136.60  | 0.97           |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 8,434,870.00  | 0.94           |
| 8  | 601688 | 华泰证券 | 8,290,597.00  | 0.92           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9  | 601088 | 中国神华 | 8,280,988.29 | 0.92 |
| 10 | 300601 | 康泰生物 | 8,256,719.00 | 0.92 |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 8,163,362.00 | 0.91 |
| 12 | 603993 | 洛阳钼业 | 7,969,444.00 | 0.89 |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 6,763,613.00 | 0.75 |
| 14 | 688396 | 华润微  | 3,755,342.28 | 0.42 |
| 15 | 688266 | 泽璟制药 | 2,800,501.09 | 0.31 |
| 16 | 601318 | 中国平安 | 2,733,406.00 | 0.30 |
| 17 | 688169 | 石头科技 | 2,631,944.00 | 0.29 |
| 18 | 688177 | 百奥泰  | 2,150,057.92 | 0.24 |
| 19 | 688599 | 天合光能 | 1,824,330.46 | 0.20 |
| 20 | 688158 | 优刻得  | 1,366,224.00 | 0.15 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 138,439,809.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 162,795,902.52 |

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 126,800,000.00   | 9.84         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 29,601,000.00    | 2.30         |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 240,747,764.80   | 18.69        |
| 5  | 企业短期融资券   | 371,066,700.00   | 28.80        |
| 6  | 中期票据      | 521,260,000.00   | 40.46        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,289,475,464.80 | 100.08       |

**7.6 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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 200004    | 20 附息国债 04     | 700,000 | 67,886,000.00 | 5.27         |
| 2  | 102000807 | 20 南电 MTN007   | 600,000 | 58,236,000.00 | 4.52         |
| 3  | 101551055 | 15 大连万达 MTN001 | 500,000 | 50,425,000.00 | 3.91         |
| 4  | 012001464 | 20 东航股 SCP017  | 500,000 | 49,865,000.00 | 3.87         |
| 5  | 101901047 | 19 北汽新能 MTN002 | 400,000 | 40,252,000.00 | 3.12         |

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 168504 | 碧胜 01 优 | 300,000 | 29,886,000.00 | 2.32         |
| 2  | 131189 | 恒浩云 B   | 200,000 | 19,948,000.00 | 1.55         |

**7.8 报告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。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

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

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 86,163.71     |
| 2  | 应收证券清算款 | 397,569.45    |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 20,665,564.64 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 21,149,297.80 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |        |       |        |
|------|----------|-----------|-------|--------|-------|--------|
|      |          |           | 机构投资者 |        | 个人投资者 |        |
|      |          |           | 持有份额  | 占总份额比例 | 持有份额  | 占总份额比例 |

|              |       |            |   |   |                  |         |
|--------------|-------|------------|---|---|------------------|---------|
| 宝盈祥瑞定期开放混合 A | 3,255 | 278,297.63 | - | - | 905,858,798.46   | 100.00% |
| 宝盈祥瑞定期开放混合 C | 1,284 | 194,135.45 | - | - | 249,269,917.63   | 100.00% |
| 合计           | 4,539 | 254,489.69 | - | - | 1,155,128,716.09 | 100.00% |

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别         | 持有份额总数<br>(份) | 占基金总份额<br>比例 |
|------------------|--------------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 宝盈祥瑞定期开放混合 A | 61,786.74     | 0.0068%      |
|                  | 宝盈祥瑞定期开放混合 C | 366,411.04    | 0.1470%      |
|                  | 合计           | 428,197.78    | 0.0371%      |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别         | 持有基金份额总量的数量区间<br>(万份) |
|--------------------------------|--------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 宝盈祥瑞定期开放混合 A | 0                     |
|                                | 宝盈祥瑞定期开放混合 C | 0                     |
|                                | 合计           | 0                     |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 宝盈祥瑞定期开放混合 A | 0                     |
|                                | 宝盈祥瑞定期开放混合 C | 0                     |
|                                | 合计           | 0                     |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 宝盈祥瑞定期开放混合 A   | 宝盈祥瑞定期开放混合 C   |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 3 月 20 日）基金份额总额 | 374,346,500.23 | 101,210,989.37 |
| 本报告期初基金份额总额                    | 657,908,366.02 | 187,050,399.55 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 798,740,393.69 | 230,752,871.14 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 550,789,961.25 | 168,533,353.06 |

|             |                |                |
|-------------|----------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 905,858,798.46 | 249,269,917.63 |
|-------------|----------------|----------------|

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|----------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|          |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信证券     | 1      | 149,828,427.68 | 52.11%       | 136,536.42 | 52.11%     | -  |
| 渤海证券     | 1      | 137,676,859.69 | 47.89%       | 125,464.96 | 47.89%     | -  |
| 海通证券     | 3      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券（华南） | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 西南证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东兴证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券     | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 长江证券     | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- （3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务。
- （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

应支付给券商的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单独指股票交易佣金。

## 2、交易单元变更情况

- （1）本基金本报告期新增租用长江证券深圳交易单元一个；
- （2）本基金本报告期无退租交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | 10,942,203.16 | 5.56%        | 2,158,000,000.00 | 84.99%         | -    | -            |
| 渤海证券 | 74,234,718.33 | 37.72%       | 381,194,000.00   | 15.01%         | -    | -            |
| 海通证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |

|              |                |        |   |   |   |   |
|--------------|----------------|--------|---|---|---|---|
| 中信证券<br>(华南) | -              | -      | - | - | - | - |
| 西南证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 国泰君安证<br>券   | -              | -      | - | - | - | - |
| 招商证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 东兴证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 华泰证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 中泰证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 长江证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 兴业证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 平安证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 天风证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 华创证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 东北证券         | -              | -      | - | - | - | - |
| 长城证券         | 111,625,744.66 | 56.72% | - | - | - | - |
| 浙商证券         | -              | -      | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                              | 法定披露方式                                            | 法定披露日期          |
|----|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|
| 1  | 宝盈基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 24 日 |
| 2  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告                 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 17 日 |
| 3  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告           | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 3 日  |
| 4  | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2020 年第 1 次)          | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                           | 2020 年 5 月 26 日 |
| 5  | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书 (2020 年第 1 次)            | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                           | 2020 年 5 月 26 日 |
| 6  | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金经理变更公告                         | 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2020 年 5 月 23 日 |

|    |                                                   |                                                   |                 |
|----|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|
| 7  | 宝盈基金管理有限公司关于增加国元证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 4 月 29 日 |
| 8  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券华南股份有限公司相关费率优惠活动的公告       | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 4 月 28 日 |
| 9  | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金暂停定期定额投资业务的公告                    | 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2020 年 4 月 23 日 |
| 10 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告                  | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                           | 2020 年 4 月 22 日 |
| 11 | 宝盈基金管理有限公司旗下 34 只基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告           | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报                          | 2020 年 4 月 22 日 |
| 12 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金第二个开放期开放定期定额投资业务的公告              | 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2020 年 4 月 17 日 |
| 13 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金 2019 年年度报告                      | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                           | 2020 年 4 月 11 日 |
| 14 | 宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年年度报告提示性公告               | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报                          | 2020 年 4 月 11 日 |
| 15 | 宝盈基金管理有限公司关于新增泛华普益基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 4 月 10 日 |
| 16 | 宝盈基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告            | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 31 日 |
| 17 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金第二个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告            | 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2020 年 3 月 31 日 |
| 18 | 宝盈基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告                | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 25 日 |
| 19 | 宝盈基金管理有限公司关于新增大连网金基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 24 日 |
| 20 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告                  | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                           | 2020 年 1 月 17 日 |

|    |                                         |                          |                 |
|----|-----------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| 21 | 宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2020 年 1 月 17 日 |
|----|-----------------------------------------|--------------------------|-----------------|

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上述备查文件文本分别存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

### 12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日