

宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金 2021年第3季度报告

2021年9月30日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈科技 30 混合
基金主代码	000698
交易代码	000698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 13 日
报告期末基金份额总额	367,216,054.06 份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于以科技创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%
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，属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	248,183,645.75
2. 本期利润	50,440,712.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1295
4. 期末基金资产净值	1,410,976,865.81
5. 期末基金份额净值	3.842

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

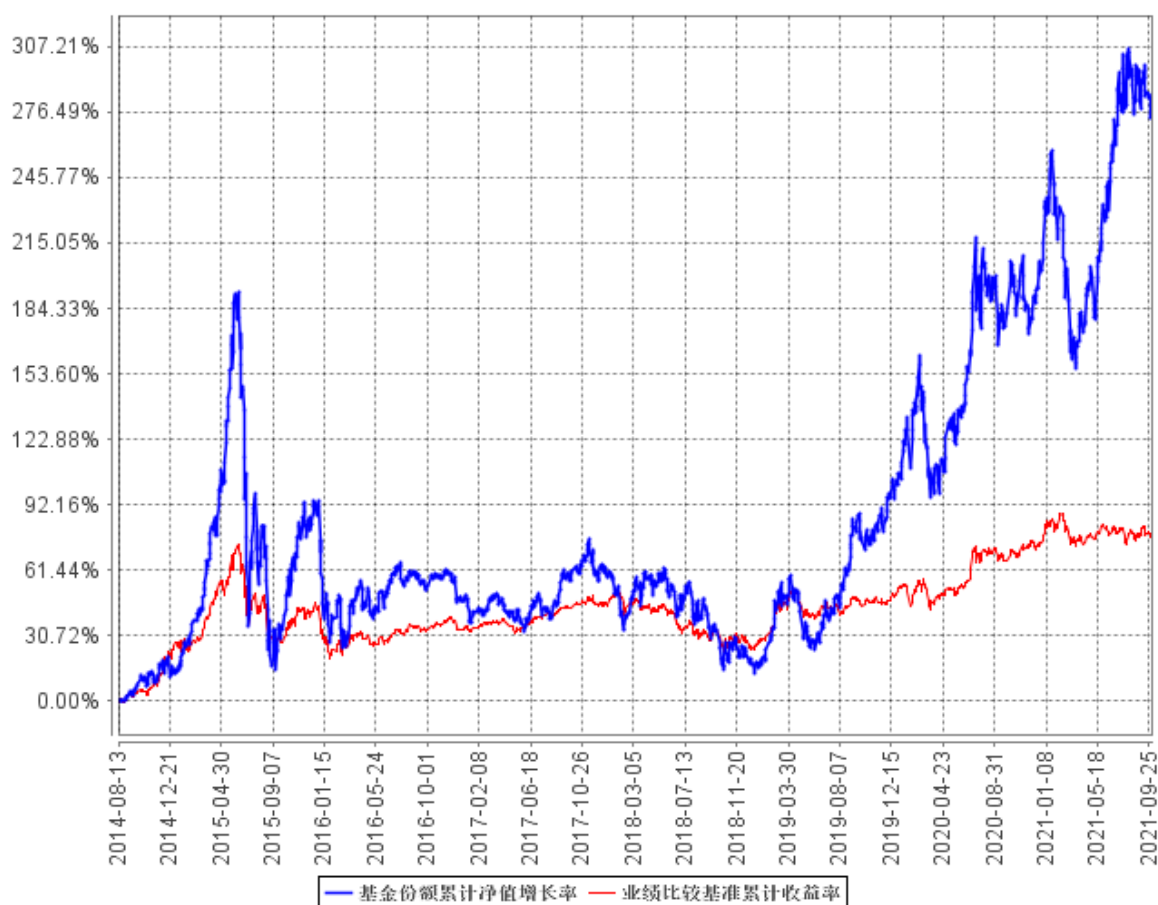
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	2.95%	1.75%	-1.89%	0.66%	4.84%	1.09%
过去六个月	42.93%	1.78%	1.39%	0.60%	41.54%	1.18%
过去一年	35.95%	1.89%	7.26%	0.68%	28.69%	1.21%
过去三年	188.66%	2.00%	33.16%	0.80%	155.50%	1.20%
过去五年	149.16%	1.78%	33.24%	0.71%	115.92%	1.07%
自基金合同 生效起至今	284.20%	2.11%	77.88%	0.90%	206.32%	1.21%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张仲维	本基金、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、宝盈智	2016年9月21日	-	11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。

	慧生活混合型证券投资基金、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				
赵国进	本基金基金经理	2020年11月11日	-	8年	赵国进先生，南开大学精算学硕士。曾任天津灵杰科技有限公司软件研发工程师，广发证券股份有限公司证券分析师，中国国际金融股份有限公司证券分析师，2015年12月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年三季度，沪深300指数下跌6.85%，创业板指数下跌6.69%。随着上市公司半年报业

绩的披露，业绩兑现较好的优质标的出现快速反弹，同时以新能源和半导体为代表的高景气度行业整体业绩实现超预期增长、行业内优质公司涨幅较大。进入三季度，上游资源品价格上涨明显，导致中下游行业面临盈利收窄的风险，在滞涨风险担忧之下，整体市场出现震荡下行。行业上来看（以中信一级行业），三季度涨幅最大的为煤炭和有色金属板块，分别上涨 40.87%和 26.63%；跌幅较大的行业为医药和消费者服务板块，分别下跌 14.67%和 17.89%。

本基金主要投资科技行业中高增长的公司。本基金在报告期内小幅增长，主因是我们前期看好的智能汽车供应链及半导体行业在三季度初延续了二季度的上涨，同时本基金在三季度对仓位进行了适当的调减操作。报告期内本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。我们认为新能源行业作为全球产业重大趋势（包含新能源汽车和光伏）持续维持高速增长，除中国以外，欧洲、美国等国家也在大力推动行业的发展，这保证了行业未来的成长空间和成长速度，并且中国优质上市公司有望在全球范围内获得更高市场份额，这将保证重仓个股业绩有望持续高速增长。此外汽车电子、智能驾驶和半导体也都是未来长周期的产业趋势，相关优质公司将充分享受行业红利。因此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的增长能消化较高的估值，终将实现股价的上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.842 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.95%，业绩比较基准收益率为-1.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,148,781,398.48	81.09
	其中：股票	1,148,781,398.48	81.09
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	265,807,674.42	18.76
8	其他资产	2,108,301.45	0.15
9	合计	1,416,697,374.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	953,820,788.50	67.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	69,676.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,184,985.30	5.40
J	金融业	83,212,519.60	5.90
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	13,847,794.84	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	46,710.78	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	21,536,647.20	1.53
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,148,781,398.48	81.42

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	254,800	133,956,004.00	9.49
2	002709	天赐材料	842,715	128,193,805.80	9.09
3	002371	北方华创	304,100	111,206,329.00	7.88
4	300059	东方财富	2,421,080	83,212,519.60	5.90

5	002241	歌尔股份	1,804,800	77,786,880.00	5.51
6	002920	德赛西威	918,068	77,191,157.44	5.47
7	300496	中科创达	607,679	76,075,334.01	5.39
8	300274	阳光电源	376,987	55,937,331.06	3.96
9	601689	拓普集团	1,364,006	49,704,378.64	3.52
10	601012	隆基股份	563,524	46,479,459.52	3.29

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告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投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	389,743.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55,425.82
5	应收申购款	1,663,131.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,108,301.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	430,007,440.33
报告期期间基金总申购份额	44,110,906.91
减：报告期期间基金总赎回份额	106,902,293.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	367,216,054.06

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈科技 30 灵活配置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。

9.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日