

# 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 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。本年度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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料                              | 8         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 9         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 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              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 4.9 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 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 | 16        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 16        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 45        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 45        |
| 8.3 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       | 46        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 47        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48        |
| 8.6 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      | 49        |
| 8.7 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   | 49        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.8 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 ..... | 49        |
| 8.9 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 .....    | 49        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 9.3 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        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>52</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52        |
| 11.2 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 .....      | 52        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 53        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 54        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>56</b> |
| 12.1 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 .....    | 56        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 56        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>56</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 56        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 57        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 57        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 宝盈祥乐一年持有期混合        |                 |
| 基金主代码           | 010857             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 7 月 21 日    |                 |
| 基金管理人           | 宝盈基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 213,060,998.57 份   |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 宝盈祥乐一年持有期混合 A      | 宝盈祥乐一年持有期混合 C   |
| 下属分级基金的交易代码:    | 010857             | 010858          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 198,353,302.17 份   | 14,707,696.40 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过把握债券、股票市场的投资机会，在严格控制组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 投资策略 | <p>1、债券投资策略</p> <p>本基金以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点，结合估值研究、投资者行为研究，自上而下确定组合整体杠杆率以及货币类、利率类、信用类的债券配置比例。同时，本基金注重微观层面的投资研究及策略，尤其是在信用债券领域，具体投资标的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。本基金采用的投资策略主要包括债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略、流动性管理策略。</p> <p>（1）债券资产配置策略。组合杠杆率及货币类、利率类、信用类债券的配置比例决策主要参考以下几个方面的研究：</p> <p>1）宏观经济变量（包括但不限于宏观经济增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业周期等）、流动性条件、行业基本面等研究；</p> <p>2）利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究；</p> <p>3）宏观流动性环境及货币市场流动性研究；</p> <p>4）大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。</p> <p>（2）行业配置策略。基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法，并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究，本基金以分散化配置模式为基础，实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异，在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上，合理地决定不同行业的配置比例。</p> <p>（3）公司配置策略。基于公司价值研究的重要性，本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况，在充分考虑组合流动性特征的前提下，结合行业周期研究，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，以分散化配置模式为基础策略。</p> <p>（4）流动性管理策略。本策略侧重对组合可质押券的管理。信用债的质押率水平与其基本面存在一定的相关关系。本基金将在基金合同约定的组合杠杆率以及既定债券资产配置策略下的杠杆率范围内，充分考虑发行人基本面的当前</p> |

和未來变化的可能性及趋势，合理配置于不同发行主体所发行的债券。

## 2、信用债投资策略

本基金主要采用外部信用评级和内部信用评级相结合的信用研究体系，研究债券发行主体企业的基本面，以确定债券的实际信用状况。基金管理人内部信用评级体系主要分为定量分析和定性分析，定量分析是根据行业公司财务特征设定阈值，进行财务打分。定性分析包括主体股权结构分析、公司历史分析、行业分析、公司经营分析、公司管理层分析、公司融资及外部支持分析、公司偿债分析等几个部分。其中，经营分析注重公司的获现能力、经营稳定性等，财务分析关注公司的资产质量、隐性债务、财务真实性等方面。

本基金参与信用类债券投资的，其信用评级需在 AA（含）及以上，其中，信用评级为 AAA 的信用类债券投资不低于基金资产净值的 30%，投资于信用评级为 AA+ 的信用类债券占基金资产净值的比例为 0-70%，投资于信用评级为 AA 的信用类债券占基金资产净值的比例为 0-20%。本基金投资的金融债（不含政策性金融债）、次级债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等信用类债券的信用评级参照评级机构出具的债项信用评级；本基金投资的短期融资券、超短期融资券等短期信用类债券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级（不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构），如出现多家评级机构所出具信用评级不同的情况，基金管理人还需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定。

## 3、可转换债券（含可交换债券）投资策略

基于行业研究、公司研究可转债估值模型分析，本基金在一、二级市场投资可转换债券（含可交换债券），主要的投资策略包括行业配置策略、个券精选策略、转股策略、条款博弈策略等。

本基金主动投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的市值合计不超过基金资产净值的 20%。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析、公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 5、股票投资策略

本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

（1）使用定量分析的方法，通过财务和运营数据进行企业价值评估，初步筛选出具备优势的股票作为备选投资标的。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面对股票进行考量。

（2）在定量分析的基础上，基金管理人将深入调研上市公司，并基于公司治理、公司发展战略、基本面变化、竞争优势、管理水平、估值比较和行业景气度趋势等关键因素，评估上市公司的中长期发展前景、成长性和核心竞争力，进一步优化备选投资标的。

### （3）参与定向增发投资策略

基金管理人将通过实地调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息；对定向

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>增发价格的合理性做出判断,并结合上市公司大股东参与定向增发的情况,在进行全面和深入研究的基础上做出投资决定,在控制风险的基础上力求获取较高的收益。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将结合宏观经济状况和发行人所处行业的景气度,关注发行人基本面情况、公司竞争优势、公司治理结构、有关信息披露情况、市场估值等因素,通过定性分析和定量分析相结合的办法,选择投资价值高的存托凭证进行投资,谨慎决定存托凭证的标的选择和配置比例。</p> <p>7、港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将对港股通标的股票进行系统性分析,在采用上述个股精选策略的基础上,结合香港股票市场情况,重点投资于港股通标的股票范围内具备长期成长潜力且估值合理的优质上市公司股票。</p> <p>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险;利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>9、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。</p> <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

### 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               | 中国邮政储蓄银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张磊                       | 田东辉                  |
|         | 联系电话 | 0755-83276688            | 010-68858113         |
|         | 电子邮箱 | zhangl@byfunds.com       | tiantonghui@psbc.com |
| 客户服务电话  |      | 400-8888-300             | 95580                |
| 传真      |      | 0755-83515599            | 010-68858120         |
| 注册地址    |      | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501 | 北京市西城区金融大街 3 号       |
| 办公地址    |      | 广东省深圳市福田区福华              | 北京市西城区金融大街 3 号 A 座   |

|       |                   |        |
|-------|-------------------|--------|
|       | 一路 115 号投行大厦 10 层 |        |
| 邮政编码  | 518034            | 100808 |
| 法定代表人 | 马永红               | 张金良    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报            |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com |
| 基金年度报告备置地点          | 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                            |
|--------|----------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号<br>前滩中心 42 楼 |
| 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<br>号投行大厦 10 层 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------------------------|---------------|
|               | 宝盈祥乐一年持有期混合 A                             | 宝盈祥乐一年持有期混合 C |
| 本期已实现收益       | -4,164,738.96                             | -341,133.92   |
| 本期利润          | -1,257,618.41                             | -125,848.64   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0063                                   | -0.0086       |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.64%                                    | -0.86%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.63%                                    | -0.86%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                                   |               |
| 期末可供分配利润      | -4,164,738.96                             | -341,133.92   |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0210                                   | -0.0232       |
| 期末基金资产净值      | 197,095,683.76                            | 14,581,847.76 |
| 期末基金份额净值      | 0.9937                                    | 0.9914        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末                                   |               |
| 基金份额累计净值增长率   | -0.63%                                    | -0.86%        |

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、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 21 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

宝盈祥乐一年持有期混合 A

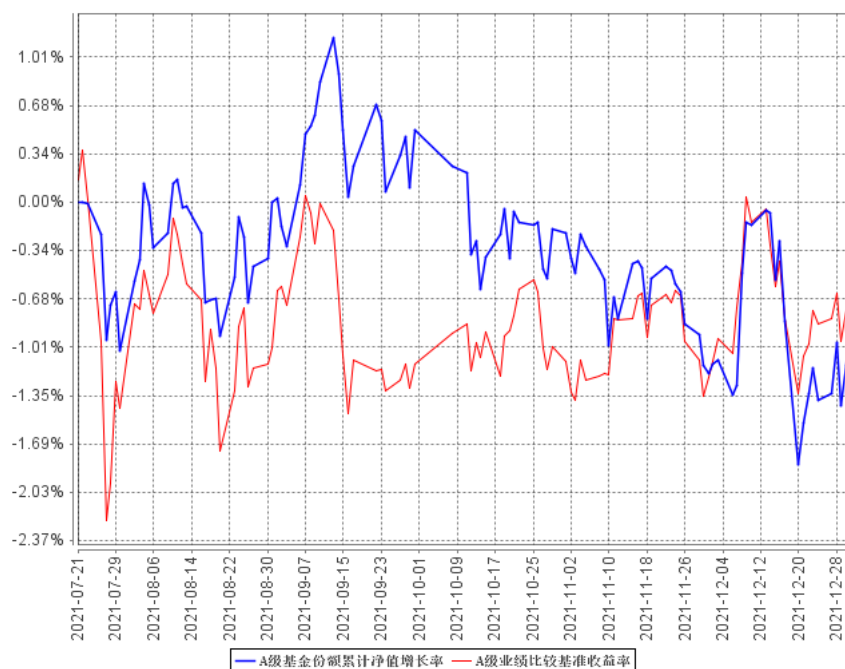
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -1.12%   | 0.30%       | 0.62%      | 0.22%         | -1.74% | 0.08%  |
| 自基金合同生效起至今 | -0.63%   | 0.30%       | -0.52%     | 0.31%         | -0.11% | -0.01% |

宝盈祥乐一年持有期混合 C

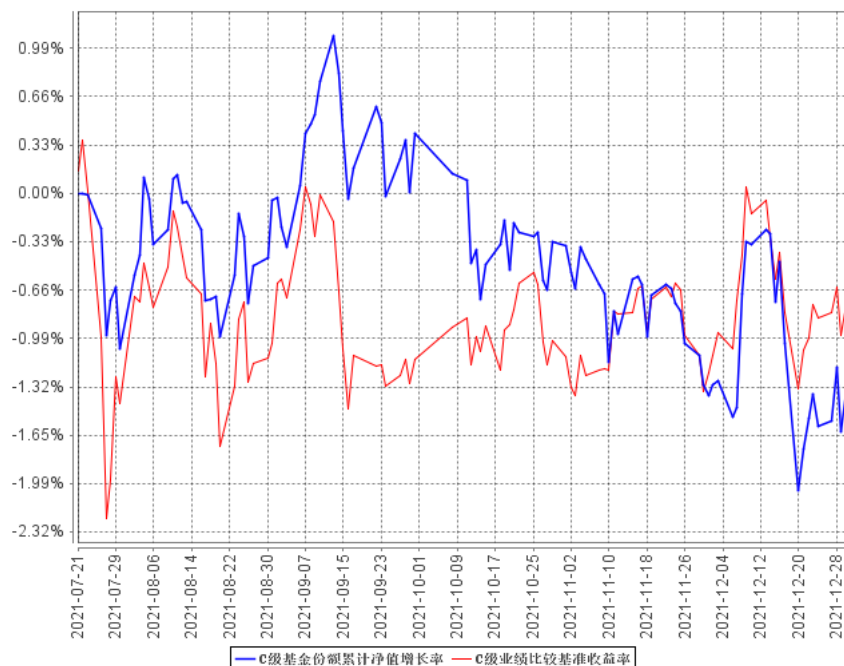
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -1.26%   | 0.30%       | 0.62%      | 0.22%         | -1.88% | 0.08%  |
| 自基金合同生效起至今 | -0.86%   | 0.30%       | -0.52%     | 0.31%         | -0.34% | -0.01% |

#### 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

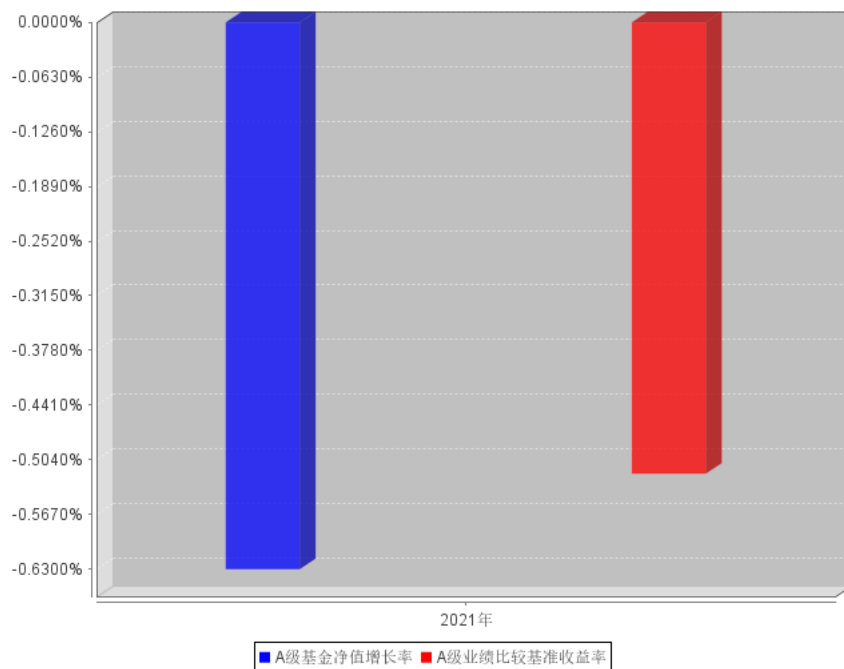


注：1、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 21 日，合同生效日当年，本基金的收益率和业绩比较基准收益率是按实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

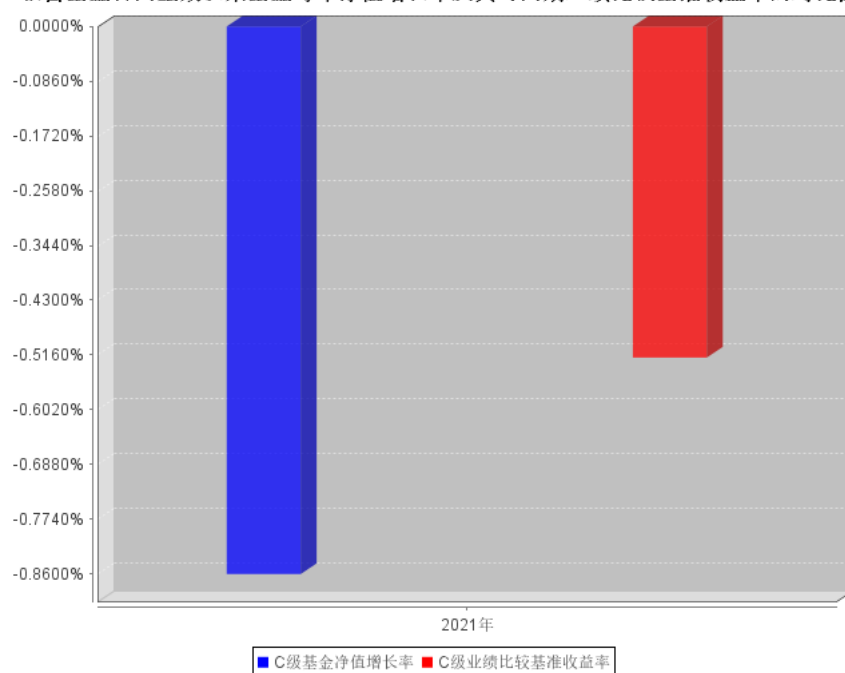
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例复核基金合同中的相关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 21 日，合同生效日当年，本基金的收益率和业绩比较基准收益率是按实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

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复核基金合同中的相关约定。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于 2021 年 7 月 21 日生效，自合同生效日起至披露时点未满 3 年，且无利润分配情况。

## § 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、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数、宝盈优质成长混合、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合五十五只基金，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 |        |                                                                                                                                                                                                      |
| 吕姝仪 | 本基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金、宝盈祥泽混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券 | 2021 年 8 月 20 日 | —    | 9 年    | 吕姝仪女士，中国人民大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2013 年 9 月在中山证券有限责任公司任投资经理助理，2013 年 10 月至 2015 年 9 月在民生加银基金管理有限公司任债券交易员，2015 年 9 月至 2017 年 12 月在东兴证券股份有限公司基金业务部任基金经理。2017 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，历任投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

|    | 投资基金基金经理                                                                                                                                                                      |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                     |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 邓栋 | 本基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金基金经理；固定收益部总经理 | 2021 年 7 月 21 日 | - | 11 年 | 邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008 年 3 月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自 2010 年 1 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部，历任宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金、宝盈聚福 39 个月定期开放债券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、邓栋为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、吕姝仪为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、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 12 月 31 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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理解释。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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

本基金以高等级信用债为底仓配置，保持中性久期；灵活参与股票投资，注重增速和估值的

匹配。四季度开始新股破发成为常态，打新收益有明显下滑，适当提升了股票中枢仓位，结构也从以低估值蓝筹，变化为以必需消费，地产产业链，消费电子以及新能源产业链上供需紧张的行业为主的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥乐一年持有期混合 A 基金份额净值为 0.9937 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.63%；截至本报告期末宝盈祥乐一年持有期混合 C 基金份额净值为 0.9914 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.86%；同期业绩比较基准收益率为-0.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券：展望 2022 年，国内经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，宽信用稳经济在上半年将发挥更大作用；海外流动性面临收缩压力，债券市场整体收益率水平将大概率低于 2021 年。

可转债：整体转债估值目前仍处于偏高的位置，转债性价比不高，等待市场调整之后择券提高仓位。

股票：整体判断权益市场不是单边市，股债性价比目前偏向股票，美债前期大幅上涨对成长股的压制已部分释放，稳增长不具备长期逻辑，后续切换至成长板块的概率较高。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 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（协管）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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈祥乐一年持有期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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

|            |   |
|------------|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
|------------|---|

|        |                         |
|--------|-------------------------|
| 审计意见类型 | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2022)第 21544 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题          | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 审计报告收件人         | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“宝盈祥乐一年持有期混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了宝盈祥乐一年持有期混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于宝盈祥乐一年持有期混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>宝盈祥乐一年持有期混合基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估宝盈祥乐一年持有期混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算宝盈祥乐一年持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督宝盈祥乐一年持有期混合基金的财务报告过程。</p>                                                                                                     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p>                                                                                                                                                                                            |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对宝盈祥乐一年持有期混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致宝盈祥乐一年持有期混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |    |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |
| 注册会计师的姓名  | 童咏静                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 肖菊 |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |
| 审计报告日期    | 2022 年 3 月 28 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 1,422,196.22            |
| 结算备付金       |         | 2,093,482.12            |
| 存出保证金       |         | 60,214.91               |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 281,612,479.10          |
| 其中：股票投资     |         | 75,953,207.90           |
| 基金投资        |         | -                       |
| 债券投资        |         | 205,659,271.20          |
| 资产支持证券投资    |         | -                       |

|                 |            |                                 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 贵金属投资           |            | -                               |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               |
| 应收证券清算款         |            | 1,053,962.69                    |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 2,857,289.46                    |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | -                               |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 289,099,624.50                  |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                 |
| 短期借款            |            | -                               |
| 交易性金融负债         |            | -                               |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               |
| 卖出回购金融资产款       |            | 77,000,000.00                   |
| 应付证券清算款         |            | -                               |
| 应付赎回款           |            | -                               |
| 应付管理人报酬         |            | 143,400.99                      |
| 应付托管费           |            | 35,850.24                       |
| 应付销售服务费         |            | 6,175.31                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 162,812.63                      |
| 应交税费            |            | 4,512.00                        |
| 应付利息            |            | 10,341.81                       |
| 应付利润            |            | -                               |
| 递延所得税负债         |            | -                               |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 59,000.00                       |
| 负债合计            |            | 77,422,092.98                   |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                 |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 213,060,998.57                  |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | -1,383,467.05                   |
| 所有者权益合计         |            | 211,677,531.52                  |
| 负债和所有者权益总计      |            | 289,099,624.50                  |

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，宝盈祥乐一年持有期混合 A 基金份额净值 0.9937 元，基金份额总额 198,353,302.17 份；宝盈祥乐一年持有期混合 C 基金份额净值 0.9914 元，基金份额总额 14,707,696.40 份。宝盈祥乐一年持有期混合份额总额合计为 213,060,998.57 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|-----------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | 716,714.52                                          |
| 1. 利息收入                    |            | 2,157,128.77                                        |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 85,209.84                                           |
| 债券利息收入                     |            | 2,057,165.76                                        |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                                                   |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 14,753.17                                           |
| 证券出借利息收入                   |            | -                                                   |
| 其他利息收入                     |            | -                                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -4,562,820.08                                       |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | -4,574,622.55                                       |
| 基金投资收益                     |            | -                                                   |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 11,802.47                                           |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.1 | -                                                   |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14   | -                                                   |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15   | -                                                   |
| 股利收益                       | 7.4.7.16   | -                                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 3,122,405.83                                        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                                                   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.18   | -                                                   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,100,181.57                                        |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 758,681.25                                          |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 189,670.30                                          |
| 3. 销售服务费                   |            | 32,698.84                                           |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 447,953.51                                          |
| 5. 利息支出                    |            | 605,323.22                                          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 605,323.22                                          |
| 6. 税金及附加                   |            | 1,854.45                                            |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 64,000.00                                           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -1,383,467.05                                       |
| 减：所得税费用                    |            | -                                                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -1,383,467.05                                       |

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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）                        | 213,060,998.57                                   | —             | 213,060,998.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | —                                                | -1,383,467.05 | -1,383,467.05  |
| 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）      | —                                                | —             | —              |
| 其中：1. 基金申购款                            | —                                                | —             | —              |
| 2. 基金赎回款                               | —                                                | —             | —              |
| 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）                        | 213,060,998.57                                   | -1,383,467.05 | 211,677,531.52 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|             |              |             |
|-------------|--------------|-------------|
| _____<br>杨凯 | _____<br>张献锦 | _____<br>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     |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

宝盈祥乐一年持有期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]3098号《关于准予宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《宝盈祥乐一年持有期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212,899,804.42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0724号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年7月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,060,998.57份基金份额,其中认购资金利息折合

161,194.15 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日日（对认购份额而言）、该基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）或该基金份额转换入确认日（对转换转入份额而言）；最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起一年后的年度对日。如无此年度对日或该对日为非工作日，则顺延至下一工作日。

根据《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈祥乐一年持有期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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥乐一年持有期混合 A；投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥乐一年持有期混合 C。宝盈祥乐一年持有期混合 A 和宝盈祥乐一年持有期混合 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《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、次级债、央行票据、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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和存托凭证）、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、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货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。本基金的投资组合比例为：本基金股票（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票和存托凭证）投资占基金资产的比例为 0% - 40%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者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：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+中证港

股通综合指数(人民币)收益率 $\times 10\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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。

### 7.4.4.4 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。

### 7.4.4.5 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 and 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 1,422,196.22            |
| 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：            | 1,422,196.22            |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                |                |
|---------------|-------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 74,045,505.51           | 75,953,207.90  | 1,907,702.39   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                       | —              | —              |
| 债券            | 交易所市场                   | 122,823,529.97 | 123,454,271.20 |
|               | 银行间市场                   | 81,621,037.79  | 82,205,000.00  |
|               | 合计                      | 204,444,567.76 | 205,659,271.20 |
| 资产支持证券        | —                       | —              | —              |
| 基金            | —                       | —              | —              |
| 其他            | —                       | —              | —              |
| 合计            | 278,490,073.27          | 281,612,479.10 | 3,122,405.83   |

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息   | 760.21                  |
| 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  | 1,036.31                |
| 应收债券利息     | 2,855,463.13            |
| 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         | 29.81                   |
| 合计         | 2,857,289.46            |

## 7.4.7.6 其他资产

无余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 162,437.63              |
| 银行间市场应付交易费用 | 375.00                  |
| 合计          | 162,812.63              |

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------|
| 应付赎回费     | —                       |
| 应付证券出借违约金 | —                       |
| 预提费用      | 59,000.00               |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 59,000.00 |
|----|-----------|

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 宝盈祥乐一年持有期混合 A |                                                  |                |
|---------------|--------------------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额（份）                                          | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 198,353,302.17                                   | 198,353,302.17 |
| 本期申购          | -                                                | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                                | -              |
| 本期末           | 198,353,302.17                                   | 198,353,302.17 |

金额单位：人民币元

| 宝盈祥乐一年持有期混合 C |                                                  |               |
|---------------|--------------------------------------------------|---------------|
| 项目            | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |               |
|               | 基金份额（份）                                          | 账面金额          |
| 基金合同生效日       | 14,707,696.40                                    | 14,707,696.40 |
| 本期申购          | -                                                | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                                | -             |
| 本期末           | 14,707,696.40                                    | 14,707,696.40 |

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 宝盈祥乐一年持有期混合 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           | -4,164,738.96 | 2,907,120.55 | -1,257,618.41 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -            | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -            | -             |
| 基金赎回款          | -             | -            | -             |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | -4,164,738.96 | 2,907,120.55 | -1,257,618.41 |

单位：人民币元

| 宝盈祥乐一年持有期混合 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           | -341,133.92 | 215,285.28 | -125,848.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -           | -          | -           |
| 其中：基金申购款       | -           | -          | -           |

|         |             |            |             |
|---------|-------------|------------|-------------|
| 基金赎回款   | -           | -          | -           |
| 本期已分配利润 | -           | -          | -           |
| 本期末     | -341,133.92 | 215,285.28 | -125,848.64 |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 7 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 73,376.29                                          |
| 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 | 11,563.81                                          |
| 其他        | 269.74                                             |
| 合计        | 85,209.84                                          |

## 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 7 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 144,849,813.48                                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 149,424,436.03                                     |
| 买卖股票差价收入   | -4,574,622.55                                      |

## 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021 年 7 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------------------|----------------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 40,724,565.89                                      |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 40,201,006.71                                      |
| 减：应收利息总额                | 511,756.71                                         |
| 买卖债券差价收入                | 11,802.47                                          |

## 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

无。

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------------------|--------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 3,122,405.83                                     |
| ——股票投资                 | 1,907,702.39                                     |
| ——债券投资                 | 1,214,703.44                                     |
| ——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                     | 3,122,405.83                                     |

## 7.4.7.18 其他收入

无。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|--------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 446,503.51                                       |
| 银行间市场交易费用 | 1,450.00                                         |
| 交易基金产生的费用 | —                                                |
| 其中：申购费    | —                                                |
| 赎回费       | —                                                |
| 合计        | 447,953.51                                       |

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------|--------------------------------------------------|
| 审计费用     | 50,000.00                                        |
| 信息披露费    | —                                                |
| 证券出借违约金  | —                                                |
| 银行间帐户维护费 | 13,500.00                                        |

|    |           |
|----|-----------|
| 其他 | 500.00    |
| 合计 | 64,000.00 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“中国邮储银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |
| 中铁信托有限责任公司                   | 基金管理人的股东            |
| 中国对外经济贸易信托有限公司               | 基金管理人的股东            |
| 中铁宝盈资产管理有限公司                 | 基金管理人的子公司           |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 758,681.25                                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 207,031.51                                       |

注：支付基金管理人宝盈基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|----|--------------------------------------------------|
|----|--------------------------------------------------|

|                |            |
|----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 189,670.30 |
|----------------|------------|

注：支付基金托管人中国邮储银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日<br>当期发生的基金应支付的销售服务费 |               |           |
|----------------|----------------------------------------------------------------------|---------------|-----------|
|                | 宝盈祥乐一年持有期混合 A                                                        | 宝盈祥乐一年持有期混合 C | 合计        |
|                |                                                                      |               |           |
| 中国邮储银行         | 0.00                                                                 | 15,207.58     | 15,207.58 |
| 宝盈基金公司         | 0.00                                                                 | 19.30         | 19.30     |
| 合计             | 0.00                                                                 | 15,226.88     | 15,226.88 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日宝盈祥乐一年持有期混合 C 的基金资产净值 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 = 前一日宝盈祥乐一年持有期混合 C 的基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |               |
|---------------------------------|--------------------------------------------------|---------------|
|                                 | 宝盈祥乐一年持有期混合 A                                    | 宝盈祥乐一年持有期混合 C |
| 基金合同生效日(2021 年 7 月 21 日)持有的基金份额 | 20,000,000.00                                    | -             |

|                     |               |   |
|---------------------|---------------|---|
| 报告期初持有的基金份额         | -             | - |
| 报告期间申购/买入总份额        | -             | - |
| 报告期间因拆分变动份额         | -             | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -             | - |
| 报告期末持有的基金份额         | 20,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 10.08%        | - |

#### 7.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 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<br>2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |           |
|--------|--------------------------------------------------|-----------|
|        | 期末余额                                             | 当期利息收入    |
| 中国邮储银行 | 1,422,196.22                                     | 73,376.29 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮储银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间无需披露其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 688262               | 国芯科技 | 2021 年 12 月 28 日 | 2022 年 1 月 6 日 | 新股流通受限 | 41.98 | 41.98  | 2,723    | 114,311.54 | 114,311.54 | -  |
| 688103               | 国力股份 | 2021 年 9 月 2 日   | 2022 年 3 月     | 新股流通受限 | 12.04 | 66.10  | 1,595    | 19,203.80  | 105,429.50 | -  |

|        |     |                  |                 |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|-----|------------------|-----------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |     |                  | 10 日            |        |       |       |     |          |          |   |
| 001234 | 泰慕士 | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股流通受限 | 16.53 | 16.53 | 333 | 5,504.49 | 5,504.49 | - |

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票数量的 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票，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票不适用《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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 77,000,000.00 元，截至 2022 年 1 月 4 日、2022 年 1 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的投资范围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(含存托凭证)、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货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。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。

#### 7.4.13.2 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邮储银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| A-1    | —                       |
| A-1 以下 | —                       |
| 未评级    | 21,594,311.20           |
| 合计     | 21,594,311.20           |

注：于 2021 年 12 月 31 日，未评级部分为国债、短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 162,946,960.00          |
| AAA 以下 | —                       |
| 未评级    | 21,118,000.00           |

|    |                |
|----|----------------|
| 合计 | 184,064,960.00 |
|----|----------------|

注：于 2021 年 12 月 31 日，未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.3 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。

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 77,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金

持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.11%。

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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计           |
|-------------------------|--------------|-------|-------|-----|--------------|
| 资产                      |              |       |       |     |              |
| 银行存款                    | 1,422,196.22 | -     | -     | -   | 1,422,196.22 |
| 结算备付金                   | 2,093,482.12 | -     | -     | -   | 2,093,482.12 |
| 存出保证金                   | 60,214.91    | -     | -     | -   | 60,214.91    |

|           |                |                |               |               |                |
|-----------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 交易性金融资产   | 21,594,311.20  | 162,946,960.00 | 21,118,000.00 | 75,953,207.90 | 281,612,479.10 |
| 应收证券清算款   | -              | -              | -             | 1,053,962.69  | 1,053,962.69   |
| 应收利息      | -              | -              | -             | 2,857,289.46  | 2,857,289.46   |
| 资产总计      | 25,170,204.45  | 162,946,960.00 | 21,118,000.00 | 79,864,460.05 | 289,099,624.50 |
| 负债        | -              | -              | -             | -             | -              |
| 卖出回购金融资产款 | 77,000,000.00  | -              | -             | -             | 77,000,000.00  |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -             | 143,400.99    | 143,400.99     |
| 应付托管费     | -              | -              | -             | 35,850.24     | 35,850.24      |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -             | 6,175.31      | 6,175.31       |
| 应付交易费用    | -              | -              | -             | 162,812.63    | 162,812.63     |
| 应付利息      | -              | -              | -             | 10,341.81     | 10,341.81      |
| 应交税费      | -              | -              | -             | 4,512.00      | 4,512.00       |
| 其他负债      | -              | -              | -             | 59,000.00     | 59,000.00      |
| 负债总计      | 77,000,000.00  | -              | -             | 422,092.98    | 77,422,092.98  |
| 利率敏感度缺口   | -51,829,795.55 | 162,946,960.00 | 21,118,000.00 | 79,442,367.07 | 211,677,531.52 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                             |
|----|--------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除市场利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12月31日）            |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 1,140,239.27                |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -1,122,012.72               |

#### 7.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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；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资产(包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票和存托凭证)占基金资产的比例为 0% - 40%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 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  | 75,953,207.90           | 35.88        |
| 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            | 75,953,207.90           | 35.88        |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 86,975,922.37 元, 属于第二层次的余额为 194,531,127.23 元, 属于第三层次的余额为 105,429.50 元。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日本基金持有的公允价值归属于第三层次的金融工具 105,429.5 元。于 2021 年度, 本基金购买第三层次的金融工具 19,203.8 元, 计入损益的利得或损失总额(均计入利润表中的公允价值变动收益项目)86,225.7 元。于 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动为 86,225.7 元。

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的第三层次交易性金融资产(均为证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资)公允价值为 105,429.5 元, 采用平均价格亚式期权模型进行估值, 不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率, 与公允价值之间为负相关关系。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定, 以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日, 本基金

已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，相应调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 75,953,207.90  | 26.27         |
|    | 其中：股票             | 75,953,207.90  | 26.27         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 205,659,271.20 | 71.14         |
|    | 其中：债券             | 205,659,271.20 | 71.14         |
|    | 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      | 3,515,678.34   | 1.22          |
| 8  | 其他各项资产            | 3,971,467.06   | 1.37          |
| 9  | 合计                | 289,099,624.50 | 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。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | —             | —             |
| C  | 制造业              | 45,654,623.43 | 21.57         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,981,060.00 | 5.66          |
| E  | 建筑业              | —             | —             |
| F  | 批发和零售业           | —             | —             |
| 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 | 114,311.54    | 0.05  |
| J | 金融业             | 10,024,498.13 | 4.74  |
| K | 房地产业            | 4,615,539.00  | 2.18  |
| L | 租赁和商务服务业        | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 3,533,684.00  | 1.67  |
| 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       | 29,491.80     | 0.01  |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 75,953,207.90 | 35.88 |

### 8.2.2 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。

### 8.3 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  | 600900 | 长江电力 | 527,800 | 11,981,060.00 | 5.66         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 4,000   | 8,200,000.00  | 3.87         |
| 3  | 002241 | 歌尔股份 | 123,600 | 6,686,760.00  | 3.16         |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 121,603 | 5,923,282.13  | 2.80         |
| 5  | 002466 | 天齐锂业 | 55,300  | 5,917,100.00  | 2.80         |
| 6  | 600487 | 亨通光电 | 380,300 | 5,750,136.00  | 2.72         |
| 7  | 600048 | 保利发展 | 295,300 | 4,615,539.00  | 2.18         |
| 8  | 688005 | 容百科技 | 39,068  | 4,515,479.44  | 2.13         |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 106,300 | 4,407,198.00  | 2.08         |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 215,400 | 4,101,216.00  | 1.94         |
| 11 | 600872 | 中炬高新 | 105,900 | 4,021,023.00  | 1.90         |
| 12 | 601966 | 玲珑轮胎 | 107,100 | 3,914,505.00  | 1.85         |
| 13 | 603259 | 药明康德 | 29,800  | 3,533,684.00  | 1.67         |
| 14 | 002756 | 永兴材料 | 14,400  | 2,131,488.00  | 1.01         |
| 15 | 688262 | 国芯科技 | 2,723   | 114,311.54    | 0.05         |
| 16 | 688103 | 国力股份 | 1,595   | 105,429.50    | 0.05         |
| 17 | 603230 | 内蒙新华 | 1,140   | 29,491.80     | 0.01         |
| 18 | 001234 | 泰慕士  | 333     | 5,504.49      | 0.00         |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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  | 601398 | 工商银行 | 20,864,590.00 | 9.86           |
| 2  | 600900 | 长江电力 | 15,832,216.00 | 7.48           |
| 3  | 601288 | 农业银行 | 9,247,012.00  | 4.37           |
| 4  | 600872 | 中炬高新 | 8,489,683.00  | 4.01           |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 8,452,505.00  | 3.99           |
| 6  | 603259 | 药明康德 | 8,445,981.00  | 3.99           |
| 7  | 603799 | 华友钴业 | 8,416,861.00  | 3.98           |
| 8  | 601088 | 中国神华 | 7,423,564.00  | 3.51           |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 7,043,571.00  | 3.33           |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 6,374,360.96  | 3.01           |
| 11 | 600377 | 宁沪高速 | 6,369,914.00  | 3.01           |
| 12 | 600487 | 亨通光电 | 6,352,601.20  | 3.00           |
| 13 | 002466 | 天齐锂业 | 6,092,194.00  | 2.88           |
| 14 | 002241 | 歌尔股份 | 5,958,393.00  | 2.81           |
| 15 | 688005 | 容百科技 | 4,662,004.44  | 2.20           |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 4,275,298.00  | 2.02           |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 4,260,710.00  | 2.01           |
| 18 | 600031 | 三一重工 | 4,256,552.00  | 2.01           |
| 19 | 600919 | 江苏银行 | 4,244,907.00  | 2.01           |
| 20 | 300122 | 智飞生物 | 4,242,240.00  | 2.00           |
| 21 | 600600 | 青岛啤酒 | 4,240,713.88  | 2.00           |
| 22 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,240,276.00  | 2.00           |
| 23 | 603583 | 捷昌驱动 | 4,239,667.00  | 2.00           |
| 24 | 601677 | 明泰铝业 | 4,238,047.00  | 2.00           |
| 25 | 601966 | 玲珑轮胎 | 4,236,236.00  | 2.00           |

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。

## 8.4.2 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  | 601398 | 工商银行 | 20,936,744.00 | 9.89 |
| 2  | 601288 | 农业银行 | 9,280,912.00  | 4.38 |
| 3  | 601088 | 中国神华 | 8,305,830.03  | 3.92 |
| 4  | 603799 | 华友钴业 | 7,495,801.00  | 3.54 |
| 5  | 600900 | 长江电力 | 6,363,096.00  | 3.01 |
| 6  | 600377 | 宁沪高速 | 6,126,494.00  | 2.89 |
| 7  | 601677 | 明泰铝业 | 5,033,201.87  | 2.38 |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 4,593,878.00  | 2.17 |
| 9  | 600298 | 安琪酵母 | 4,397,645.00  | 2.08 |
| 10 | 603583 | 捷昌驱动 | 4,219,742.60  | 1.99 |
| 11 | 600872 | 中炬高新 | 4,038,036.58  | 1.91 |
| 12 | 600031 | 三一重工 | 3,955,411.00  | 1.87 |
| 13 | 600919 | 江苏银行 | 3,886,749.20  | 1.84 |
| 14 | 600600 | 青岛啤酒 | 3,856,131.00  | 1.82 |
| 15 | 600309 | 万华化学 | 3,853,426.00  | 1.82 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 3,799,993.00  | 1.80 |
| 17 | 300750 | 宁德时代 | 3,702,758.00  | 1.75 |
| 18 | 002460 | 赣锋锂业 | 3,651,648.00  | 1.73 |
| 19 | 300122 | 智飞生物 | 3,627,845.00  | 1.71 |
| 20 | 603259 | 药明康德 | 3,426,249.00  | 1.62 |

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。

#### 8.4.3 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 | 223,469,941.54 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 144,849,813.48 |

注：买入股票成本（成交）总额与卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 11,558,311.20  | 5.46         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 21,118,000.00  | 9.98         |
|    | 其中：政策性金融债 | 21,118,000.00  | 9.98         |
| 4  | 企业债券      | 141,401,000.00 | 66.80        |
| 5  | 企业短期融资券   | 10,036,000.00  | 4.74         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 6  | 中期票据      | 10,298,000.00  | 4.86  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 11,247,960.00  | 5.31  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 205,659,271.20 | 97.16 |

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 170210    | 17 国开 10      | 200,000 | 21,118,000.00 | 9.98         |
| 2  | 2028033   | 20 建设银行二级     | 200,000 | 20,748,000.00 | 9.80         |
| 3  | 019649    | 21 国债 01      | 115,560 | 11,558,311.20 | 5.46         |
| 4  | 132018    | G 三峡 EB1      | 80,400  | 11,247,960.00 | 5.31         |
| 5  | 102100427 | 21 赣国资 MTN001 | 100,000 | 10,298,000.00 | 4.86         |

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合整体风险的目的。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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 20 中证 15、21 上海银行的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2021 年 2 月 10 日，深圳证监局认定中信证券公司对私募基金托管业务、投资银行业务和资产管理业务的管控存在薄弱环节，内部控制不完善，决定对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定。

2021 年 7 月 12 日，根据沪银保监罚决字（2021）72 号，2018 年 12 月，上海银行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则；2019 年 11 月，该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则；2019 年 2 月至 4 月，该行部分个人贷款违规用于购房；2020 年 5 月至 7 月，该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎；2020 年 7 月，该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则；2020 年 6 月至 12 月，该行部分业务以贷收费。因违法《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第（三）项、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（八）项，对上海银行责令改正，并处罚款共计 460 万元。

我们认为相关处罚措施对中信证券、上海银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对中信证券、上海银行的债券偿还影响很小。本基金投资 20 中证 15、21 上海银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 8.12.2 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

本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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   | 60,214.91    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,053,962.69 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,857,289.46 |
| 5  | 应收申购款   | -            |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 3,971,467.06 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 132018 | G 三峡 EB1 | 11,247,960.00 | 5.31         |

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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  |
| 宝盈祥乐一年持有期混合 A | 2,717    | 73,004.53 | 77,009,880.00 | 38.82% | 121,343,422.17 | 61.18%  |
| 宝盈祥乐一年持有期混合 C | 1,878    | 7,831.57  | 0.00          | 0.00%  | 14,707,696.40  | 100.00% |
| 合计            | 4,595    | 46,368.01 | 77,009,880.00 | 36.14% | 136,051,118.57 | 63.86%  |

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。

#### 9.2 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 | 宝盈祥乐一年持有期混合 A | 9.95      | 0.0000%  |
|                  | 宝盈祥乐一年持有期混合 C | 50.14     | 0.0003%  |
|                  | 合计            | 60.09     | 0.0000%  |

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)。

### 9.3 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<br>(万份) |
|----------------------------------------|---------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金<br>投资和研究部门负责人持<br>有本开放式基金 | 宝盈祥乐一年持有期混合 A | 0                     |
|                                        | 宝盈祥乐一年持有期混合 C | 0                     |
|                                        | 合计            | 0                     |
| 本基金基金经理持有本开<br>放式基金                    | 宝盈祥乐一年持有期混合 A | 0                     |
|                                        | 宝盈祥乐一年持有期混合 C | 0                     |
|                                        | 合计            | 0                     |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 宝盈祥乐一年持有<br>期混合 A | 宝盈祥乐一年持有<br>期混合 C |
|----------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2021 年 7 月 21 日)基金<br>份额总额     | 198,353,302.17    | 14,707,696.40     |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申<br>购份额              | —                 | —                 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总<br>赎回份额            | —                 | —                 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分<br>变动份额(份额减少以“-”填列) | —                 | —                 |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 198,353,302.17    | 14,707,696.40     |

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 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。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,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。

#### 11.5 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。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费 50,000.00 元,目前事务所为第 1 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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 |    |
| 海通证券 | 2      | 366,444,900.43 | 100.00%      | 260,649.61 | 100.00%    | -  |

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (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席位租用协议。

## 2、席位变更情况

## (1) 租用交易单元情况

本基金本报告期内新租海通证券上海、深圳交易单元各一个。

## (2) 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元情况。

## 11.7.2 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 |
| 海通证券 | 152,994,832.16 | 100.00%      | 1,692,600,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## 11.8 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基金经理吕姝仪女士休假由他人代为履行基金经理职责的公告             | 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 12 月 29 日 |
| 2  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告            | 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 12 月 8 日  |
| 3  | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加国信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 12 月 2 日  |
| 4  | 宝盈基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告                           | 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 10 月 30 日 |
| 5  | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告                   | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                           | 2021 年 10 月 27 日 |
| 6  | 宝盈基金管理有限公司旗下 49 只基金 2021 年第 3 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 10 月 27 日 |
| 7  | 宝盈基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构及参与相关费率优惠的公告     | 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 10 月 22 日 |
| 8  | 宝盈基金管理有限公司关于增加西部证券股份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 9 月 3 日   |
| 9  | 宝盈基金管理有限公司关于宜信普泽(北京)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 9 月 3 日   |
| 10 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金(宝盈祥乐一年持有期混合 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 8 月 23 日  |
| 11 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金(宝盈祥乐一年持有期混合 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 8 月 23 日  |
| 12 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券                                      | 本基金管理人网站, 中国证券                                    | 2021 年 8 月 23 日  |

|    |                                                       |                                                   |                 |
|----|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|
|    | 投资基金更新招募说明书                                           | 会基金电子披露网站                                         |                 |
| 13 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告                            | 证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2021 年 8 月 20 日 |
| 14 | 宝盈基金管理有限公司关于新增腾安基金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 8 月 18 日 |
| 15 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长城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 8 月 16 日 |
| 16 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海爱建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 8 月 13 日 |
| 17 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加招商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 8 月 13 日 |
| 18 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告                            | 证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2021 年 7 月 22 日 |
| 19 | 宝盈基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告                                | 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 7 月 21 日 |
| 20 | 宝盈基金管理有限公司旗下 48 只基金 2021 年第 2 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 7 月 21 日 |
| 21 | 关于宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告                         | 证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2021 年 7 月 17 日 |
| 22 | 关于宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金延长募集时间的公告                         | 证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站                     | 2021 年 7 月 7 日  |
| 23 | 关于宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金延长募集时间的公告                         | 证券日报, 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 8 日  |
| 24 | 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 |
| 25 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金(宝盈祥乐一年持有期混合 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 4 月 30 日 |

|    |                                              |                               |                 |
|----|----------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|
| 26 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金（宝盈祥乐一年持有期混合 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 4 月 30 日 |
| 27 | 宝盈祥乐一年持有期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 4 月 30 日 |
| 28 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告                   | 证券日报, 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 30 日 |
| 29 | 宝盈祥乐一年持有期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 4 月 30 日 |
| 30 | 宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告            | 证券日报                          | 2021 年 4 月 30 日 |
| 31 | 宝盈祥乐一年持有期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 4 月 30 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 07 月 20 日-2021 年 12 月 31 日 | -    | 50,010,250.00 | -    | 50,010,250.00 | 23.47% |
| 个人                                                              | -              | -                                 | -    | -             | -    | -             | -      |
| 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。 |                |                                   |      |               |      |               |        |

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

本基金备查文件包括:

- (一) 中国证监会准予宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金注册的文件;
- (二) 《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》;
- (三) 《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金托管协议》;
- (四) 法律意见书;

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（七）中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人办公地址：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：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

### 13.3 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

2022 年 3 月 30 日