

# 宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

## 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	宝盈国家安全沪港深股票
基金主代码	001877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	523,027,236.20 份
投资目标	本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略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金融衍生品投资策略四部分组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，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，并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服务；（3）信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济</p>

	<p>周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。</p> <p>（三）固定收益类资产投资策略</p> <p>在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。</p> <p>（四）金融衍生品投资策略</p> <p>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。	
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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。</p> <p>本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p>	
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	
下属分级基金的基金简称	宝盈国家安全沪港深股票 A	宝盈国家安全沪港深股票 C
下属分级基金的交易代码	001877	013613
报告期末下属分级基金的份额总额	522,764,694.31 份	262,541.89 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）	
	宝盈国家安全沪港深股票 A	宝盈国家安全沪港深股票 C
1. 本期已实现收益	33,047,971.24	390.22
2. 本期利润	3,504,481.32	2,298.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0177	0.0333
4. 期末基金资产净值	876,282,797.63	440,112.47
5. 期末基金份额净值	1.6762	1.6764

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。

4、本基金于 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈国家安全沪港深股票 C”。

#### 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

宝盈国家安全沪港深股票 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	18.71%	1.65%	-6.60%	0.98%	25.31%	0.67%
过去六个月	44.38%	1.40%	-4.16%	0.87%	48.54%	0.53%
过去一年	44.50%	1.55%	5.30%	0.94%	39.20%	0.61%
过去三年	112.99%	1.64%	28.69%	1.04%	84.30%	0.60%
过去五年	42.41%	1.55%	36.85%	0.92%	5.56%	0.63%
自基金合同生效起至今	67.62%	1.49%	41.53%	0.92%	26.09%	0.57%

宝盈国家安全沪港深股票 C

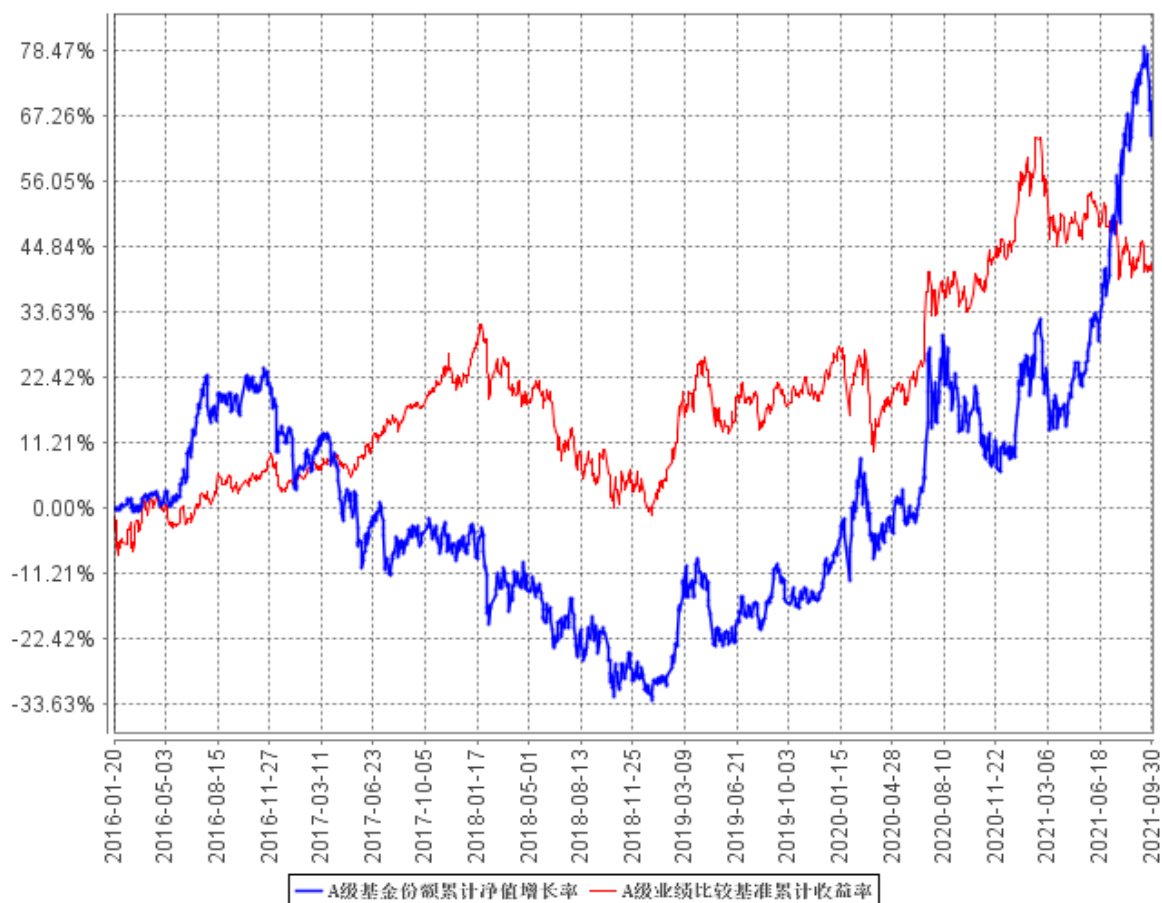
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-2.69%	2.75%	0.39%	0.51%	-3.08%	2.24%

注：本基金于 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈国家安全沪港深

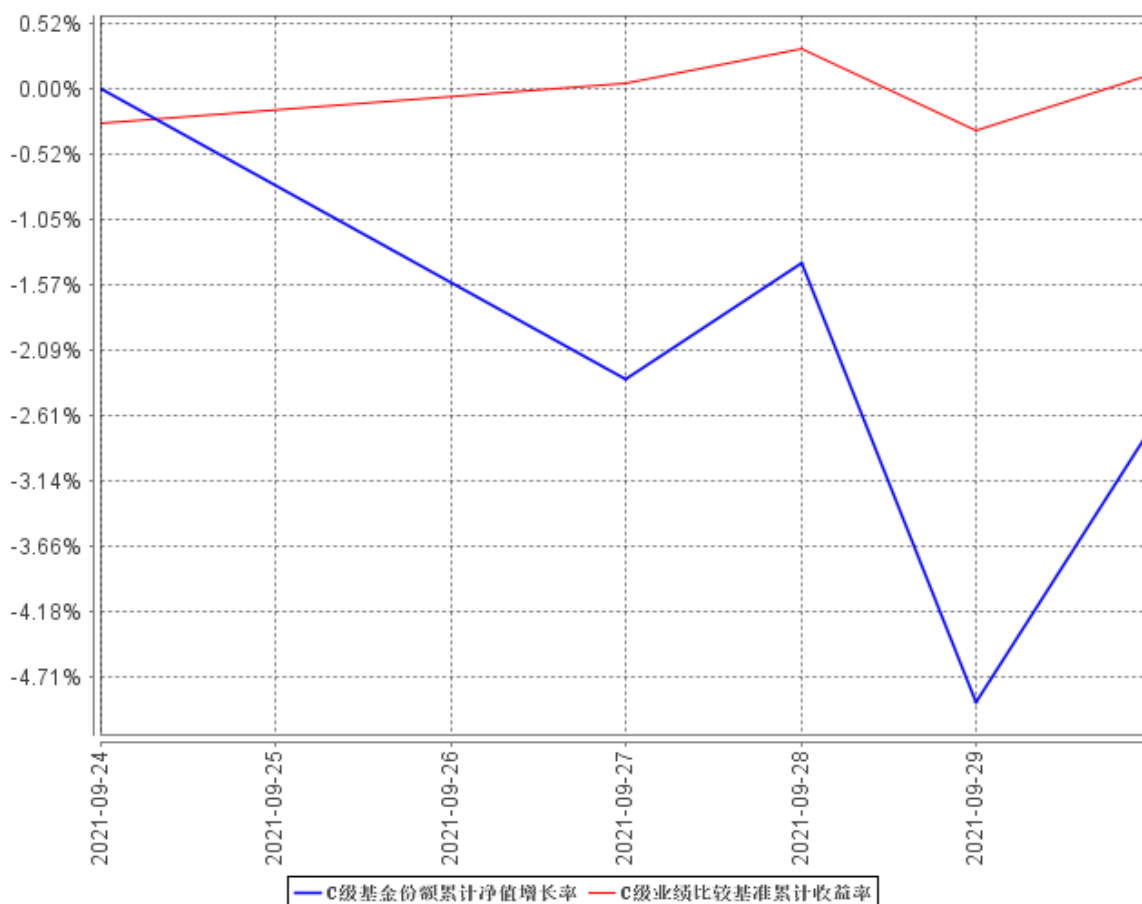
股票 C”。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈国家安全沪港深股票 C”。

## § 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		
陈金伟	本基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 11 月 21 日	-	7 年	陈金伟先生，北京大学金融学硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司研究员，2015 年 2 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、投资经理。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

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

绝大部分基于基本面的投资大体可以分为三个要素：估值、景气度、公司质地。对应的是深度价值策略、趋势（产业趋势）投资、以及成长投资策略，假设每个投资者总共有 100 分，需要将 100 分分配给这三个要素。极度看重产业趋势的投资者，会把大部分分数给产业趋势，选出来的标的多属于新兴行业；深度价值投资者会特别看重估值的重要性；成长投资策略会特别强调好生意好公司、长坡厚雪的重要性。从我们的角度，我们愿意把 50 分给好公司，40 分给低估值，10 分给产业趋势。

首先，我们是成长股投资，投资的是扩张的行业和公司，并且我们相信优秀公司的力量，只不过我们对于优秀公司的定义不限于核心资产，所有治理结构完善，对小股东相对友好、在细分行业内具有竞争力，行业天花板没有见顶并且持续扩张的公司都在我们的选股范围中。

其次，我们比较看重估值的重要性，估值的重要性在于即使判断出现失误，损失也是有限的，高估值意味着苛刻的假设，这些假设在长时间看来未必是能够实现的，尤其是时间越长，看错的

可能性就越大，我们比较看重估值也是认识到自身研究的局限性，接受自己的不完美。

再次，我们认同产业趋势的价值，产业趋势意味着增量市场空间，在增量市场下，企业更有可能实现扩张避免陷入内卷，但产业趋势确定性不等同于公司的确定性，尤其是确定的产业趋势会带来确定的供给增加，确定的供给增加会冲击现有公司的确定性，因此我们把产业趋势放在相对靠后的位置。

以上三者是有顺序的，我们的顺序是好公司、低估值、产业趋势，分配权重是 50%，40%，10%。

关于景气度（产业趋势），时常被问起“为何不重配某个景气赛道”的问题。首先要强调我们不是逆景气度，或是刻意避开高景气方向，在公司质地及性价比合适的情况下，我们愿意积极参与景气度投资，我们只是不希望单一赛道的景气度上暴露太高的仓位。

“基于景气度的基本面趋势投资”无疑是近三年最成功的投资方法，这种方法是从需求角度先选出景气赛道，再选公司。其假设是只要景气上行，公司业绩就能持续兑现甚至超预期，股价就能持续上行。我们并不怀疑有优秀的投资者能基于此方法在阶段性获利，只是我们认为自身并不具备这种能力，因为这种投资方法积聚了大量的边际交易资金，这些边际交易资金更为关注的与其说是景气度，不如说是“赚钱效应”，因此这个方法可能存在的风险是出现其他更景气的板块，有更强的“赚钱效应”，即某一个景气行业的股价风险一方面来自于其自身景气度波动，另一方面来自于出现其他更景气的行业，这一现象今年已经出现在一些热门景气行业。所以我们认为这种方法实际操作难度可能远比看上去难（尤其拉长时间）。因为“最景气”不等同于“景气”，我们如果对某个行业深入研究，相对容易得出“景气”的结论，但是我们要得出“最景气”的结论，需要对所有行业深入研究并时刻做比较。我们在能力、精力以及在相当多的行业的研究深度方面都无法胜任这种投资方法。

我们认为未来一段时间，从我们的选股策略出发，投资难度相比年初出现较大提升。具体来说，我们面临两大挑战：

1. 短期挑战：今年以来大量优质小盘股估值迅速从低估到合理，使得优质小盘股胜率和赔率兼得的机会显著减少，有时不得不在胜率和赔率之间做取舍。虽然我们的投资范围并不局限于小盘股，但是优质小盘股是我们今年以来超额收益的主要来源。

2. 长期挑战：扩张的规模与完全自下而上选股策略的选股效率之间的矛盾。由于我们是完全自下而上的“翻石头”选股策略，同时我们又非常看重性价比，所以当持仓股票股价上涨的时候，我们需要大量新标的来支撑我们的策略，这种策略很难有很强的规模效应，我们也在尝试利用“挖掘机”来“翻石头”，比如利用量化方法进行初筛，然后再分析基本面等方式，但是量化和基本面本身就在追求共性和追求个性之间存在天然矛盾。我们仍然在寻求最优解决方案中。



坦率地说，我们建议投资者未来一段时间降低对我们选股策略超额收益（相较基准）的预期。但从当前整体估值水平以及资产质量角度，认为市场仍然可为。

因为除了以上挑战，我们也看到三大机会，按照优先级顺序如下：

1. 一部分行业今年以来受到原材料涨价之类的短期因素影响，表现业绩较差，就如同 2020 年受疫情冲击最明显的周期行业和中小型制造业公司是 2021 年前三季度表现最好的资产一样，周期性因素造成的业绩不佳带来的估值业绩双杀，对于长期成长性尚可的公司来说，是一个难得的买点，所以这些今年受损的行业或许是一个“输时间不输钱”的选择。

2. 我们前期看好的中小型制造业公司，虽然整体预期收益率有所下行，但是仍然有挖掘空间，我们仍看好这一领域。不同于主流观点，我们认为优质小盘股在 A 股是长期机会而不是短期机会：首先，A 股现阶段以广义制造业为主导，制造业不同于互联网，其边际成本并非无限趋近于 0，不存在跨行业之间赢家通吃的情况，因而细分行业隐形冠军具有长期投资机会。其次，A 股存在大量的增量行业，集中度提升常见于行业需求放缓甚至下行的阶段，而增量行业远未到终局，在这类充满朝气的行业中，不应该用小学第一次月考的成绩来“盖棺论定”。因此我们认为，仅有“茅指数”上涨的市场并非常态化的市场，不应以市值论英雄，用结果来推导结果，将严谨的投资过程口号化、脸谱化。只不过今年市场又将另一种风格演绎到极致，短期看，每一天的市场都是不理性的，但是拉长看又是非常理性的。在我们看来，市值大小、标的冷门还是热门等因素并非我们选股出发点，组合呈现的市值特征只是结果，我们选股的出发点主要就是两点：（1）企业是否在以一个较快且较持续的速度长大；（2）我们的买入价格。

3. 过去五年被反复证明并且被投资者充分认可的部分医药消费优质龙头公司，估值水平从今年年初的完全缺乏吸引力，到现在变得具有一定吸引力，虽然当前估值水平难言低估，但是如果以 1 年或更长时间维度看应该会有合理的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈国家安全沪港深股票 A 基金份额净值为 1.6762 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.71%，同期业绩比较基准收益率为-6.60%；截至本报告期末宝盈国家安全沪港深股票 C 基金份额净值为 1.6764 元，本报告期（2021 年 9 月 24 日-2021 年 9 月 30 日）基金份额净值增长率为-2.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.39%。

#### 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	780,232,475.27	85.85
	其中：股票	780,232,475.27	85.85
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	110,436,703.44	12.15
8	其他资产	18,212,859.49	2.00
9	合计	908,882,038.20	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	751,728,068.52	85.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,300.53	0.00
F	批发和零售业	159,845.18	0.02
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	-	-
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	168,177.24	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	28,127,850.36	3.21
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	780,232,475.27	88.99

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 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	002049	紫光国微	182,200	37,678,960.00	4.30
2	300811	铂科新材	466,500	36,853,500.00	4.20
3	300870	欧陆通	516,400	36,370,052.00	4.15
4	000301	东方盛虹	1,238,500	34,826,620.00	3.97
5	605066	天正电气	2,564,700	34,649,097.00	3.95
6	300777	中简科技	631,165	34,082,910.00	3.89
7	600984	建设机械	3,406,627	33,623,408.49	3.84
8	002402	和而泰	1,520,700	31,630,560.00	3.61
9	603662	柯力传感	1,347,300	31,365,144.00	3.58
10	603855	华荣股份	1,321,500	28,544,400.00	3.26

#### 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。

### 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。

### 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投资。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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，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。

## 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除建设机械的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2020 年 11 月 14 日，陕西建设机械股份有限公司发布《关于收到行政监管措施决定书的公告》，公司于 2020 年 11 月 12 日收到了中国证券监督管理委员会陕西监管局下发的《关于对陕西建设机械股份有限公司及杨宏军、柴昭一、白海红采取出具警示函措施的决定》（陕证监措施字[2020]32 号），具体内容如下：经查，公司 2015 年至 2017 年少计成本、费用共计 1,829.66 万元，导致利润总额多计 1,829.66 万元；2018 年多计成本、费用 1,216.16 万元，导致利润总额少计 1,216.16 万元。上述事项违反了《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号，以下简称《办法》）第二条第一款的规定。根据《办法》第五十九条的规定，决定对建设机械及杨宏军、柴昭一、白海红采取出具警示函的监管措施。

2020 年 12 月 17 日，上海证券交易所出具了《关于对陕西建设机械股份有限公司及有关责任

人予以通报批评的决定》，主要内容如下：经查明，2015 年 8 月 15 日，陕西建设机械股份有限公司披露公告称，公司以发行股份形式购买上海庞源租赁股份有限公司（以下简称庞源租赁）100% 股权，庞源租赁成为公司全资子公司。作为上市公司重组收购标的，庞源租赁的业绩情况对公司重组交易及后续经营具有重大影响，相关财务数据是投资者获知重组完成后公司发展情况的重要信息来源，也是投资者作出投资决策的主要依据。公司与庞源租赁应当根据客观情况真实、准确、完整地予以披露。但庞源租赁在业绩承诺期内连续 3 年通过少计营业成本的方式虚增业绩，导致公司相关年度财务信息披露不真实、不准确，业绩承诺方也因此未及时补偿公司。公司前述行为违反了《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 2 号——年度报告的内容与格式》《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》和《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.5 条等规定。鉴于上述事实和情节，根据《股票上市规则》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》《上海证券交易所上市公司自律监管规则适用指引第 2 号——纪律处分实施标准》等有关规定，上海证券交易所（以下简称本所）作出如下纪律处分决定：对陕西建设机械股份有限公司、时任董事长杨宏军、重大资产重组交易对方暨时任副董事长柴昭一、时任财务总监兼董事会秘书白海红予以通报批评。

本基金认为，建设机械收购庞源租赁后业绩承诺未完成，披露的营业成本、管理费用、所得税费用一些指标都存在错误，导致柴昭一需业绩补偿款减少。会计差错更正后，柴昭一已履行完毕该业绩补偿义务。目前这些因素对上市公司的负面影响已经消除，不影响公司未来企业价值。

### 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	173,820.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,695.14
5	应收申购款	18,028,344.10
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,212,859.49

### 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	宝盈国家安全沪港深股票 A	宝盈国家安全沪港深股票 C
报告期期初基金份额总额	23,472,190.45	-
报告期期间基金总申购份额	527,288,974.67	262,541.89
减:报告期期间基金总赎回份额	27,996,470.81	-
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	522,764,694.31	262,541.89

## § 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	5,963,029.22
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,963,029.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例(%)	1.14

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2021年8月16日	5,963,029.22	10,001,000.00	-
合计			5,963,029.22	10,001,000.00	

注：上述基金管理人运用固有资金投资本基金交易适用费率为固定费用 1000 元。

## § 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

中国证监会准予宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

### 9.3 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 10 月 27 日