

# 宝盈聚福 39 个月定期开放债券型证券投资 基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称    | 宝盈聚福 39 个月定开债                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金主代码   | 009523                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金运作方式  | <p>契约型、定期开放式</p> <p>本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。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）39 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起至 39 个月后的对应日的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至 39 个月后的对应日的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期或非工作日，则顺延至下一工作日。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。</p> <p>每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（包括该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明，但在开放期内，基金管理人有权缩短或延长开放期时间并公告，但开放期最短不得低于五个工作日、最长不可超过二十个工作日。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。</p> <p>如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回等业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回等业务的办理期间并予以公告，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间。</p> |
| 基金合同生效日 | 2020 年 8 月 28 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 报告期末基金份额总额 | 5,780,073,770.01 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 投资目标       | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 投资策略       | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。</p> <p>本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>本基金以宏观研究、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、信用类的债券配置比例。本基金封闭期内采用的债券投资策略主要包括资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略。</p> <p>1）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）信用债投资策略</p> <p>本基金主要采用外部信用评级和内部信用评级相结合的</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>信用研究体系，研究债券发行主体企业的基本面，以确定债券的实际信用状况。基金管理人内部信用评级体系主要分为定量分析和定性分析，定量分析是根据行业公司财务特征设定阈值，进行财务打分。定性分析包括主体股权结构分析、公司历史分析、行业分析、公司经营分析、公司管理层分析、公司融资及外部支持分析、公司偿债分析等几个部分。其中，经营分析注重公司的获现能力、经营稳定性等，财务分析关注公司的资产质量、隐性债务、财务真实性等方面。</p> <p>本基金参与信用类债券投资的，其信用评级需在 AA（含）及以上，其中，本基金投资的企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、中期票据、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分等信用类债券的信用评级参照评级机构出具的债项信用评级，本基金投资的短期融资券、超短期融资券等短期信用类债券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级，如出现多家评级机构所出具信用评级不同的情况，基金管理人还需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定。</p> <p>（3）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将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>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的 3 年期定期存款利率（税后）+1.5%。</p> <p>本基金以每个封闭期为周期进行投资运作，每个封闭期为 39 个月，期间投资者无法进行基金份额申购与赎回。封闭期起始日公布的 3 年期定期存款利率（税后）+1.5%作为本基金的业绩比较基准符合产品特性，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征和流动性特征，合理衡量本基金的业绩表现。</p> <p>3 年期定期存款利率采用每个封闭期起始日中国人民银行公布的金融机构人民币 3 年期存款基准利率。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，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，无需召开基金份额持有人大会。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金管理人  | 宝盈基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金托管人  | 中国邮政储蓄银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称     | 宝盈聚福 39 个月定开债 A    | 宝盈聚福 39 个月定开债 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 009523             | 009524          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,780,054,820.86 份 | 18,949.15 份     |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021 年 1 月 1 日 — 2021 年 3 月 31 日） |                 |
|-----------------|---------------------------------------|-----------------|
|                 | 宝盈聚福 39 个月定开债 A                       | 宝盈聚福 39 个月定开债 C |
| 1. 本期已实现收益      | 42,597,987.82                         | 127.35          |
| 2. 本期利润         | 42,597,987.82                         | 127.35          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0074                                | 0.0067          |
| 4. 期末基金资产净值     | 5,824,658,935.41                      | 19,066.84       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0077                                | 1.0062          |

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、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

###### 宝盈聚福 39 个月定开债 A

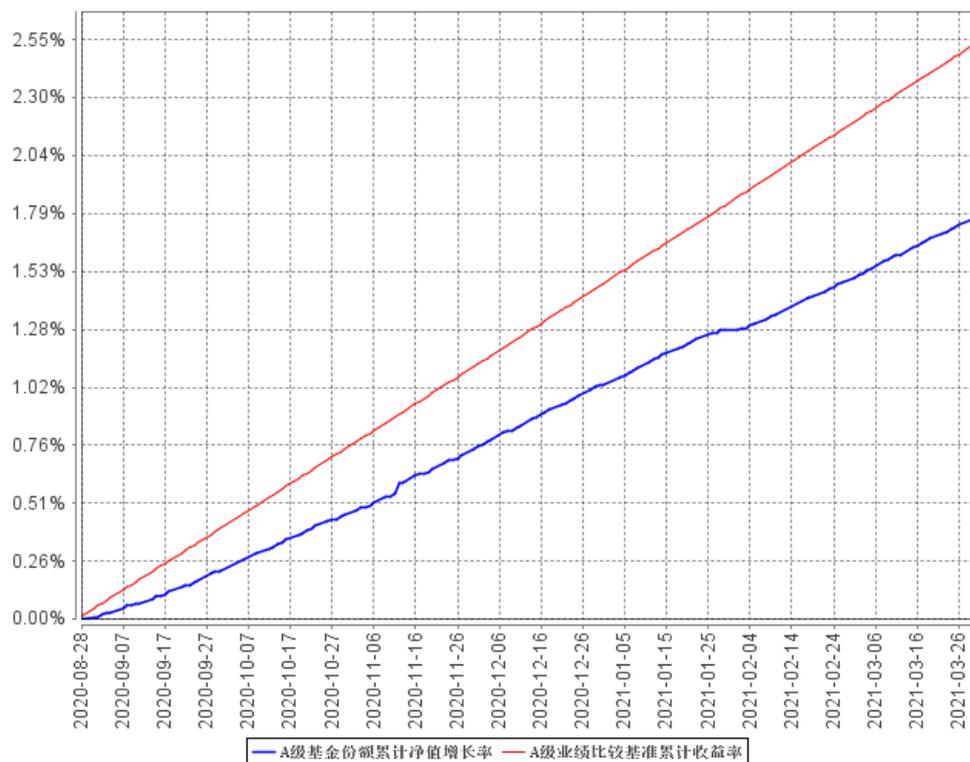
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.74%  | 0.01%     | 1.05%      | 0.01%         | -0.31% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.56%  | 0.01%     | 2.14%      | 0.01%         | -0.58% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.78%  | 0.01%     | 2.55%      | 0.01%         | -0.77% | 0.00% |

###### 宝盈聚福 39 个月定开债 C

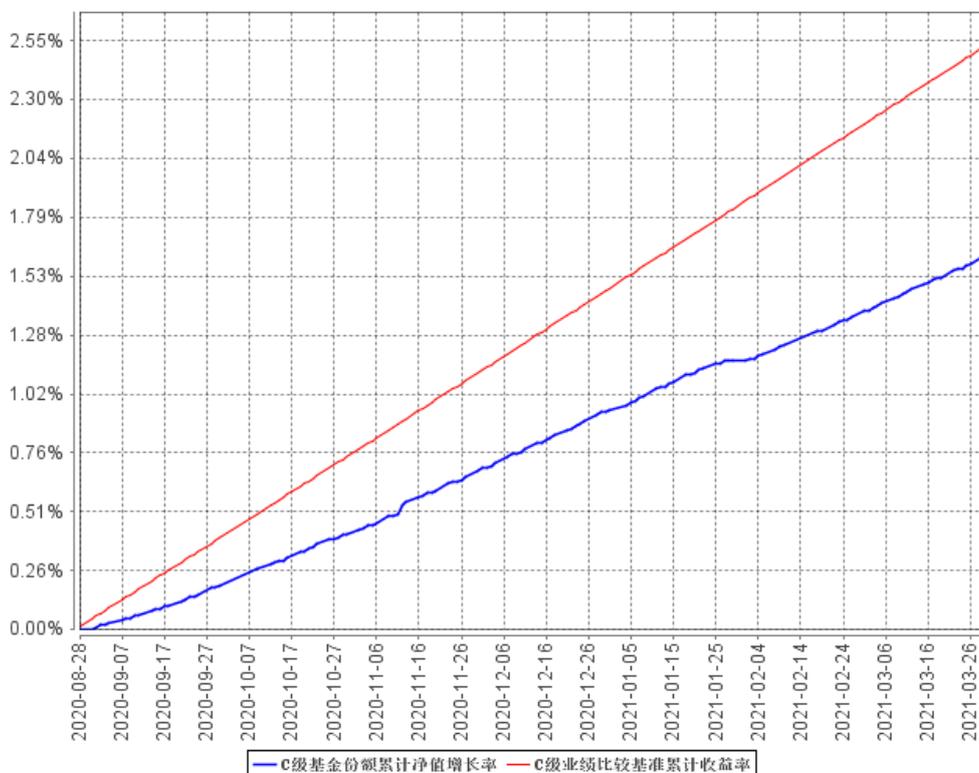
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.67%  | 0.01%     | 1.05%      | 0.01%         | -0.38% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.43%  | 0.01%     | 2.14%      | 0.01%         | -0.71% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.63%  | 0.01%     | 2.55%      | 0.01%         | -0.92% | 0.00% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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：1、本基金合同于 2020 年 8 月 28 日生效，自合同生效日起至披露时点未满 1 年；

2、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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                                                                                                                                       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 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、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、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、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金的基金经理；固定收益部总经理 | 2020年8月28日  | -    | 11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，历任宝盈聚丰两年定期开放债券型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。 |
| 杨献忠 | 本基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈盈润纯债债券型证券投资基金、宝盈盈沛纯债债券型证券投资基金、宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金基金经理                                                              | 2021年1月16日  | -    | 7年     | 杨献忠先生，中国人民大学金融学硕士。2013年8月至2016年11月在中国工商银行总行金融市场部担任交易员；2016年11月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部，先后担任研究员、宝盈货币市场证券投资基金基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。                                                 |

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，海外经济缓慢复苏，国内经济运行延续了去年以来的稳定恢复的态势。通胀方面，主要工业品价格震荡上行，农产品价格先上后下，2 月的居民消费价格指数同比降幅有所收窄。债券市场方面，短期品种 1 年期国开债先上后下，1 季度末回落到 2.76% 左右，较去年末高 20bp；长期品种 10 年期国开债先上后下，1 季度末回落至 3.57% 附近，较去年末高 4bp。

报告期内，本组合主要根据实际资金面情况灵活调整融资期限结构。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈聚福 39 个月定开债 A 基金份额净值为 1.0077 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.74%；截至本报告期末宝盈聚福 39 个月定开债 C 基金份额净值为 1.0062 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.67%；同期业绩比较基准收益率为 1.05%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|-------|--------------|
|----|----|-------|--------------|

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 1 | 权益投资              | -                | -      |
|   | 其中：股票             | -                | -      |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 7,851,512,657.53 | 98.58  |
|   | 其中：债券             | 7,851,512,657.53 | 98.58  |
|   | 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      | 6,141,697.12     | 0.08   |
| 8 | 其他资产              | 106,961,453.92   | 1.34   |
| 9 | 合计                | 7,964,615,808.57 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 摊余成本（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 5,042,462,125.02 | 86.57        |
|    | 其中：政策性金融债 | 5,042,462,125.02 | 86.57        |
| 4  | 企业债券      | 2,809,050,532.51 | 48.23        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 7,851,512,657.53 | 134.80       |

## 5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称          | 数量（张）      | 摊余成本（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|---------------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 180413  | 18 农发 13      | 49,100,000 | 4,942,283,029.76 | 84.85        |
| 2  | 2028036 | 20 工商银行双创债    | 5,600,000  | 560,000,000.00   | 9.61         |
| 3  | 2028030 | 20 兴业银行小微债 05 | 5,600,000  | 558,804,646.45   | 9.59         |
| 4  | 2028029 | 20 交通银行 01    | 5,600,000  | 556,415,455.37   | 9.55         |
| 5  | 2028043 | 20 建设银行双创债    | 4,500,000  | 450,017,853.31   | 7.73         |

## 5.6 报告期末按摊余成本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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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除 20 兴业银行小微债 05、20 交通银行 01、20 工商银行双创债的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2020 年 5 月 15 日，中国银行间市场交易商协会认定兴业银行股份有限公司在部分非金融企业债务融资工具项目招标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预计承销费收入明显低于业务开展平均成本。其不正当竞争行为，违反了《银行间债券市场非金融企业债务融资工具中介服务规则》等相关规定，对市场正常秩序造成不良影响。经交易商协会 2020 年第 5 次自律处分会议审议，决定予以警告，并责令限期整改。

2020 年 5 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会向交通银行股份有限公司出具银保监罚决字（2020）6 号，指出交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。决定对交通银行处以罚款 260 万元。

2020 年 5 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会认定中国工商银行股份有限公司监管标准化

数据（EAST）系统数据质量及数据报送存违法违规行为，违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，决定对工商银行予以行政处罚。

2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会认定中国工商银行股份有限公司存在未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件风险信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗等 23 条主要违法违规事实，违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十三条、第四十六条和相关审慎经营规则，决定对工商银行予以行政处罚。

相关处罚措施对兴业银行、交通银行、工商银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对兴业银行和交通银行的债券偿还影响很小。本基金投资 20 兴业银行小微债 05、20 交通银行 01、20 工商银行双创债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 106,961,453.92 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 106,961,453.92 |

#### 5.10.4 报告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。

#### 5.10.5 报告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。

#### 5.10.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 宝盈聚福 39 个月定开债 A  | 宝盈聚福 39 个月定开债 C |
|---------------------------|------------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 5,780,054,782.71 | 18,941.71       |
| 报告期期间基金总申购份额              | 38.15            | 7.44            |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                | -               |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -               |

|             |                  |           |
|-------------|------------------|-----------|
| 报告期期末基金份额总额 | 5,780,054,820.86 | 18,949.15 |
|-------------|------------------|-----------|

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                    |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |        |
|-------|----------------|------------------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间           | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2021 年 01 月 01 日 -2021 年 03 月 31 日 | 1,729,999,000.00 | 0.00 | -    | 1,729,999,000.00 | 29.93% |
| 个人    | -              | -                                  | -                | -    | -    | -                | -      |

产品特有风险

本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，在极端情况下可能存在流动性等风险，敬请投资人留意。

### 8.2 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈聚福 39 个月定期开放债券型证券投资基金注册的文件；

《宝盈聚福 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

《宝盈聚福 39 个月定期开放债券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。

### 9.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

### 9.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，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

2021 年 4 月 22 日