

# 宝盈基础产业混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 30 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 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</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.....	53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈基础产业混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈基础产业混合	
基金主代码	010383	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 2 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	1,381,734,576.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈基础产业混合 A	宝盈基础产业混合 C
下属分级基金的交易代码:	010383	010384
报告期末下属分级基金的份额总额	1,325,671,689.05 份	56,062,886.96 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于基础产业主题相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过研究宏观经济环境、政策环境、市场指标等可能影响证券市场的重要因素，对各大类资产的风险收益特征进行深入分析，在严格控制组合风险的基础上，调整或确定各大类资产的配置比例，追求超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基础产业主题的界定</li> <li>2、行业配置策略</li> <li>3、个股精选策略</li> <li>4、港股通标的股票投资策略</li> <li>5、存托凭证投资策略</li> </ol> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一，通过采用积极主动的投资策略，结合宏观经济变化趋势，货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。</p> <p>(四) 可转换债券（含可交换债券）投资策略</p> <p>基于行业研究、公司研究和可转债估值模型分析，本基金投资可转换债券（含可交换债券）的投资策略主要包括行业配置策略、个券精选策略、转股策略、条款博弈策略等。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>(六) 股指期货投资策略</p>

	本基金将根据风险管理的原则，以套期保值和流动性管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险和流动性风险，改善组合的风险收益特性。
业绩比较基准	中证建设工程指数收益率×35%+中证新型基础设施建设主题指数收益率×35%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	许俊
	联系电话	0755-83276688	010-66594319
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	fcid@bankofchina.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	中国证券报
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	宝盈基础产业混合 A	宝盈基础产业混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 2 月 2 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 2 月 2 日 - 2021 年 6 月 30 日)

本期已实现收益	31,913,534.86	1,045,639.41
本期利润	130,045,199.60	4,379,188.73
加权平均基金份额本期利润	0.0668	0.0642
本期加权平均净值利润率	6.81%	6.55%
本期基金份额净值增长率	7.45%	7.23%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	27,302,294.94	1,040,239.28
期末可供分配基金份额利润	0.0206	0.0186
期末基金资产净值	1,424,389,312.11	60,115,599.70
期末基金份额净值	1.0745	1.0723
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.45%	7.23%

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、上述基金业绩指标不包括份额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。

5、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

## 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

宝盈基础产业混合 A

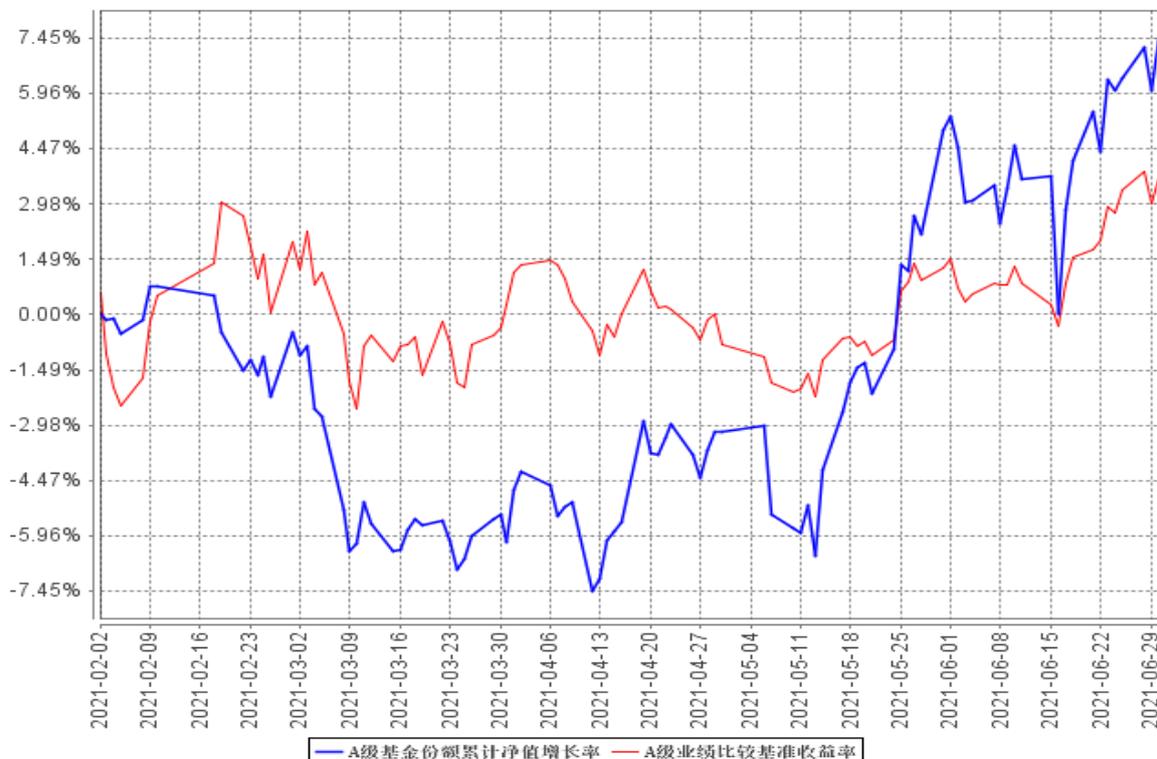
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.35%	1.39%	2.38%	0.55%	-0.03%	0.84%
过去三个月	14.45%	1.26%	3.40%	0.56%	11.05%	0.70%
自基金合同生效起至今	7.45%	1.13%	3.68%	0.77%	3.77%	0.36%

宝盈基础产业混合 C

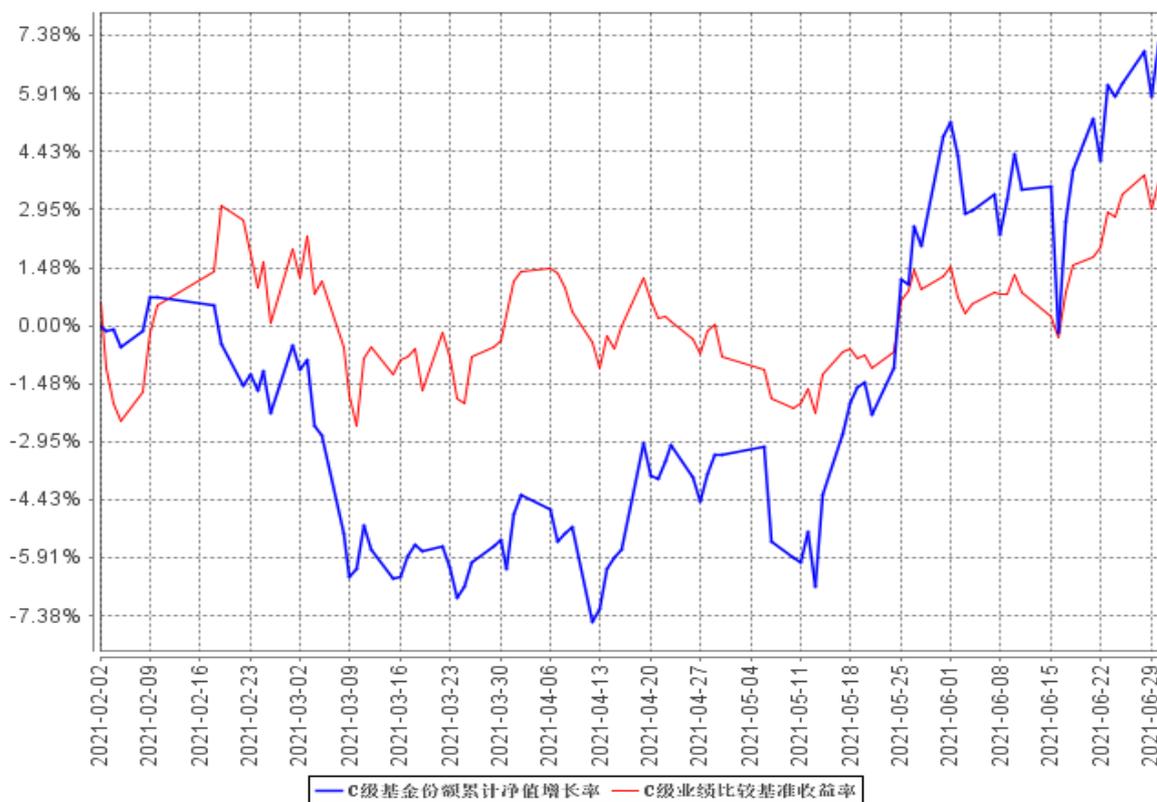
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.30%	1.39%	2.38%	0.55%	-0.08%	0.84%
过去三个月	14.32%	1.26%	3.40%	0.56%	10.92%	0.70%
自基金合同生效起至今	7.23%	1.13%	3.68%	0.77%	3.55%	0.36%

### 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：1、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，截至本报告期末基金合同生效未满一年。  
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将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、宝盈祥瑞定期开放混合、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、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥瑞增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合四十八只基金，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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李健伟	本基金、宝盈核心优势	2021 年 2 月 2 日	-	11 年	李健伟先生，华南理工大学工学硕士。2007 年 8 月至 2010

	灵活配置混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理			年 4 月，在普华永道咨询有限公司任职高级顾问。2010 年 4 月至 2012 年 12 月，在广发证券股份有限公司任职稽核员、行业研究员。2012 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，先后任职研究部研究员、专户投资部投资经理、宝盈先进制造灵活配置混合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。
--	---------------------------------------	--	--	--

注：1、李健伟为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、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 2021 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

过去 2 年的牛市从某种意义上来说，是估值推动型的牛市，2021 年市场会从估值推动型向盈利驱动型转化，但是投资者预期收益率要保持谨慎。

一季度市场出现了大幅震荡，资金面收紧扮演了催化剂角色，但资本市场自身估值高企和股价快速上涨积累的风险本身需要释放。虽然一季度市场震荡明显，但是我们对行情相对乐观，国祚绵长是 A 股长期牛市的基础，流动性的边际收紧并没有改变牛市基础。二季度市场呈现出了结构性的投资机会，以电动车和半导体为代表的成长性板块在二季度表现优异。上半年的投资策略贯彻了年度报告中的投资策略，重点配置了国防军工、新能源和半导体等成长性较高的行业个股。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈基础产业混合 A 基金份额净值为 1.0745 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.45%；截至本报告期末宝盈基础产业混合 C 基金份额净值为 1.0723 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.23%；同期业绩比较基准收益率为 3.68%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国经济持续稳定发展，产业结构转型升级的过程中，资本市场结构性的机会层出不穷。回顾 A 股过去几年的走势，从 17-20 年的白酒板块，到 19-20 年的医药板块，到今年半导体和新能源领域，超级赛道在景气上行周期的市场表现是非常极致的。行业主题基金百花齐放，市场总能出现结构性的机会。

以半导体和新能源为例，景气外溢给行业二三线公司带来了巨大的盈利弹性。一方面，行业二线公司在行业景气外溢的过程中，产能利用率大幅提升；另一方面，供给缺口带来了价格上行的弹性，加之本身估值折价，因此二线品种在今年上半年的估值修复过程中的涨幅是巨大的。

在过去两年的龙头白马躺赢行情中，部分投资者在茅指数稳定上行中形成了思维惯性，或故步自封丧失敏感性，或不愿放弃人设调仓换股。2021 年市场无异于给 A 股众多投资者又上了一课。Stay foolish, stay hungry, 虚怀若谷，勤勉尽责是保持卓越的不二法门。

站在 2021 年中时点，我们认为下列领域和方向是我们重点看好的方向：

1、电动车产业链，中游环节大概率供需结构反转，虽然目前交易非常拥挤，但上游资源环节供应长期紧张。

2、汽车智能化/电动化长期趋势不变，且估值体系较为稳定，适合公募长期配置。从成长角度来看，汽车电动化和智能化还是最清晰可见的大赛道。

3、光伏产业链，在硅料价格下行后带来下游排产提升，推动产业链盈利上行。

4、军工景气度高企，导弹等细分领域迎来业绩释放阶段，性价比明显。

#### 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”）在宝盈基础产业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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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：宝盈基础产业混合型证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	154,336,375.24
结算备付金		1,752,492.49
存出保证金		597,022.18
交易性金融资产	6.4.7.2	1,400,022,040.04
其中：股票投资		1,400,022,040.04
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
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		-
应收利息	6.4.7.5	24,083.39
应收股利		-
应收申购款		297,525.81
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,557,029,539.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30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		-
应付证券清算款		16,409.21
应付赎回款		67,637,462.77
应付管理人报酬		2,246,307.43
应付托管费		374,384.55
应付销售服务费		26,029.64
应付交易费用	6.4.7.7	2,013,622.29
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	210,411.45
负债合计		72,524,627.34
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,381,734,576.01
未分配利润	6.4.7.10	102,770,335.80
所有者权益合计		1,484,504,911.81
负债和所有者权益总计		1,557,029,539.15

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，宝盈基础产业混合 A 基金份额净值 1.0745 元，基金份额总额 1,325,671,689.05 份；宝盈基础产业混合 C 基金份额净值 1.0723 元，基金份额总额 56,062,886.96 份。宝盈基础产业混合份额总额合计为 1,381,734,576.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈基础产业混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		153,636,155.35
1.利息收入		1,478,602.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,035,645.75
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		442,956.40
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		48,785,418.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,229,048.86
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-

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	5,556,370.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	101,465,214.06
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	1,906,920.20
<b>减：二、费用</b>		19,211,767.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,055,830.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,009,305.05
3. 销售服务费		135,820.81
4. 交易费用	6.4.7.19	4,952,568.86
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	58,241.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		134,424,388.33
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		134,424,388.33

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈基础产业混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 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）	2,102,465,986.03	-	2,102,465,986.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	134,424,388.33	134,424,388.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-720,731,410.02	-31,654,052.53	-752,385,462.55
其中：1.基金申购款	12,203,979.60	76,640.68	12,280,620.28
2.基金赎回款	-732,935,389.62	-31,730,693.21	-764,666,082.83
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）	1,381,734,576.01	102,770,335.80	1,484,504,911.81
-----------------	------------------	----------------	------------------

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，无上年度可比期间数据。

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

宝盈基础产业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[2020]2317 号《关于准予宝盈基础产业混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《宝盈基础产业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人民币 2,102,072,643.25 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《宝盈基础产业混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,102,465,986.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 393,342.78 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《宝盈基础产业混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈基础产业混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈基础产业混合 A；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈基础产业混合 C。宝盈基础产业混合 A 和宝盈基础产业混合 C 分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈基础产业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、政府

支持机构债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、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、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:股票(包括国内依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票)投资占基金资产的比例为 60%-95%,其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%,投资于基础产业主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证建设工程指数收益率×35%+中证新型基础设施建设主题指数收益率×35%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+中证综合债券指数收益率×20%。

#### 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》、《宝盈基础产业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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值

并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **6.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	154,336,375.24
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：	154,336,375.24

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,298,556,825.98	1,400,022,040.04	101,465,214.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,298,556,825.98	1,400,022,040.04	101,465,214.06

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 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

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	16,864.70
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	6,756.96
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	461.73
合计	24,083.39

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,013,622.29
银行间市场应付交易费用	-

合计	2,013,622.29
----	--------------

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付赎回费	165,666.75
应付证券出借违约金	-
预提费用	44,744.70
合计	210,411.45

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈基础产业混合 A		
项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,031,271,550.68	2,031,271,550.68
本期申购	9,294,362.79	9,294,362.79
本期赎回(以“-”号填列)	-714,894,224.42	-714,894,224.42
本期末	1,325,671,689.05	1,325,671,689.05

金额单位：人民币元

宝盈基础产业混合 C		
项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	71,194,435.35	71,194,435.35
本期申购	2,909,616.81	2,909,616.81
本期赎回(以“-”号填列)	-18,041,165.20	-18,041,165.20
本期末	56,062,886.96	56,062,886.96

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈基础产业混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	31,913,534.86	98,131,664.74	130,045,199.60
本期基金份额交易产生的变动数	-4,611,239.92	-26,716,336.62	-31,327,576.54
其中：基金申购款	-11,653.21	73,812.77	62,159.56
基金赎回款	-4,599,586.71	-26,790,149.39	-31,389,736.10

本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,302,294.94	71,415,328.12	98,717,623.06

单位：人民币元

宝盈基础产业混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,045,639.41	3,333,549.32	4,379,188.73
本期基金份额交易产生的变动数	-5,400.13	-321,075.86	-326,475.99
其中：基金申购款	-5,255.23	19,736.35	14,481.12
基金赎回款	-144.90	-340,812.21	-340,957.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,040,239.28	3,012,473.46	4,052,712.74

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
活期存款利息收入	964,128.78
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	63,776.26
其他	7,740.71
合计	1,035,645.75

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,080,498,441.62
减：卖出股票成本总额	1,037,269,392.76
买卖股票差价收入	43,229,048.86

**6.4.7.13 债券投资收益**

无。

**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 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月 30日
股票投资产生的股利收益	5,556,370.08
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	5,556,370.08

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
1. 交易性金融资产	101,465,214.06
——股票投资	101,465,214.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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 增值税	-
合计	101,465,214.06

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6 月30日
基金赎回费收入	1,903,663.74
基金转换费收入	3,256.46

合计	1,906,920.20
----	--------------

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,952,568.86
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	4,952,568.86

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
审计费用	44,744.70
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	13,496.95
合计	58,241.65

### 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（“宝盈基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

无。

##### 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
	2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,055,830.65
其中：支付销售机构的客户维护费	5,359,922.69

注：1、支付基金管理人宝盈基金公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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×1.50%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，无上年度可比数据。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,009,305.05

注：1、支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/当年天数；

2、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，无上年可比期间数据。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2021年2月2日(基金合同生效日)至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	宝盈基础产业混合 A	宝盈基础产业混合 C	合计
中国银行	0.00	26,616.79	26,616.79
宝盈基金公司	0.00	518.23	518.23
合计	0.00	27,135.02	27,135.02

注：1、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 0.50% 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×0.50%/当年天数；

2、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，无上年可比期间数据。

#### 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

无。

#### 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

本基金本报告期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	154,336,375.24	964,128.78

注：1、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；

2、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，无上年可比期间数据。

**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（2021 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
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股锁定	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	新股锁定	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股锁定	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股锁定	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股锁定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪	2021年6月	2021年12月	新股锁	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

	节能	月 9 日	月 20 日	定					
--	----	-------	--------	---	--	--	--	--	--

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，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，采取集中竞价交易方式的，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 1%，且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本基金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%。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。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《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》的有关规定。

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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票(包括存托凭证及港股通标的股票)、以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。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约责任，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股份有限公司，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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资。

### 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。

#### 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》及《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发行的证券不得超过该证券的 10%。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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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上述比例限制)。

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。

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未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	154,336,375.24	-	-	-	154,336,375.24
结算备付金	1,752,492.49	-	-	-	1,752,492.49

存出保证金	597,022.18	-	-	-	597,022.18
交易性金融资产	-	-	-	1,400,022,040.04	1,400,022,040.04
应收利息	-	-	-	24,083.39	24,083.39
应收申购款	-	-	-	297,525.81	297,525.81
资产总计	156,685,889.91	-	-	1,400,343,649.24	1,557,029,539.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16,409.21	16,409.21
应付赎回款	-	-	-	67,637,462.77	67,637,462.77
应付管理人报酬	-	-	-	2,246,307.43	2,246,307.43
应付托管费	-	-	-	374,384.55	374,384.55
应付销售服务费	-	-	-	26,029.64	26,029.64
应付交易费用	-	-	-	2,013,622.29	2,013,622.29
其他负债	-	-	-	210,411.45	210,411.45
负债总计	-	-	-	72,524,627.34	72,524,627.34
利率敏感度缺口	156,685,889.91	-	-	1,327,819,021.90	1,484,504,911.81

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	314,294,588.90	-	314,294,588.90
资产合计	-	314,294,588.90	-	314,294,588.90
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	314,294,588.90	-	314,294,588.90

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年6月30日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	15,714,729.45
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-15,714,729.45

#### 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，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例；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(包括国内依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票)投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 40%，投资于基础产业主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或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。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 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,400,022,040.04	94.31

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	1,400,022,040.04	94.31

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

#### 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	1,400,022,040.04	89.92
	其中：股票	1,400,022,040.04	89.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	156,088,867.73	10.02
8	其他各项资产	918,631.38	0.06
9	合计	1,557,029,539.15	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 314,294,588.92 元，占基金资产净值比例 21.17%。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,085,366,204.34	73.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	257,526.54	0.02
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	20,300.21	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	88.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
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	1,085,727,451.12	73.14

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	190,527,015.74	12.83
I 电信服务	123,767,573.18	8.34
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	314,294,588.92	21.17

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

## 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	002049	紫光国微	850,238	131,098,197.22	8.83
2	688020	方邦股份	1,383,376	128,612,466.72	8.66
3	00700	腾讯控股	254,700	123,767,573.18	8.34
4	002460	赣锋锂业	1,001,900	121,320,071.00	8.17
5	002025	航天电器	2,112,157	105,966,916.69	7.14
6	002920	德赛西威	838,759	92,330,590.72	6.22
7	02382	舜宇光学科技	410,000	83,718,897.12	5.64
8	688002	睿创微纳	811,207	80,982,794.81	5.46
9	01810	小米集团-W	3,426,400	76,978,050.62	5.19
10	601012	隆基股份	839,887	74,615,561.08	5.03
11	300699	光威复材	956,900	72,676,555.00	4.90
12	600519	贵州茅台	33,800	69,516,460.00	4.68
13	688011	新光光电	1,754,736	69,312,072.00	4.67
14	301006	迈拓股份	2,057,442	62,751,981.00	4.23
15	603501	韦尔股份	170,600	54,933,200.00	3.70
16	00981	中芯国际	1,500,000	29,830,068.00	2.01
17	000661	长春高新	25,000	9,675,000.00	0.65
18	300122	智飞生物	50,000	9,336,500.00	0.63
19	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.03
20	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.02
21	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
22	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
23	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
24	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.01
25	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.01
26	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.01
27	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
28	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.00
29	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
30	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
31	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
32	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
33	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
34	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00

35	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
36	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
37	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
38	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
39	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
40	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
41	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
42	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
43	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
44	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
45	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
46	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
47	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
48	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
49	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
50	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
51	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
52	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
53	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
54	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
55	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
56	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
57	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
58	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
59	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
60	688425	铁建重工	329	2,013.48	0.00
61	688345	博力威	2	147.10	0.00
62	688621	阳光诺和	1	88.80	0.00
63	688517	金冠电气	2	28.42	0.00
64	688681	科汇股份	1	18.38	0.00
65	688538	和辉光电	3	11.43	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002049	紫光国微	206,109,472.86	13.88
2	00700	腾讯控股	152,562,664.86	10.28

3	002025	航天电器	152,092,482.57	10.25
4	300699	光威复材	123,507,094.66	8.32
5	01810	小米集团-W	121,377,138.71	8.18
6	688020	方邦股份	113,288,531.20	7.63
7	600519	贵州茅台	110,774,325.88	7.46
8	002460	赣锋锂业	108,257,303.99	7.29
9	002179	中航光电	101,866,822.84	6.86
10	00981	中芯国际	100,731,700.88	6.79
11	002475	立讯精密	85,621,142.63	5.77
12	02382	舜宇光学科技	84,948,261.52	5.72
13	600745	闻泰科技	77,804,737.06	5.24
14	688002	睿创微纳	75,809,856.55	5.11
15	002920	德赛西威	75,090,905.08	5.06
16	688011	新光光电	71,306,243.18	4.80
17	688111	金山办公	69,512,402.94	4.68
18	301006	迈拓股份	66,907,112.16	4.51
19	601012	隆基股份	64,918,050.23	4.37
20	603501	韦尔股份	48,241,724.19	3.25
21	002466	天齐锂业	47,861,133.03	3.22
22	688656	浩欧博	39,146,162.74	2.64
23	688109	品茗股份	39,072,537.97	2.63
24	06969	思摩尔国际	35,552,003.72	2.39
25	000547	航天发展	29,961,244.35	2.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002049	紫光国微	125,496,983.35	8.45
2	002179	中航光电	104,620,855.44	7.05
3	002475	立讯精密	93,175,660.20	6.28
4	688111	金山办公	72,732,619.50	4.90
5	600745	闻泰科技	65,147,579.50	4.39
6	300699	光威复材	62,939,793.40	4.24

7	00981	中芯国际	58,723,988.05	3.96
8	002466	天齐锂业	52,323,942.92	3.52
9	600519	贵州茅台	46,806,175.48	3.15
10	01810	小米集团-W	45,598,074.98	3.07
11	688109	品茗股份	43,532,154.79	2.93
12	002025	航天电器	40,814,714.60	2.75
13	688656	浩欧博	35,850,681.20	2.41
14	300166	东方国信	31,444,764.00	2.12
15	06969	思摩尔国际	31,144,596.79	2.10
16	02382	舜宇光学科技	28,456,229.29	1.92
17	002273	水晶光电	27,126,151.00	1.83
18	000547	航天发展	25,288,848.27	1.70
19	601966	玲珑轮胎	22,455,137.15	1.51
20	002460	赣锋锂业	18,489,442.75	1.25

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	2,335,826,218.74
卖出股票收入（成交）总额	1,080,498,441.62

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值和流动性管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险和流动性风险，改善组合的风险收益特性。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

## 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除腾讯控股的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

腾讯控股于 2018 年 11 月 29 日通过全资子公司 Tencent Mobility Limited 及其关联方与猿辅导签署了 F 轮股权认购协议，腾讯以 16.52 亿元认购该轮融资发行股份的 83.33%，交易后腾讯持有猿辅导 15.41% 的股权；2018 年 7 月 11 日，腾讯与上海阑途信息技术有限公司等相关方签署《增资协议》，收购途虎 13.88% 的股权。2019 年 10 月 31 日，腾讯与相关方签署协议再次投资。交易完成后，腾讯合计持有途虎 18.34% 的股权；腾讯与 Hammer Capital 以 75.9 亿元联合购买易车股权，分别持股 68.18%、15.15%。

根据《反垄断法》第二十条规定“经营者集中是指下列情形：（一）经营者合并；（二）经营者通过取得股权或者资产的方式取得对其他经营者的控制权；（三）经营者通过合同等方式取得对其他经营者的控制权或者能够对其他经营者施加决定性影响”，以上三次股权收购交易均属于《反垄断法》第二十条规定的经营者集中，达到《国务院关于经营者集中申报标准的规定》第三条规定的申报标准，属于应当申报的情形。《反垄断法》第二十一条规定“经营者集中达到国务院规定

的申报标准的，经营者应当事先向国务院反垄断执法机构申报，未申报的不得实施集中”，因腾讯与相关方完成股权变更前未向相关机关进行申报，构成未依法申报违法实施经营者集中。根据上述规定，国家市场监督管理总局分别于 2021 年 3 月 12 日及 2021 年 4 月 30 日给予腾讯共计 150 万元罚款的行政处罚。

本基金认为，以上三次经营者集中不会产生排除、限制竞争的效果，不影响公司长期投资价值，基金管理人未来会持续关注此类事件的发展趋势。

### 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	597,022.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,083.39
5	应收申购款	297,525.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	918,631.38

### 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

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
宝盈基础产 业混合 A	13,234	100,171.66	12,087,360.70	0.91%	1,313,584,328.35	99.09%
宝盈基础产 业混合 C	2,538	22,089.40	201,049.44	0.36%	55,861,837.52	99.64%
合计	15,772	87,606.81	12,288,410.14	0.89%	1,369,446,165.87	99.11%

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（份）	占基金总份 额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	宝盈基础产业混合 A	10.98	0.0000%
	宝盈基础产业混合 C	56,301.54	0.1004%
	合计	56,312.52	0.0041%

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 （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	宝盈基础产业混合 A	0
	宝盈基础产业混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈基础产业混合 A	0
	宝盈基础产业混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈基础产业混合 A	宝盈基础产业混合 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 2 日）基金份额总额	2,031,271,550.68	71,194,435.35
基金合同生效日起至报告期期末	9,294,362.79	2,909,616.81

基金总申购份额		
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	714,894,224.42	18,041,165.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	1,325,671,689.05	56,062,886.96

## § 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

本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	
天风证券	2	779,874,042.62	22.86%	710,700.03	23.42%	-
中泰证券	1	764,388,285.45	22.41%	696,589.12	22.95%	-
渤海证券	1	640,718,878.06	18.78%	583,891.06	19.24%	-
华泰证券	2	452,722,765.34	13.27%	362,178.01	11.93%	-
平安证券	1	293,768,693.27	8.61%	267,710.94	8.82%	-
长城证券	1	174,542,880.73	5.12%	149,969.63	4.94%	-

兴业证券	1	124,702,321.20	3.66%	99,762.15	3.29%	-
华创证券	1	109,403,965.93	3.21%	99,700.06	3.28%	-
海通证券	3	70,888,633.92	2.08%	64,601.25	2.13%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

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要，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。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：(1)、新租华泰证券上海、深圳交易单元各一个。新租国泰君安证券深圳交易单元一个。新租长城证券上海交易单元一个。新租招商证券上海交易单元一个。新租海通证券上海交易单元一个、深圳交易单元两个。新租长江证券深圳交易单元一个。新租兴业证券深圳交易单元一个。新租渤海证券深圳交易单元一个。新租中信证券上海交易单元一个。新租平安证券深圳交易单元一个。新租中泰证券上海交易单元一个。新租西南证券深圳交易单元一个。新租华创证券上海交易单元一个。新租东兴证券深圳交易单元一个。新租东北证券上海交易单元一个。新租中信证券(华南)上海、深圳交易单元各一个。新租天风证券上海、深圳交易单元各一个。新租浙商证券上海、深圳交易单元各一个。(2)、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
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	399,300,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（华南）	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下基金参加交通银行股份有限公司基金申购及定期定额投资手续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	2021年6月29日
2	宝盈基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售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	2021年5月21日
3	宝盈基金管理有限公司关于增加中国人寿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	2021年5月19日

4	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、定期定额投资及转换业务的提示性公告	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	2021 年 4 月 28 日
5	宝盈基金管理有限公司关于新增北京度小满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	2021 年 4 月 16 日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告	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	2021 年 4 月 15 日
7	宝盈基金管理有限公司关于新增玄元保险代理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	2021 年 4 月 13 日
8	宝盈基础产业混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	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	2021 年 3 月 31 日
9	宝盈基础产业混合型证券投资基金(宝盈基础产业混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
10	宝盈基础产业混合型证券投资基金(宝盈基础产业混合 C 份额)基金产品资料概要(更新)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
11	宝盈基础产业混合型证券投资基金更新招募说明书	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
12	宝盈基础产业混合型证券投资基金基金合同	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
13	宝盈基础产业混合型证券投资基金托管协议	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 4 日
14	宝盈基金管理有限公司关于宝盈基础产业混合型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告	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	2021 年 2 月 4 日
15	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司手续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	2021 年 2 月 4 日
16	宝盈基金管理有限公司关于新增中信期货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	2021 年 2 月 4 日
17	宝盈基础产业混合型证券投资	中国证券报, 本基金管理人网站,	2021 年 2 月 3 日

	基金基金合同生效公告	中国证监会基金电子披露网站	
18	关于宝盈基础产业混合型证券投资基金增加兴业银行股份有限公司为代销机构的公告	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	2021 年 1 月 29 日
19	宝盈基金管理有限公司关于网上直销平台“招商银行一网通”渠道费率优惠的公告	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	2021 年 1 月 29 日
20	关于宝盈基础产业混合型证券投资基金提前结束募集的公告	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	2021 年 1 月 28 日
21	关于宝盈基础产业混合型证券投资基金增加中航证券有限公司为代销机构的公告	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	2021 年 1 月 26 日
22	关于宝盈基础产业混合型证券投资基金增加代销机构的公告	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	2021 年 1 月 22 日
23	宝盈基金管理有限公司旗下 45 只基金 2020 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	2021 年 1 月 22 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

中国证监会准予基础产业混合型证券投资基金注册的文件。

《宝盈基础产业混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈基础产业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

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

2021 年 8 月 31 日