

宝盈睿丰创新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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券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	宝盈睿丰创新混合	
基金主代码	000794	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 月 26 日	
报告期末基金份额总额	65,177,624.93 份	
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点关注具备持续创新能力的上市公司，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	沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%	
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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C
下属分级基金的交易代码	000794	000796
下属分级基金的前端交易代码	000794	-
下属分级基金的后端交易代码	000795	-

报告期末下属分级基金的份额总额	40,499,304.81 份	24,678,320.12 份
-----------------	-----------------	-----------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）	
	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C
1. 本期已实现收益	11,125,482.39	11,229,849.79
2. 本期利润	-520,170.44	3,591,679.75
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0188	0.1453
4. 期末基金资产净值	121,887,246.05	66,105,223.33
5. 期末基金份额净值	3.010	2.679

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈睿丰创新混合 A/B

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	5.13%	2.17%	-4.13%	0.78%	9.26%	1.39%
过去六个月	28.91%	2.01%	-1.75%	0.71%	30.66%	1.30%
过去一年	28.85%	1.98%	5.11%	0.79%	23.74%	1.19%
过去三年	175.14%	1.90%	29.42%	0.87%	145.72%	1.03%
过去五年	87.66%	1.75%	33.36%	0.77%	54.30%	0.98%
自基金合同生效起至今	201.00%	2.01%	68.79%	0.98%	132.21%	1.03%

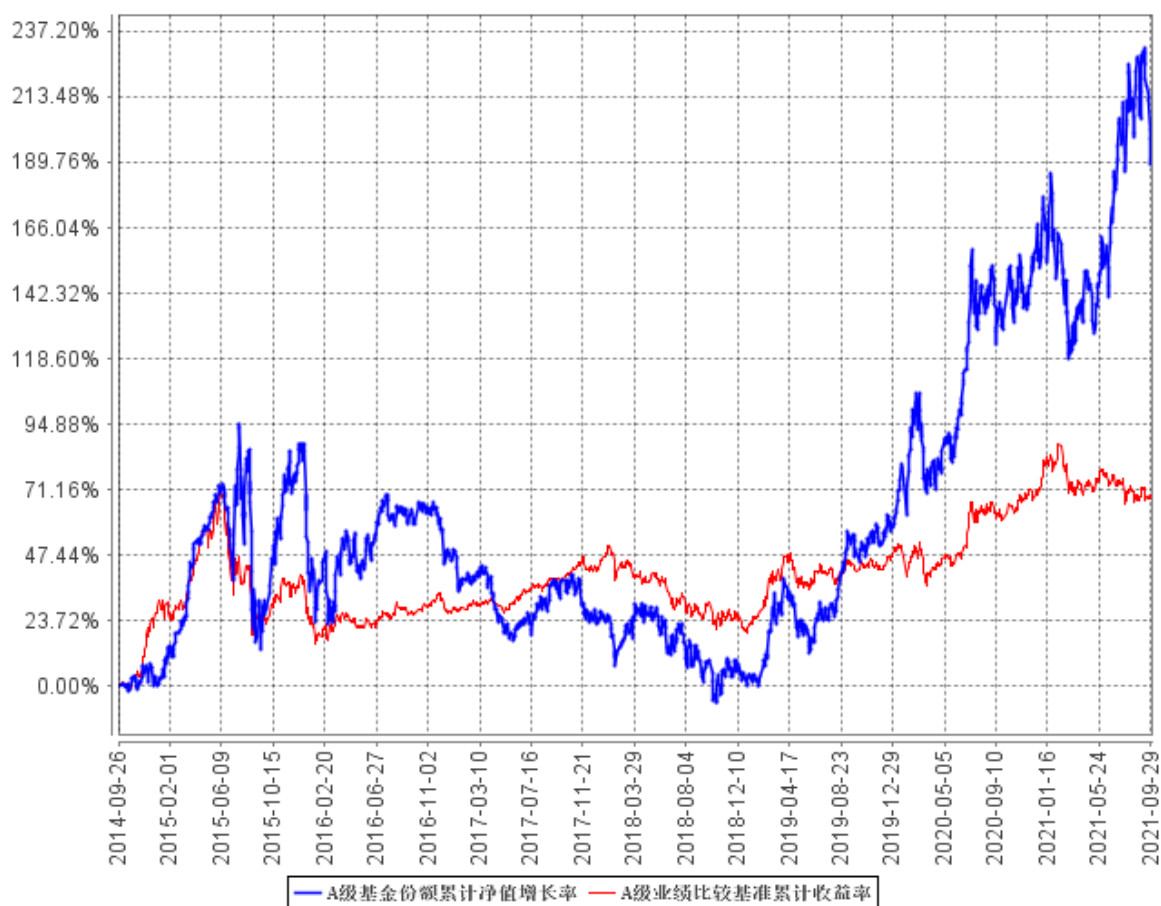
宝盈睿丰创新混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.89%	2.17%	-4.13%	0.78%	9.02%	1.39%
过去六个月	28.37%	2.01%	-1.75%	0.71%	30.12%	1.30%
过去一年	27.81%	1.98%	5.11%	0.79%	22.70%	1.19%
过去三年	168.71%	1.90%	29.42%	0.87%	139.29%	1.03%

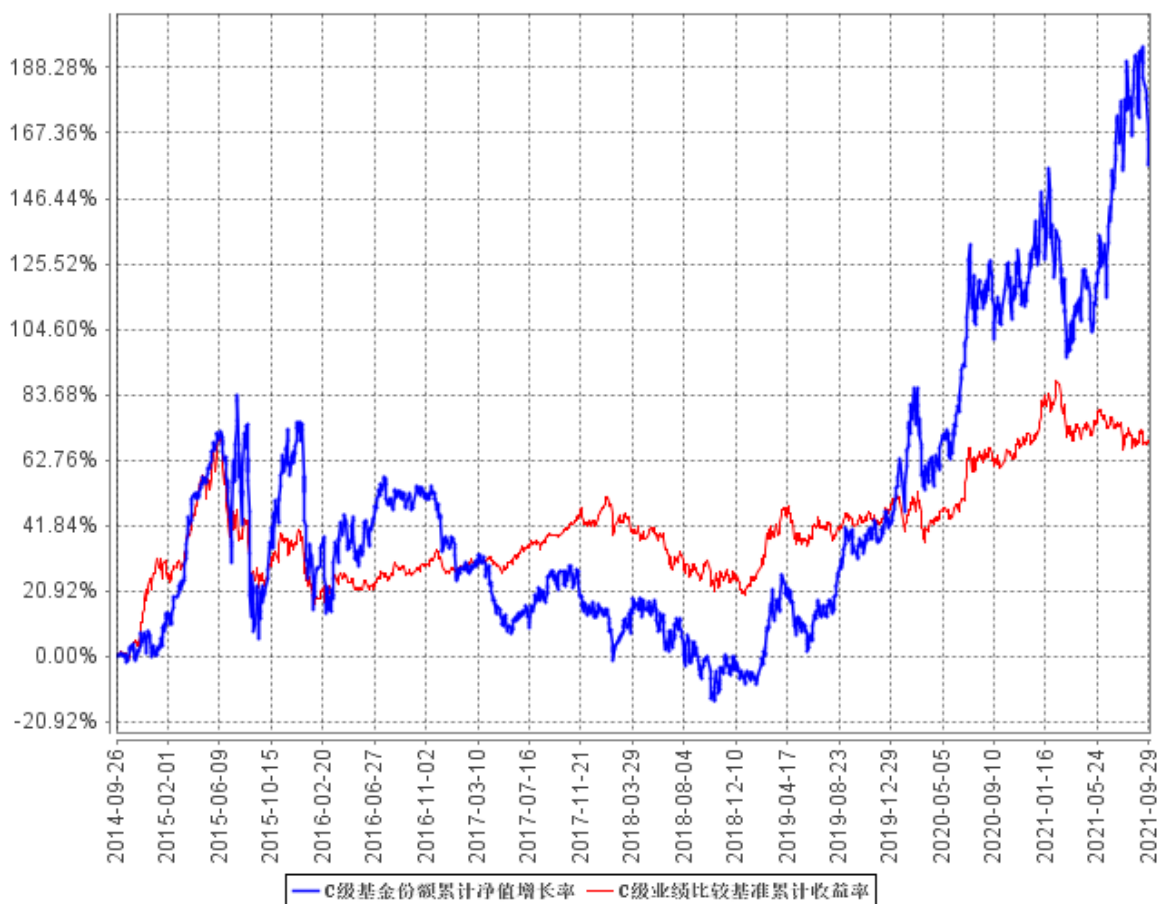
过去五年	80.28%	1.75%	33.36%	0.77%	46.92%	0.98%
自基金合同生效起至今	167.90%	2.01%	68.79%	0.98%	99.11%	1.03%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
朱建明	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金的基金经理；投资经理	2017年1月5日	-	11年	朱建明先生，中国人民银行研究生部金融学硕士。2010年7月至2011年3月任职于瀚信资产管理有限公司，担任研究员；自2011年5月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理、宝盈策略增长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。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
朱建明	公募基金	3	2,360,264,047.91	2017-01-05
	私募资产管理计划	4	229,543,569.74	2014-08-18
	其他组合	-	-	-
	合计	7	2,589,807,617.65	-

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 年三季度市场呈现结构性行情特征，成长主线电动车、半导体等先涨后跌，周期板块持续大幅走强。前期估值大幅回调的核心资产迎来小幅回升。

本基金投资方向主要为科技创新和产业升级，总体上三季度仓位略有下降，对长期深度研究和持续看好的新成长方向如汽车电动化智能化方向，仍然坚持主要配置，从中期角度增加了竞争格局较好的材料环节标的，减仓了医药 CDMO 和化妆品。目前行业分布仍然在电动车、智能化、机械、新材料等领域。

如果投资者长期跟踪我们基金的投资风格和业绩报告，会发现我们并不擅长风格择时与板块轮动，而是习惯于前瞻性的思考、系统性的学习、大容量的产业调研与公司交流，坚持长期投资。

过去几年坚定重仓创新药、医药 CDMO、电动车、云计算、化妆品等赛道龙头获得了较好的回报。

过去几年我们的报告中始终强调科技创新类资产的景气上行、宏观政策鼓励的方向与资本市场改革的导向等这些总量因素。在这个赛道思维已然流行、投资者言必称核心资产与电动车的新形势下，我们过往坚持的风格可能面临较大的挑战，特别是九月以来，以能耗双控、限电限产为代表的外部冲击加剧了对经济的扰动，从经济周期的角度，可能正处于衰退初期，权益资产投资可能面临一个较为复杂和困难的局面。从长期来看，必须重新审视和思考，如何思维进阶才能在下一阶段获取超额收益。我们认为在产业升级的基础上，更为细致的产业细分研究和企业综合竞争力评估，坚定拥抱“参与全球竞争的未来冠军”，聚焦“新材料、新能源、新制造”等方向，才能为投资者创造超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈睿丰创新混合 A/B 基金份额净值为 3.010 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.13%；截至本报告期末宝盈睿丰创新混合 C 基金份额净值为 2.679 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.89%；同期业绩比较基准收益率为-4.13%。

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	171,935,861.93	87.10
	其中：股票	171,935,861.93	87.10
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	24,432,851.95	12.38
8	其他资产	1,024,447.16	0.52

9	合计	197,393,161.04	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	171,797,884.18	91.39
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	60,468.58	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	20,370.76	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	12,979.75	0.01
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	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	171,935,861.93	91.46

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	300037	新宙邦	117,491	18,211,105.00	9.69
2	002074	国轩高科	359,376	17,066,766.24	9.08
3	300487	蓝晓科技	229,800	16,865,022.00	8.97
4	300568	星源材质	364,592	16,424,869.60	8.74
5	688499	利元亨	67,506	16,403,958.00	8.73
6	688700	东威科技	272,469	15,585,226.80	8.29
7	688388	嘉元科技	87,628	12,452,815.08	6.62
8	002913	奥士康	110,500	9,386,975.00	4.99
9	300263	隆华科技	903,000	8,713,950.00	4.64
10	300620	光库科技	97,194	6,200,977.20	3.30

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	193,535.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,213.90
5	应收申购款	826,697.27
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,024,447.16

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

项目	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C
报告期期初基金份额总额	16,140,571.57	26,849,329.79
报告期期间基金总申购份额	28,478,528.27	6,250,347.11
减：报告期期间基金总赎回份额	4,119,795.03	8,421,356.78
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	40,499,304.81	24,678,320.12

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 08 月 16 日-2021 年 09 月 30 日	-	25,583,306.68	-	25,583,306.68	39.25%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,在极端情况下可能存在流动性等风险,敬请投资人留意。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈睿丰创新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：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼

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