

宝盈智慧生活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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 4 月 20 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈智慧生活混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈智慧生活混合	
基金主代码	011170	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 20 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	242,119,115.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈智慧生活混合 A	宝盈智慧生活混合 C
下属分级基金的交易代码:	011170	011171
报告期末下属分级基金的份额总额	143,424,266.50 份	98,694,849.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于智慧生活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	（一）大类资产配置策略 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。 （二）股票投资策略 1、智慧生活主题的界定 2、行业配置策略 3、个股精选策略 4、港股通标的股票投资策略 5、存托凭证投资策略 （三）债券投资策略 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。 （四）可转换债券（含可交换债券）投资策略 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。 （五）资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 （六）股指期货投资策略

	本基金将根据风险管理的原则，以套期保值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 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张磊	张燕
	联系电话	0755-83276688	0755-83199084
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95555
传真		0755-83515599	0755-83195201
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518034	518040
法定代表人		马永红	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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、基金托管人处

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	宝盈智慧生活混合 A	宝盈智慧生活混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 4 月 20 日 – 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 4 月 20 日 – 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,216,603.56	3,073,966.64
本期利润	23,021,423.64	15,044,350.98
加权平均基金份额本期利润	0.1469	0.1304
本期加权平均净值利润率	14.19%	12.66%
本期基金份额净值增长率	14.93%	14.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,885,000.16	3,278,942.62
期末可供分配基金份额利润	0.0341	0.0332
期末基金资产净值	164,838,126.23	113,341,264.28
期末基金份额净值	1.1493	1.1484
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	14.93%	14.84%

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。

5、本基金本报告期自 2021 年 4 月 20 日（基金合同生效日）起至 2021 年 6 月 30 日止。

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

宝盈智慧生活混合 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	9.32%	1.09%	-0.85%	0.57%	10.17%	0.52%
自基金合同生效起至今	14.93%	0.86%	1.84%	0.62%	13.09%	0.24%

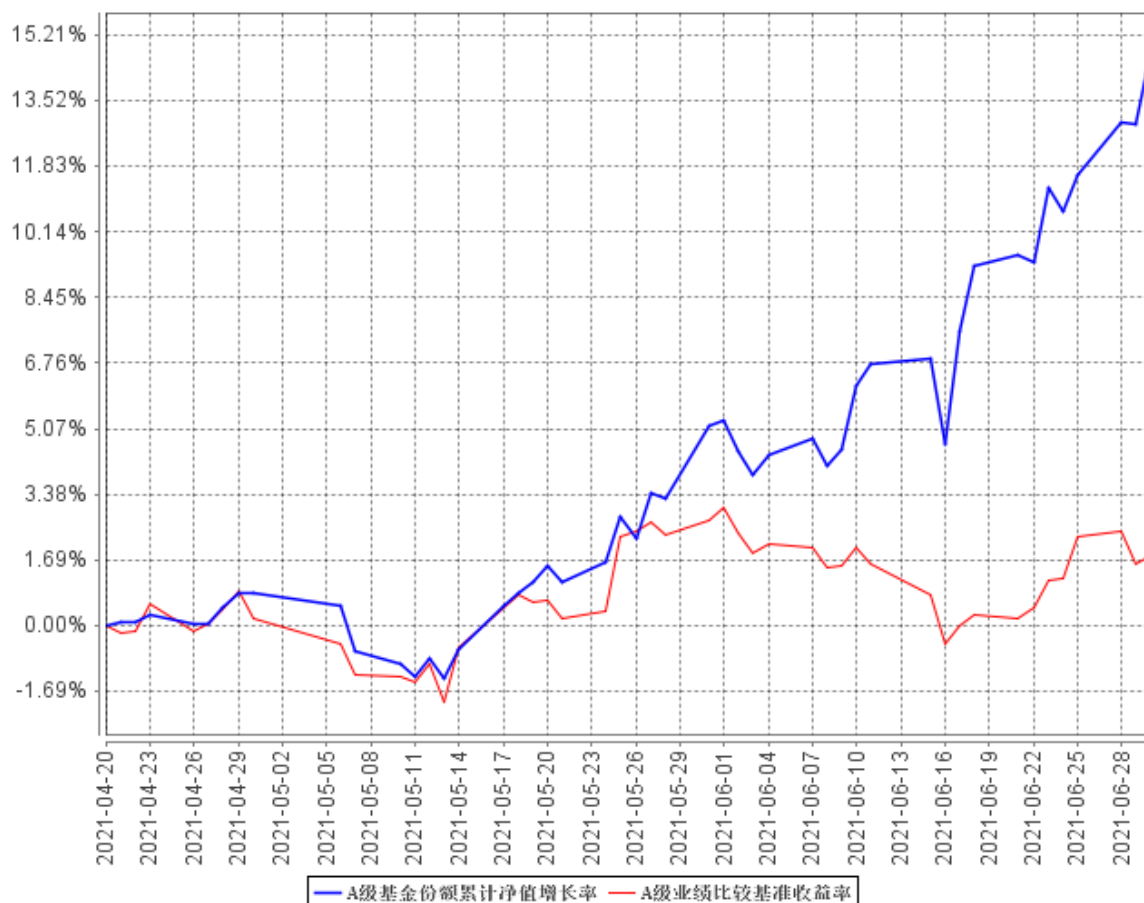
宝盈智慧生活混合 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

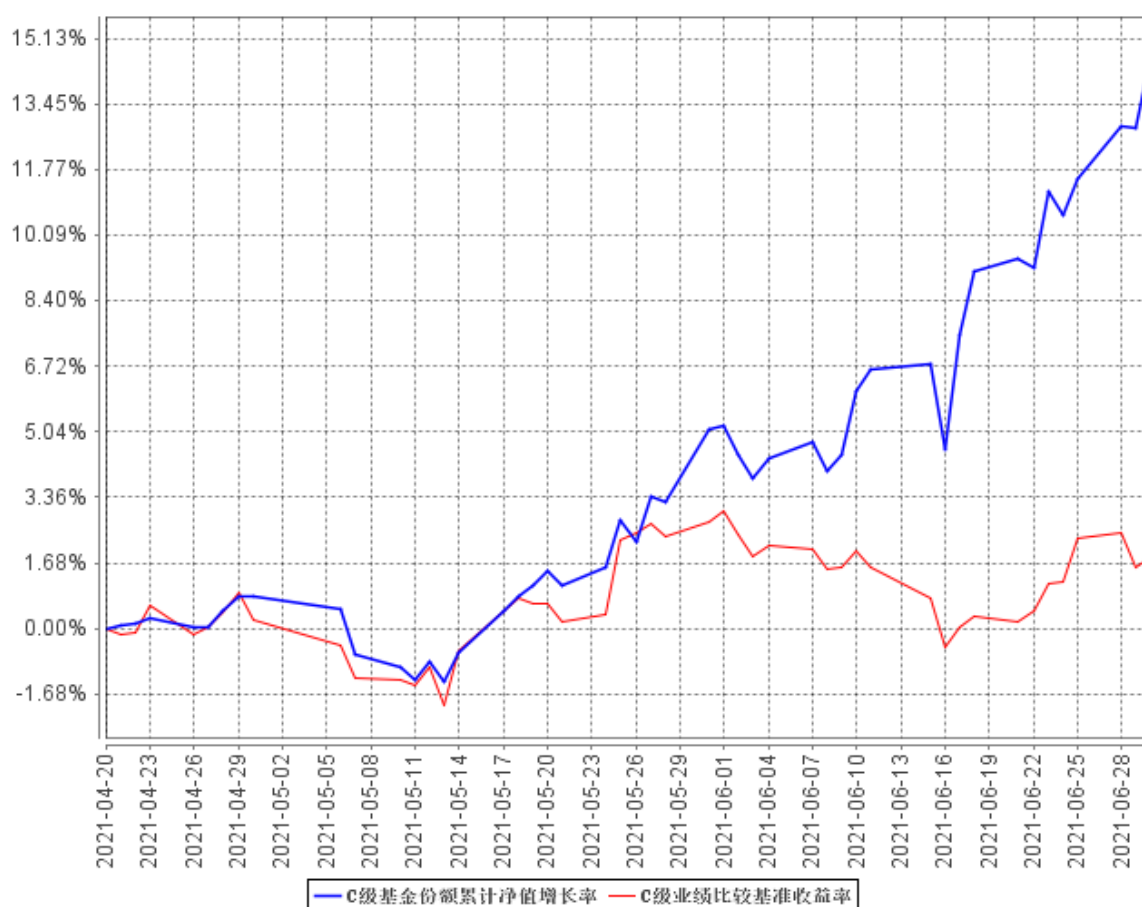
	长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	收益率标准 差④		
过去一个月	9.29%	1.09%	-0.85%	0.57%	10.14%	0.52%
自基金合同 生效起至今	14.84%	0.86%	1.84%	0.62%	13.00%	0.24%

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、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。

2、本基金合同生效日为2021年4月20日，自合同生效日起至披露时点未满一年。

§ 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、宝盈祥裕增强回报混合、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		
张仲维	本基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金、宝盈人工智能主题股票型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资	2021 年 4 月 20 日	-	10 年	张仲维先生，台湾政治大学国际贸易硕士。曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司国际部研究员、基金经理，华润元大基金管理有限公司研究员、基金经理；自 2015 年 5 月加入宝盈基金管理

	资基金、宝盈创新驱动股票型证券投资基金、宝盈发展新动能股票型证券投资基金、宝盈研究精选混合型证券投资基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；海外投资部总经理				有限公司，历任研究部研究员、投资经理。中国台湾籍，证券投资基金从业人员资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、张仲维为首任基金经理，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

2021 年上半年沪深 300 指数上涨 0.24%，创业板指数上涨 17.22%。今年一季度市场对于流通

性收紧的担忧导致整体跌幅较大，尤其是前期强势的高估值标的回调较多，二季度以来随着上市公司年报和一季报业绩的披露，业绩兑现较好的优质标的出现快速反弹，同时部分高景气度环节整体业绩实现超预期增长、叠加市场逐步消除对流通性的担忧，优质公司和板块涨幅较大。行业上来看(以中信一级行业)，上半年涨幅最大的为基础化工和钢铁板块，分别上涨 25.73%和 24.69%；跌幅较大的行业为非银行金融和家电，分别下跌 17.49%和 14.38%。

本基金主要投资于智慧生活主题相关的优质上市公司，本基金于 4 月 20 日成立，在成立初期秉持绝对收益的思路，逐步累积安全垫后增加持仓比例。本基金上涨主因是我们前期看好的智能汽车供应链及半导体行业涨幅较大。报告期内基金重点布局新能源汽车及汽车电子供应链、光伏、半导体等相关板块。我们坚定持有我们看好的方向与持仓，优选细分领域中的龙头公司，优质的公司通过业绩高速增长能消化较高的估值，终将实现股价的上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈智慧生活混合 A 基金份额净值为 1.1493 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.93%；截至本报告期末宝盈智慧生活混合 C 基金份额净值为 1.1484 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.84%；同期业绩比较基准收益率为 1.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于新冠疫情的影响而导致全球经济波动较大，在此情况下，中国治理的优势尤为显著，相较于国外企业中国企业获有更多发展契机、实现业务高速增长，因此结合积极因素来看，我们对于 A 股市场中长期依旧保持乐观态度。自上而下我们选择高景气成长行业布局，辅以自下而上的个股选择来组成投资组合，具体而言，我们看好以下几个方向都是行业景气度持续上升、优质公司业绩高速增长才有望消化较高的估值：

(1) 智能汽车：智能汽车市场将迎巨大变革，铸就下一个 10 年的繁荣。智能驾驶早在 2015 年就是全球范围内公认的行业未来趋势，但受法律法规、零部件成本、芯片算力、消费者接受度等因素的影响，行业关注度高但渗透率提升较为缓慢。但 2019 年开始，随着特斯拉 Model 3 依靠 Autopilot 越来越好的用户体验在全球范围内取得巨大的成功，尤其在上海工厂投产后实现成本进一步的下降，让消费者和主机厂都意识到现有的技术已经能够支撑部分智能驾驶功能的落地，而良好的用户体验能够帮助车企获得认可和溢价。在特斯拉的“鲶鱼效应”下各大主机厂都在加速智能化和电子化功能的配置，推动行业渗透率快速提升。尤其像小鹏、蔚来等造车新势力在这一方面布局更为积极，如果未来苹果、百度、华为等高科技企业进军造车，那么必将进一步加快行业的发展。在这个过程中，好的自动泊车、自适应巡航等功能可以给予消费者截然不同的驾驶体验，能够帮助车企更好的梳理品牌形象、刺激消费者付出溢价购车，而这些功能也正是苹果、

华为等科技巨头所擅长的领域。这些功能的实现离不开精确的感知和及时的运算决策，所以在多方的推动下，未来像摄像头、雷达等感知类硬件和域控制器等智能驾驶决策类产品的搭载速度将进一步加快，相关行业及上市公司有望长期受益实现快速增长，中国汽车电子企业也有机会借助智能化变革和世界工厂优势，加速赶超欧美汽车电子巨头。

（2）新能源：“碳中和”是全球共同目标，实现“碳中和”最重要的路径是采用清洁能源。在能源供给端，光伏发电成本在过去十年下降了近 90%，预计到 2025 年还能在目前基础下降 60% 以上。随成本大幅下降，光伏将成为清洁能源的主力军，带来产业链的长期投资机会。光伏行业 2021 年上半年国内装机 14GW，同比增长约 20%，略低于年初市场预期，主要是由于上游硅料价格从年初 9 万/吨快速上涨至 30 万/吨，导致成本大幅上涨、抑制下游需求所致，展望下半年来看硅料价格已经见顶、硅片环节让利下游，有望带动下游需求快速恢复，2022 年行业有望实现较高增速。

在消费领域，燃油车向电动车的转变趋势不可逆转。2021 年上半年新能源行业维持高景气度，其中中国新能源汽车销量达到 120.6 万辆，同比增长 201.5%，其中 6 月单月销量达到 25.6 万，同比增长 139.3%，同时“中汽协”预计全年新能源汽车销量将达到 240 万辆以上，行业景气度持续超过市场预期，带动电动车产业链需求旺盛、产业链供给持续紧张。下半年来看国内销量景气度将维持高位，欧洲、美国等其他地区也将继续加大电动车的支持力度，全球电动车渗透率将快速提升；所以总结而言我们认为新能源行业在全球共同推动下将继续维持高景气度，并且是未来 5-10 年长周期确定性的产业趋势，产业链中优质中国企业将伴随行业快速成长。

（3）半导体以及半导体设备：中美贸易战，尤其是华为海思被制裁以来，才是中国半导体行业发展的起点，关键半导体元器件的缺乏成为制约中国追赶世界的最大原因。但我们认为这种短期的困难是长期的机遇。从国家战略角度看，解决半导体这类“卡脖子”技术将是一项长期的重点工作。可以预计，半导体行业将会获得更多的国家政策支持，这种支持不仅体现在研发资金、人才财政政策优惠方面，更将会体现在国产 IT 软硬件的直接应用和生态建设的支持，在重点行业领域鼓励优先采用国产半导体器件，以需求促进供给。我们很兴奋的看到半导体国产化在各个行业领域里面加速落地，从华为代表的电子、通讯行业延伸到汽车、工业、家电和医疗等其他行业。先进制程的生产线设备是半导体生产的根本，也是中国最受制于人所在。中美对抗博弈可能是一种长期状态，半导体设备的落后现状无法通过进口解决，唯有大力发展国产设备才是摆脱受制于人的根本之道。另一方面，由于疫情等因素对半导体生产端的影响，以及 5G 新技术带来需求上升，半导体行业整体处于供给收缩与需求提升的强上升周期阶段。我们认为在这种背景下，国产半导体芯片以及半导体设备企业将会迎来显著的订单增长阶段，从而迎来估值与业绩增长双重驱

动的投资机会。

(4) 云计算：云计算作为 IT 服务的新商业模式，是未来确定性最强的市场方向。从需求角度看，云服务可以显著的降低企业 IT 支出成本，企业 IT 系统可以更加迅速的方式部署，且可以获得更大的弹性，IT 系统可以随业务发展而按需灵活配置；从供给角度看，云服务因为降低 IT 系统使用门槛因而能够获得更多长尾客户，订阅与预付费的商业模式可以提升客户粘性并改善 IT 企业的现金流量表和资产负债表，不断迭代更新的云服务产品可及时向所有客户同时推广可以让云服务提供商在长期获得更多的生产者剩余，这些因素均将使得成功云转型的企业获得更高的估值溢价。因此，云服务转型几乎成为所有 IT 企业追求的终极目标，国内外莫不如此。在成熟的欧美市场，从 IAAS 到 PAAS、SAAS，均已经涌现出一大批数百亿甚至千亿美金市值的企业。我们相信，中国的 IT 服务市场也将沿着相同路径发展。在庞大的中国市场，勤劳的中国企业家一定会持续创造伟大的云服务企业。云服务能否成功转型与 IT 企业在所处细分领域的地位密切相关，我们将重点配置在传统 IT 服务模式已经建立稳固市场地位的龙头企业，同时我们也会积极关注在新兴领域已经取得显著领先优势的云服务企业进行投资。

(5) 消费电子：智能手机终端的爆发开始于 3G 通信技术，我们相信 5G 技术会产生相同效果，将带来下一代智能终端——VR/AR 的爆发。我们预期今年 Facebook Oculus Quest 可以达到千万量级的销量，苹果公司也将推出相关设备，会进一步引爆市场。A 股消费电子产业链公司在受手机销量增长放缓背景下，正处于相对的估值洼地。VR 产业链与传统手机产业链相似度较高，因此智能手机产业链依然有巨大机会在 VR 时代迎来新的增长曲线。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：宝盈智慧生活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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	119,516,596.65
结算备付金		1,020,703.62
存出保证金		22,863.97
交易性金融资产	6.4.7.2	173,614,362.99
其中：股票投资		173,614,362.99
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		1,529,995.45
应收利息	6.4.7.5	12,750.81
应收股利		-
应收申购款		3,977,812.08
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		299,695,085.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负 债：		
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		-
应付赎回款		20,840,179.11
应付管理人报酬		332,529.07
应付托管费		55,421.51
应付销售服务费		33,986.27
应付交易费用	6.4.7.7	219,380.23
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	34,198.87
负债合计		21,515,695.06
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	242,119,115.81
未分配利润	6.4.7.10	36,060,274.70
所有者权益合计		278,179,390.51
负债和所有者权益总计		299,695,085.57

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，宝盈智慧生活混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.1493 元，基金份额总额 143,424,266.50 份；宝盈智慧生活混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.1484 元，基金份额总额 98,694,849.31 份。宝盈智慧生活混合型证券投资基金份额总额合计为 242,119,115.81 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈智慧生活混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 20 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 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		39,478,138.30
1.利息收入		313,934.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	193,162.95
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		120,771.32
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,210,194.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,086,602.58
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	123,591.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	29,775,204.42
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	178,805.09
减：二、费用		1,412,363.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	819,670.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	136,611.79
3. 销售服务费		92,409.65
4. 交易费用	6.4.7.19	346,202.68
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	17,468.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,065,774.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,065,774.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈智慧生活混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 20 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 4 月 20 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）	299,021,630.58	-	299,021,630.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,065,774.62	38,065,774.62
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）	-56,902,514.77	-2,005,499.92	-58,908,014.69
其中：1.基金申购款	54,123,296.71	4,026,314.13	58,149,610.84
2. 基金赎回款	-111,025,811.48	-6,031,814.05	-117,057,625.53
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)	242,119,115.81	36,060,274.70	278,179,390.51

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：

<u>杨凯</u>	<u>张献锦</u>	<u>何瑜</u>
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

宝盈智慧生活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]3456 号《关于准予宝盈智慧生活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《宝盈智慧生活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 298,900,109.45 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 0382 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈智慧生活混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 299,021,630.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 121,521.13 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《宝盈智慧生活混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈智慧生活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、销售服务费等收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为宝盈智慧生活混合 A;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为宝盈智慧生活混合 C。宝盈智慧生活混合 A 和宝盈智慧生活混合 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《宝盈智慧生活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%,投资于智慧生活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 800 指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 20%+商业银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 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》、《宝盈研究精选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 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的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 4 月 20 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 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

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[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费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	119,516,596.65
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：	119,516,596.65

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	143,839,158.57	173,614,362.99	29,775,204.42
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	143,839,158.57	173,614,362.99	29,775,204.42

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,919.07
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	818.81
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	12.93
合计	12,750.81

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	219,380.23
银行间市场应付交易费用	—
合计	219,380.23

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	17,323.51
应付证券出借违约金	-
预提费用	16,875.36
合计	34,198.87

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈智慧生活混合 A		
项目	本期 2021 年 4 月 20 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	158,316,872.75	158,316,872.75
本期申购	24,840,892.72	24,840,892.72
本期赎回(以“-”号填列)	-39,733,498.97	-39,733,498.97
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	143,424,266.50	143,424,266.50

金额单位：人民币元

宝盈智慧生活混合 C		
项目	本期 2021 年 4 月 20 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	140,704,757.83	140,704,757.83
本期申购	29,282,403.99	29,282,403.99
本期赎回(以“-”号填列)	-71,292,312.51	-71,292,312.51
本期末	98,694,849.31	98,694,849.31

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈智慧生活混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	5,216,603.56	17,804,820.08	23,021,423.64
本期基金份额交易产生的变动数	-331,603.40	-1,275,960.51	-1,607,563.91
其中：基金申购款	432,816.73	1,420,161.65	1,852,978.38

基金赎回款	-764,420.13	-2,696,122.16	-3,460,542.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,885,000.16	16,528,859.57	21,413,859.73

单位：人民币元

宝盈智慧生活混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	3,073,966.64	11,970,384.34	15,044,350.98
本期基金份额交易产生的变动数	204,975.98	-602,911.99	-397,936.01
其中：基金申购款	453,521.15	1,719,814.60	2,173,335.75
基金赎回款	-248,545.17	-2,322,726.59	-2,571,271.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,278,942.62	11,367,472.35	14,646,414.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	90,779.59
定期存款利息收入	95,833.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,367.80
其他	182.23
合计	193,162.95

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	56,412,701.58
减：卖出股票成本总额	47,326,099.00
买卖股票差价收入	9,086,602.58

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 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 4 月 20 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	123,591.94
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	123,591.94

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 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	29,775,204.42
——股票投资	29,775,204.42
——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	29,775,204.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	178,800.54
基金转换费收入	4.55

合计	178,805.09
----	------------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	346,202.68
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	346,202.68

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	16,875.36
信息披露费	—
证券出借违约金	—
银行汇划费用	593.38
合计	17,468.74

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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须披露的资产负债表日后事项。

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、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东

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 4 月 20 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	819,670.82
其中：支付销售机构的客户维护费	323,313.09

注：1、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 1.50%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 4 月 20 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 20 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	136,611.79

注：1、支付基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 4 月 20 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 4 月 20 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		
	宝盈智慧生活混合 A	宝盈智慧生活混合 C	合计
招商银行	0.00	16,918.23	16,918.23
宝盈基金公司	0.00	10,459.20	10,459.20
合计	0.00	27,377.43	27,377.43

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日宝盈智慧生活 C 的基金资产净值 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：日基金销售服务费=前一日宝盈智慧生活 C 的基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2021 年 4 月 20 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

本基金本报告期间及上年度可比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

份额单位：份

宝盈智慧生活混合 A		
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中国对外经济贸易信托有限公司	988,187.29	0.69%

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 4 月 20 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
招商银行	119,516,596.65	90,779.59

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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（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
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	-
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	-
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	-
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	-

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票，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票，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，锁定期限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招商银行股份有限公司，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公司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	119,516,596.65	-	-	-	119,516,596.65
结算备付金	1,020,703.62	-	-	-	1,020,703.62
存出保证金	22,863.97	-	-	-	22,863.97
交易性金融资产	-	-	-	173,614,362.99	173,614,362.99
应收证券清算款	-	-	-	1,529,995.45	1,529,995.45
应收利息	-	-	-	12,750.81	12,750.81
应收申购款	-	-	-	3,977,812.08	3,977,812.08
其他资产	-	-	-	8.58	8.58
资产总计	120,560,164.24	-	-	179,134,929.91	299,695,094.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,840,179.11	20,840,179.11

应付管理人报酬	-	-	-	332,529.07	332,529.07
应付托管费	-	-	-	55,421.51	55,421.51
应付销售服务费	-	-	-	33,986.27	33,986.27
应付交易费用	-	-	-	219,380.23	219,380.23
其他负债	-	-	-	34,207.45	34,207.45
负债总计	-	-	-	21,515,703.64	21,515,703.64
利率敏感度缺口	120,560,164.24	-	-	157,619,226.27	278,179,390.51

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	-	38,801,596.16	-	38,801,596.16
资产合计	-	38,801,596.16	-	38,801,596.16
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	-	38,801,596.16	-	38,801,596.16

6.4.13.4.2.2 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%	1,940,079.81
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-1,940,079.81

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 50%，投资于智慧生活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	173,614,362.99	62.41
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	173,614,362.99	62.41

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	173,614,362.99	57.93
	其中：股票	173,614,362.99	57.93
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	120,537,300.27	40.22
8	其他各项资产	5,543,422.31	1.85
9	合计	299,695,085.57	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 38,801,596.16 元，占净值比为 13.95%。

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	108,638,358.94	39.05
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	17,939.46	0.01
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	14,430,338.40	5.19
J	金融业	11,702,095.20	4.21
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	134,812,766.83	48.46

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	12,393,332.35	4.46
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	15,960,667.33	5.74
I 电信服务	10,447,596.48	3.76
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	38,801,596.16	13.95

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	300750	宁德时代	39,000	20,857,200.00	7.50
2	300496	中科创达	91,800	14,418,108.00	5.18
3	002241	歌尔股份	317,200	13,557,128.00	4.87
4	002371	北方华创	45,300	12,565,314.00	4.52
5	002920	德赛西威	111,800	12,306,944.00	4.42
6	300059	东方财富	356,880	11,702,095.20	4.21
7	00700	腾讯控股	21,500	10,447,596.48	3.76
8	002812	恩捷股份	44,500	10,417,450.00	3.74
9	603290	斯达半导	25,500	8,160,000.00	2.93
10	002709	天赐材料	74,000	7,886,920.00	2.84
11	02382	舜宇光学科技	34,200	6,983,381.17	2.51
12	03690	美团-W	26,000	6,931,559.23	2.49
13	603501	韦尔股份	20,300	6,536,600.00	2.35

14	688037	芯源微	36,862	5,492,438.00	1.97
15	03606	福耀玻璃	120,000	5,461,773.12	1.96
16	601012	隆基股份	52,500	4,664,100.00	1.68
17	00268	金蝶国际	211,000	4,626,239.99	1.66
18	00968	信义光能	312,000	4,351,046.17	1.56
19	300274	阳光电源	27,000	3,106,620.00	1.12
20	300077	国民技术	188,700	3,015,426.00	1.08
21	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
22	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
23	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
24	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
25	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
26	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
27	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	300750	宁德时代	14,730,009.38	5.30
2	300496	中科创达	12,465,767.96	4.48
3	002241	歌尔股份	12,023,229.00	4.32
4	002920	德赛西威	11,305,471.88	4.06
5	00700	腾讯控股	10,951,627.72	3.94
6	002371	北方华创	10,237,571.00	3.68
7	300059	东方财富	9,879,611.20	3.55
8	02382	舜宇光学科技	9,538,621.98	3.43
9	03606	福耀玻璃	9,450,896.95	3.40
10	002812	恩捷股份	7,774,973.92	2.79
11	688396	华润微	7,504,413.78	2.70
12	002460	赣锋锂业	7,464,730.00	2.68
13	688037	芯源微	7,146,388.98	2.57
14	03690	美团-W	6,809,003.07	2.45
15	002709	天赐材料	6,655,370.70	2.39
16	603290	斯达半导	5,924,661.00	2.13
17	603501	韦尔股份	5,699,252.00	2.05

18	00268	金蝶国际	4,964,660.92	1.78
19	601012	隆基股份	4,098,018.65	1.47
20	002008	大族激光	3,992,587.00	1.44

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，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	688396	华润微	10,583,742.82	3.80
2	002460	赣锋锂业	9,603,154.71	3.45
3	03606	福耀玻璃	4,910,110.78	1.77
4	02382	舜宇光学科技	4,323,670.86	1.55
5	002008	大族激光	4,018,376.01	1.44
6	688037	芯源微	3,986,419.02	1.43
7	002371	北方华创	3,922,151.00	1.41
8	688111	金山办公	3,857,759.76	1.39
9	688536	思瑞浦	3,675,876.37	1.32
10	688113	联测科技	3,411,605.85	1.23
11	002906	华阳集团	2,576,445.20	0.93
12	603290	斯达半导	1,385,476.00	0.50
13	301015	百洋医药	157,913.20	0.06

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，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	191,165,257.57
卖出股票收入（成交）总额	56,412,701.58

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，本基金在履行适当程序后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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

1、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；

2、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；

3、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的经营者集中。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	22,863.97
2	应收证券清算款	1,529,995.45
3	应收股利	-
4	应收利息	12,750.81
5	应收申购款	3,977,812.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,543,422.31

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
宝盈智慧生活混合 A	2,775	51,684.42	988,187.29	0.69%	142,436,079.21	99.31%
宝盈智慧生活混合 C	20,934	4,714.57	0.00	0.00%	98,694,849.31	100.00%
合计	23,709	10,212.12	988,187.29	0.41%	241,130,928.52	99.59%

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	宝盈智慧生活混合 A	194,829.59	0.1358%
	宝盈智慧生活混合 C	1,724,794.06	1.7476%
	合计	1,919,623.65	0.7928%

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	宝盈智慧生活混合 A	0
	宝盈智慧生活混合 C	0~10

有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈智慧生活混合 A	0
	宝盈智慧生活混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈智慧生活混合 A	宝盈智慧生活混合 C
基金合同生效日（2021 年 4 月 20 日） 基金份额总额	158,316,872.75	140,704,757.83
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	24,840,892.72	29,282,403.99
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	39,733,498.97	71,292,312.51
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	143,424,266.50	98,694,849.31

§ 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、托管人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	
光大证券	2	86,018,617.59	34.76%	78,389.61	35.73%	-
东方财富证券	2	69,784,479.18	28.20%	63,594.36	28.99%	-
申万宏源证券	2	34,791,069.98	14.06%	27,832.70	12.69%	-
方正证券	2	25,029,954.56	10.12%	22,810.24	10.40%	-
海通证券	2	20,124,683.77	8.13%	16,099.74	7.34%	-
中金公司	1	11,690,580.88	4.72%	10,653.58	4.86%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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）新租国信证券上海、深圳交易单元各一个。新租招商证券深圳交易单元一个。新租海通证券上海、深圳交易单元各一个。新租申万宏源证券上海、深圳交易单元各一个。新租中金公司深圳交易单元一个。新租光大证券上海、深圳交易单元各一个。新租兴业证券上海交易单元一个。新租中信证券深圳交易单元一个。新租中银国际证券上海交易单元一个。新租华创证券深圳交易单元一个。新租东北证券深圳交易单元一个。新租方正证券上海、深圳交易单元各一个。新租东方财富证券上海、深圳交易单元各一个。

（2）本报告期内未退租交易单元。

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
光大证券	-	-	222,300,000.00	100.00%	-	-

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
2	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
3	宝盈智慧生活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	上海证券报, 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 18 日
4	宝盈智慧生活混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报, 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 21 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	关于宝盈智慧生活混合型证券投资基金延长募集时间的公告	上海证券报, 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 29 日
9	关于宝盈智慧生活混合型基金增加代销机构的公告	上海证券报, 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 16 日
10	宝盈智慧生活混合型证券投资基金(宝盈智慧生活混合 A 份额)基金产品资料概要	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 24 日
11	宝盈智慧生活混合型证券投资基金(宝盈智慧生活混合 C 份额)基金产品资料概要	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 24 日
12	宝盈智慧生活混合型证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报, 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 24 日

13	宝盈智慧生活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 24 日
14	宝盈智慧生活混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2021 年 2 月 24 日
15	宝盈智慧生活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 24 日
16	宝盈智慧生活混合型证券投资基金招募说明书	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 24 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

中国证监会准予宝盈智慧生活混合型证券投资基金注册的文件；

《宝盈智慧生活混合型证券投资基金基金合同》；

《宝盈智慧生活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

基金托管人办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

12.3 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 8 月 31 日