

宝盈资源优选混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈资源优选混合型证券投资基金
基金简称	宝盈资源优选混合
基金主代码	213008
交易代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 15 日
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	648,824,998.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期，处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值，相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型，优选各个行业中具有资源优势的上市公司，建立股票池。在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合，并注重资产在各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。 1、资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。 2、股票投资策略 本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。 在个股选择层面，本基金以净资产收益率、预期 PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。 3、债券及短期金融工具投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略，运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过

	债券市场的收益。 4、权证投资策略 本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。 5、存托凭证投资策略 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊	李申
	联系电话	0755-83276688	021-60637102
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	021-60637111
传真		0755-83515599	021-60635778
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 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518034	100033
法定代表人		严震	田国立

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路 115 号 投行大厦 10 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-252,098,897.89

本期利润	-225,244,287.93
加权平均基金份额本期利润	-0.3480
本期加权平均净值利润率	-19.63%
本期基金份额净值增长率	-16.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	194,004,706.29
期末可供分配基金份额利润	0.2990
期末基金资产净值	1,167,132,910.70
期末基金份额净值	1.7988
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	190.16%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

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。

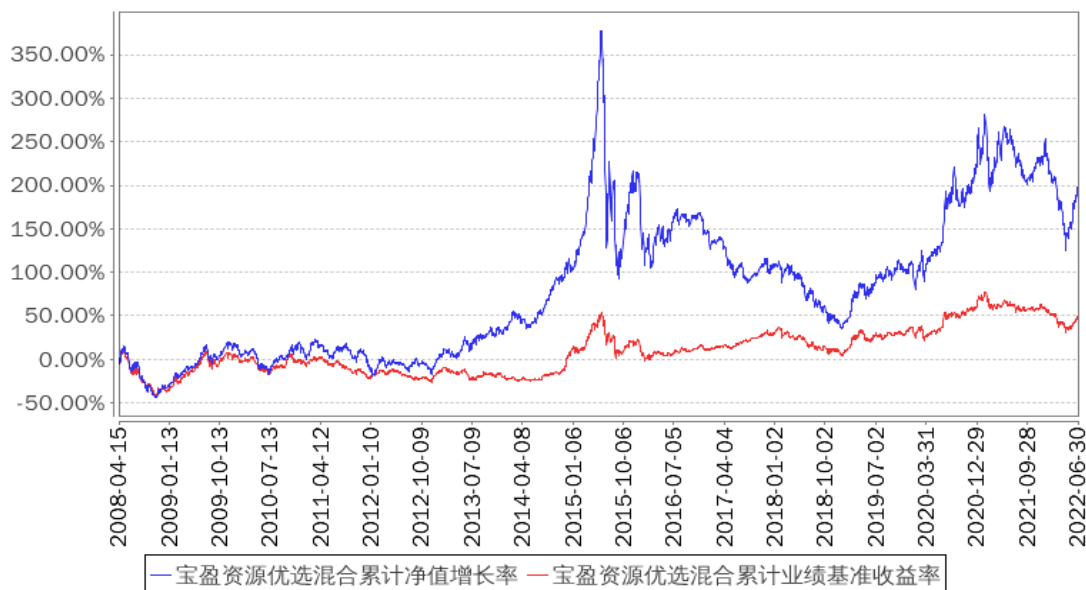
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	12.11%	1.71%	7.21%	0.80%	4.90%	0.91%
过去三个月	5.13%	1.89%	5.03%	1.08%	0.10%	0.81%
过去六个月	-16.50%	1.66%	-6.31%	1.09%	-10.19%	0.57%
过去一年	-20.48%	1.36%	-9.48%	0.94%	-11.00%	0.42%
过去三年	54.59%	1.57%	17.41%	0.95%	37.18%	0.62%
自基金合同生效起至今	190.16%	1.77%	49.24%	1.20%	140.92%	0.57%

3.2.2 自基金转型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

宝盈资源优选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由原封闭式基金鸿飞转型而来，转型生效日为 2008 年 4 月 15 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈祥泽混合、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、宝盈祥和 9 个月定开混合、宝盈安盛中短债债券、宝盈祥瑞混合、宝盈新能源产业混合发起式五十七只基金，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		
赵国进	本基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈基础产业混合型证券投资基金基金经理	2022 年 2 月 19 日	-	9 年	赵国进先生，南开大学精算学硕士。曾任天津灵杰科技有限公司软件研发工程师，广发证券股份有限公司证券分析师，中国国际金融股份有限公司证券分析师，2015 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
肖肖	本基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈品牌消费股票型证券投资基金、宝盈龙头优选股票型证券投资基金、宝盈现代服务业混合型证券投资基金、宝盈研究精选混合型证券投资基金、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；权益投资部总经理	2017 年 7 月 29 日	2022 年 2 月 19 日	13 年	肖肖先生，北京大学金融学硕士。2008 年 7 月至 2011 年 4 月任职于联合证券有限责任公司，担任研究员；2011 年 5 月至 2014 年 5 月任职于民生证券有限责任公司，担任研究员；2014 年 6 月至 2015 年 2 月任职于方正证券股份有限公司，担任研究员；自 2015 年 2 月加入宝盈基金管理有限公司研究部，先后担任研究员、研究部副总经理、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2022 年 6 月 30 日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，A 股市场整体波动较大，经历一季度的大幅回撤之后，在 4 月底触底反弹。报告期内，沪深 300 指数下跌 9.22%，创业板指数下跌 15.41%。2022 年初以来，国际经济、政治以及新冠疫情均出现较大的变数——外围市场加息预期、东欧政治变局、变异新冠病毒再次造成国内外大范围感染。此外，国内经济增长形势受新冠疫情的影响面临较大不确定性，国外政府对中概股监管措施也出现巨大变化。诸多因素导致 A 股、港股均出现较大幅度的下跌，另由于部分因素（国际政治、监管措施、新冠疫情）的不可预测性，市场一度呈现出暴涨暴跌的巨大波动特征。沪深 300 指数在 4 月底触底，大部分股票估值已经进入历史底部区间，因此随着华东地区疫情逐渐得到控制以及政府推出各类消费刺激政策，A 股在二季度迎来较大幅度的反弹。行业上

来看(中信一级行业),2022 年上半年涨幅排名前两名的行业为煤炭、消费者服务,分别上涨 33.74%和 8.44%;跌幅较大的行业为电子、传媒,分别下跌 23.58%和 21.8%。

市场波动加剧的背景之下,以不变应万变是长期战胜市场的法宝之一。本基金主要投资于在驱动经济增长和社会进步过程中具有核心技术资源的公司。基金经理认为,科技是第一生产力,科技竞争力是企业最重要的资源禀赋,因此本基金更侧重于投资泛科技成长性板块,例如新能源、信息技术、互联网、军工及相关产业链。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7988 元;本报告期基金份额净值增长率为-16.50%,业绩比较基准收益率为-6.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年以来,新冠疫情对全球经济带来了巨大的负面影响,世界范围内的主要经济体在过去两年通过释放流动性来减缓经济衰退。随疫情逐渐减弱,全球流动性宽松政策难以持续,过度的流动性反而可能会引发通胀风险,依靠流动性带来估值提升的投资机会越来越少。与此同时,叠加东欧地缘政治因素导致外部市场出现的通胀迹象,全球经济走向衰退的可能性在增加。

聚焦到国内而言,针对新冠疫情的“动态清零”防控措施有效扼制了病毒的传播,尽管局部地区的封控对经济活动造成了短暂的扰动,国内 GDP 在压力最大的 2022Q2 依然取得了 0.4%的正增长,说明中国经济有足够的韧性可以承受短期波动。随新冠病毒致病性的进一步减弱,相关防控政策对经济活动的干扰也会减弱。因此,我们认为即使外部市场承压,中国经济依然能够走出独立行情。

因此,我们将继续围绕科技产业创新趋势来挖掘新的投资机会。与此同时,我们也会密切关注外部市场的变化,尽可能规避外部市场有可能会传导至国内市场的特定风险。

具体而言,在新兴产业方向上,我们继续看好新能源产业的发展机遇,尤其是汽车电动化与智能化。此外,我们继续看好消费领域新型个人/家庭终端爆发带来投资机会,例如 VR 设备、机器人等。相对而言,我们会增加对计算机和传媒板块的配置比例。一方面,计算机与传媒板块在过去几年表现疲软。因为各种原因,部分公司股价下跌充分,估值已经跌入历史最低区间,但公司业绩依然保持快速增长,充分体现了中国市场的巨大成长空间。另一方面,计算机与传媒板块的某些细分领域存在估值边际提升的可能性。例如,在计算机领域,“数字经济”国策对工业互联网、数据中心等领域投资的引导;在传媒领域,VR 设备渗透率的提升将逐渐实现元宇宙设想的完善。我们认为在诸如此类的领域,相关公司存在业绩与估值双双获得提升的投资机会。

最后,随监管机构对大型互联网公司涉嫌垄断等事宜的调查进入尾声阶段,相关互联网公司

根据监管机构的指导调整业务经营方式后，将会以更健康的方式重回高速增长阶段，其投资价值依然显著。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金的每份基金份额享有同等分配权；收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%，全年基金收益分配比例不低于年度基金可分配收益的 30%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，报告期内本基金共进行了 1 次收益分配：

1、本基金管理人已于 2022 年 1 月 10 日发布公告，以 2021 年 12 月 31 日可供分配利润为基准，每 10 份基金份额派发红利 2.9190 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净

值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈资源优选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	118,942,455.65	189,469,168.65
结算备付金		1,163,813.40	-
存出保证金		309,242.76	179,463.38
交易性金融资产	6.4.7.2	1,021,632,093.80	1,266,974,671.49
其中：股票投资		1,021,632,093.80	1,266,974,671.49
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		28,609,797.97	-
应收股利		-	-
应收申购款		172,387.29	109,050.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	33,297.23
资产总计		1,170,829,790.87	1,456,765,651.46
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	8,386,506.69
应付赎回款		1,001,140.12	2,814,964.94
应付管理人报酬		1,411,887.22	3,464,932.62
应付托管费		235,314.55	294,357.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,048,538.28	383,091.25
负债合计		3,696,880.17	15,343,853.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	596,494,376.02	540,184,114.21
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	570,638,534.68	901,237,684.25
净资产合计		1,167,132,910.70	1,441,421,798.46
负债和净资产总计		1,170,829,790.87	1,456,765,651.46

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，宝盈资源优选混合型证券投资基金基金份额净值为人民币 1.7988 元，基金份额总额 648,824,998.08 份。

2、以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项

目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：宝盈资源优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-215,113,934.11	193,705,179.67
1. 利息收入		313,778.82	351,065.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	313,778.82	336,563.91
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	14,501.28
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-242,328,089.48	497,744,318.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-245,975,352.86	490,537,868.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	49,665.07	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,597,598.31	7,206,449.65
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	26,854,609.96	-304,837,338.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	45,766.59	447,134.58
减：二、营业总支出		10,130,353.82	19,662,075.85

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,573,078.90	13,222,003.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,428,846.52	2,203,667.16
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	128,428.40	4,236,405.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-225,244,287.93	174,043,103.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-225,244,287.93	174,043,103.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-225,244,287.93	174,043,103.82

注：以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宝盈资源优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	540,184,114.21	-	901,237,684.25	1,441,421,798.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	540,184,114.21	-	901,237,684.25	1,441,421,798.46

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	56,310,261.81	-	-330,599,149.57	-274,288,887.76
（一）、综合收益总额	-	-	-225,244,287.93	-225,244,287.93
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	56,310,261.81	-	65,351,704.36	121,661,966.17
其中：1. 基金申购款	89,929,939.85	-	98,721,363.63	188,651,303.48
2. 基金赎回款	-33,619,678.04	-	-33,369,659.27	-66,989,337.31
（三）、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）	-	-	-170,706,566.00	-170,706,566.00
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	596,494,376.02	-	570,638,534.68	1,167,132,910.70
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	843,247,852.42	-	1,296,082,242.42	2,139,330,094.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	843,247,852.42	-	1,296,082,242.42	2,139,330,094.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-247,535,468.82	-	-222,504,185.92	-470,039,654.74

(一)、综合收益总额	-	-	174,043,103.82	174,043,103.82
(二)、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)	-247,535,468.82	-	-396,547,289.74	-644,082,758.56
其中: 1. 基金申购款	46,467,805.33	-	76,367,613.36	122,835,418.69
2. 基金赎回款	-294,003,274.15	-	-472,914,903.10	-766,918,177.25
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	595,712,383.60	-	1,073,578,056.50	1,669,290,440.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨凯

张献锦

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈资源优选混合型证券投资基金(原名为宝盈资源优选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原鸿飞证券投资基金(以下简称“基金鸿飞”)基金份额持有人大会于 2008 年 2 月 6 日至 2008 年 2 月 28 日决议通过的《关于鸿飞证券投资基金转型有关事项的议案》,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]392 号《关于核准鸿飞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》,由原鸿飞证券投资基金转型而来。原基金鸿飞为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2008 年 4 月 14 日止。根据深交所深证复[2008]17 号《关于同意鸿飞证券投资基金终止上市的批复》,原基金鸿飞于 2008

年 4 月 14 日进行终止上市权利登记。自 2008 年 4 月 15 日起，原基金鸿飞终止上市，原基金鸿飞更名为宝盈资源优选股票型证券投资基金，《鸿飞证券投资基金基金合同》失效的同时《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金鸿飞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 587,318,195.00 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《宝盈资源优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原鸿飞证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 6 月 25 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:1.0877285，并于 2008 年 6 月 25 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2008 年 5 月 22 日至 2008 年 6 月 20 日期间内开放集中申购，共募集 53,001,904.19 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 19,187.54 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报(验)字(08)第 0006 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2008 年 6 月 25 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 53,001,904.19 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 19,187.54 份基金份额，并于 2008 年 6 月 25 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈资源优选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股票(含存托凭证)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)投资的比例范围为基金资产的 60%-95%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0%-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有资源优势的股票。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 X75%+上证国债指数 X25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈资源优选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年中期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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除以下会计政策变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股权投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表

中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,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,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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相关交易费用及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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年中期财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 189,469,168.65 元、179,463.38 元、33,297.23 元和 109,050.71 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 189,502,377.00 元、179,552.26 元、0.00 元和 109,050.71 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,266,974,671.49 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,266,974,671.49 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 8,386,506.69 元、2,814,964.94 元、3,464,932.62 元、294,357.50 元、270,409.54 元和 3,681.71 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 8,386,506.69 元、2,814,964.94 元、3,464,932.62 元、294,357.50 元、270,409.54 元和 3,681.71 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	118,942,455.65
等于: 本金	118,933,865.30
加: 应计利息	8,590.35
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-

减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	118,942,455.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	939,971,688.17	-	1,021,632,093.80	81,660,405.63
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	939,971,688.17	-	1,021,632,093.80	81,660,405.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付赎回费	673.44

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	929,768.90
其中：交易所市场	929,218.90
银行间市场	550.00
应付利息	-
预提费用	118,095.94
合计	1,048,538.28

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	587,574,681.47	540,184,114.21
本期申购	97,819,077.10	89,929,939.85
本期赎回（以“-”号填列）	-36,568,760.49	-33,619,678.04
本期末	648,824,998.08	596,494,376.02

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	571,550,189.29	329,687,494.96	901,237,684.25
本期利润	-252,098,897.89	26,854,609.96	-225,244,287.93
本期基金份额交易产生的变动数	45,259,980.89	20,091,723.47	65,351,704.36
其中：基金申购款	63,023,385.37	35,697,978.26	98,721,363.63
基金赎回款	-17,763,404.48	-15,606,254.79	-33,369,659.27
本期已分配利润	-170,706,566.00	-	-170,706,566.00
本期末	194,004,706.29	376,633,828.39	570,638,534.68

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	301,230.78
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	11,012.02
其他	1,536.02
合计	313,778.82

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-245,975,352.86
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-245,975,352.86

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,071,128,759.80
减：卖出股票成本总额	1,313,885,261.86
减：交易费用	3,218,850.80
买卖股票差价收入	-245,975,352.86

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	45,715.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,950.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	49,665.07

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	109,711,049.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	109,521,100.00

减：应计利息总额	184,849.32
减：交易费用	1,150.00
买卖债券差价收入	3,950.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,597,598.31
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	3,597,598.31

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	26,854,609.96
股票投资	26,854,609.96
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
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	26,854,609.96

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	44,779.79

基金转换费收入	986.80
合计	45,766.59

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
汇款费	732.46
其他	600.00
合计	128,428.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司（“中国外贸信托”）	基金管理人的股东
中铁信托有限责任公司（“中铁信托”）	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司（“中铁宝盈”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,573,078.90	13,222,003.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,780,502.19	4,964,364.36

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,428,846.52	2,203,667.16

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年

费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期间及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	118,942,455.65	301,230.78	166,135,548.62	319,125.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备 注
		场外					
1	2022 年 1 月 11 日	2022 年 1 月 11 日	2.9190	118,037,546.43	52,669,019.57	170,706,566.00	-
合计	-	-	2.9190	118,037,546.43	52,669,019.57	170,706,566.00	-

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新股流通 受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-
301103	何氏眼科	2022 年 6 月 1 日	1-6 个月 (含)	新股流通 受限-送股	-	32.02	117	-	3,746.34	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月 (含)	新股流通 受限-送股	-	16.14	613	-	9,893.82	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通 受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-

301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	163.56	82.76	269	43,997.64	22,262.44	-
301150	中一科技	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限-送股	-	82.76	135	-	11,172.60	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	829	63,468.24	43,041.68	-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯	2022 年 3 月	6 个月	新股流通	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-

	新材	月 21 日		受限						
301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	173.98	87.82	228	39,667.44	20,022.96	-
301219	腾远 钴业	2022 年 5 月 24 日	1-6 个月 (含)	新股流通 受限-送股	-	87.82	182	-	15,983.24	-
301220	亚香 股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301228	实朴 检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股流通 受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301236	软通 动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	72.88	31.38	1,010	73,608.80	31,693.80	-
301236	软通 动力	2022 年 6 月 9 日	1-6 个月 (含)	新股流通 受限-送股	-	31.38	505	-	15,846.90	-
301237	和顺 科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰 新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	19.18	32.07	3,242	62,181.56	103,970.94	-
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内 (含)	新股流通 受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301248	杰创 智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融 化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士 莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布 鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩 康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301266	宇邦 新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利 达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道 科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源 股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-

301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688150	莱特光电	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688171	纬德信息	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资(含存托凭证)和权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司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）。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	118,942,455.65	-	-	-	118,942,455.65
结算备付金	1,163,813.40	-	-	-	1,163,813.40
存出保证金	309,242.76	-	-	-	309,242.76
交易性金融资产	-	-	-	1,021,632,093.80	1,021,632,093.80
应收申购款	-	-	-	172,387.29	172,387.29
应收清算款	-	-	-	28,609,797.97	28,609,797.97
资产总计	120,415,511.81	-	-	1,050,414,279.06	1,170,829,790.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,001,140.12	1,001,140.12
应付管理人报酬	-	-	-	1,411,887.22	1,411,887.22
应付托管费	-	-	-	235,314.55	235,314.55
其他负债	-	-	-	1,048,538.28	1,048,538.28
负债总计	-	-	-	3,696,880.17	3,696,880.17
利率敏感度缺口	120,415,511.81	-	-	1,046,717,398.89	1,167,132,910.70
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	189,469,168.65	-	-	-	189,469,168.65
存出保证金	179,463.38	-	-	-	179,463.38
交易性金融资产	-	-	-	1,266,974,671.49	1,266,974,671.49
应收申购款	-	-	-	109,050.71	109,050.71
其他资产	-	-	-	33,297.23	33,297.23
资产总计	189,648,632.03	-	-	1,267,117,019.43	1,456,765,651.46
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,386,506.69	8,386,506.69
应付赎回款	-	-	-	2,814,964.94	2,814,964.94
应付管理人报酬	-	-	-	3,464,932.62	3,464,932.62
应付托管费	-	-	-	294,357.50	294,357.50
其他负债	-	-	-	383,091.25	383,091.25
负债总计	-	-	-	15,343,853.00	15,343,853.00
利率敏感度缺口	189,648,632.03	-	-	1,251,773,166.43	1,441,421,798.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。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投资(含存托凭证)比例为基金总资产的 60%-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构

允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有资源优势的股票。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,021,632,093.80	87.53	1,266,974,671.49	87.90
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	1,021,632,093.80	87.53	1,266,974,671.49	87.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	59,170,160.34	72,833,606.73
	2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-59,170,160.34	-72,833,606.73

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,018,087,270.88	1,262,287,669.64
第二层次	1,126,306.41	380,229.35
第三层次	2,418,516.51	4,306,772.50
合计	1,021,632,093.80	1,266,974,671.49

6.4.14.2.2 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	1,021,632,093.80	87.26
	其中：股票	1,021,632,093.80	87.26
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	120,106,269.05	10.26
8	其他各项资产	29,091,428.02	2.48
9	合计	1,170,829,790.87	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	19,696,238.28	1.69
B	采矿业	1,332,303.44	0.11
C	制造业	739,332,342.27	63.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	25,351,013.16	2.17
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	133,578,673.00	11.45
J	金融业	46,918,092.60	4.02
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	54,386,248.62	4.66
M	科学研究和技术服务业	107,131.23	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	720,430.51	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.02
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,021,632,093.80	87.53

7.2.2 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港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	211,400	112,887,600.00	9.67
2	002920	德赛西威	648,400	95,963,200.00	8.22
3	300014	亿纬锂能	748,600	72,988,500.00	6.25
4	300919	中伟股份	588,900	72,964,710.00	6.25
5	688005	容百科技	473,214	61,252,820.16	5.25
6	688777	中控技术	808,782	58,846,978.32	5.04
7	605168	三人行	501,012	54,174,427.56	4.64
8	002049	紫光国微	279,742	53,072,652.24	4.55
9	002241	歌尔股份	1,403,400	47,154,240.00	4.04
10	300059	东方财富	1,847,169	46,918,092.60	4.02
11	301117	佳缘科技	759,916	42,501,711.50	3.64
12	300699	光威复材	685,240	40,340,078.80	3.46
13	600519	贵州茅台	19,000	38,855,000.00	3.33
14	002812	恩捷股份	154,112	38,597,350.40	3.31
15	002291	星期六	1,617,700	31,965,752.00	2.74
16	002230	科大讯飞	751,600	30,980,952.00	2.65
17	301263	泰恩康	729,382	25,351,013.16	2.17
18	002714	牧原股份	356,364	19,696,238.28	1.69
19	688082	盛美上海	206,859	19,604,027.43	1.68
20	000977	浪潮信息	590,000	15,623,200.00	1.34
21	688167	炬光科技	104,709	15,575,463.75	1.33
22	002709	天赐材料	184,500	11,450,070.00	0.98
23	688800	瑞可达	47,173	5,958,421.63	0.51
24	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.11
25	301238	瑞泰新材	32,411	1,201,600.41	0.10
26	301150	中一科技	4,026	365,898.42	0.03
27	301109	军信股份	18,376	312,961.26	0.03
28	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
29	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.02
30	301266	宇邦新材	5,161	279,894.51	0.02
31	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.02
32	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
33	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
34	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.02
35	301102	兆讯传媒	6,414	211,821.06	0.02

36	301153	中科江南	3,973	196,933.29	0.02
37	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
38	300834	星辉环材	6,349	191,974.69	0.02
39	301120	新特电气	10,311	182,450.94	0.02
40	688206	概伦电子	6,000	182,400.00	0.02
41	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.02
42	301151	冠龙节能	7,025	161,883.22	0.01
43	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.01
44	301248	杰创智能	4,716	153,047.20	0.01
45	301148	嘉戎技术	5,153	133,358.10	0.01
46	301258	富士莱	2,942	132,548.81	0.01
47	301097	天益医疗	2,486	130,023.27	0.01
48	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.01
49	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
50	301237	和顺科技	2,610	116,160.66	0.01
51	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.01
52	301196	唯科科技	2,705	102,319.16	0.01
53	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.01
54	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.01
55	301110	青木股份	2,013	86,466.00	0.01
56	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.01
57	301158	德石股份	3,783	78,697.42	0.01
58	301228	实朴检测	3,721	76,823.46	0.01
59	301279	金道科技	2,956	73,863.56	0.01
60	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
61	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.01
62	301236	软通动力	1,515	47,540.70	0.00
63	301200	大族数控	829	43,041.68	0.00
64	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
65	301219	腾远钴业	410	36,006.20	0.00
66	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
67	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
68	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
69	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
70	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
71	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
72	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
73	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
74	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
75	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
76	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
77	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00

78	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
79	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
80	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
81	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	110,274,924.44	7.65
2	002241	歌尔股份	79,358,127.66	5.51
3	002920	德赛西威	76,400,310.38	5.30
4	300919	中伟股份	71,403,080.14	4.95
5	688777	中控技术	60,293,722.57	4.18
6	300014	亿纬锂能	59,899,878.87	4.16
7	300059	东方财富	59,869,660.11	4.15
8	688005	容百科技	57,522,823.31	3.99
9	605168	三人行	53,860,386.00	3.74
10	002049	紫光国微	51,603,748.63	3.58
11	002230	科大讯飞	35,237,849.58	2.44
12	301117	佳缘科技	34,829,682.80	2.42
13	600519	贵州茅台	32,945,176.89	2.29
14	002812	恩捷股份	30,966,528.53	2.15
15	002291	星期六	29,759,519.99	2.06
16	601717	郑煤机	27,432,479.48	1.90
17	301263	泰恩康	23,250,512.19	1.61
18	301006	迈拓股份	21,832,639.22	1.51
19	300122	智飞生物	20,728,473.80	1.44
20	688082	盛美上海	19,045,524.54	1.32

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	603896	寿仙谷	115,395,665.93	8.01
2	002311	海大集团	110,224,936.40	7.65
3	688696	极米科技	107,966,772.11	7.49
4	002714	牧原股份	97,599,366.45	6.77
5	688383	新益昌	63,158,552.90	4.38
6	688580	伟思医疗	59,599,386.26	4.13
7	300799	左江科技	59,446,456.50	4.12

8	002415	海康威视	55,332,309.00	3.84
9	002614	奥佳华	38,716,672.02	2.69
10	301002	崧盛股份	36,089,306.04	2.50
11	688793	倍轻松	31,370,026.29	2.18
12	688026	洁特生物	24,107,066.36	1.67
13	601717	郑煤机	23,705,455.78	1.64
14	300059	东方财富	22,945,149.40	1.59
15	002241	歌尔股份	22,828,489.00	1.58
16	603658	安图生物	21,604,296.50	1.50
17	301006	迈拓股份	17,642,988.52	1.22
18	301029	怡合达	17,163,105.89	1.19
19	300122	智飞生物	16,897,402.42	1.17
20	605369	拱东医疗	14,768,557.00	1.02

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	1,041,688,074.21
卖出股票收入（成交）总额	1,071,128,759.80

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指买卖成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	309,242.76
2	应收清算款	28,609,797.97
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	172,387.29
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,091,428.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
55,825	11,622.48	90,498,347.20	13.95	558,326,650.88	86.05

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,079.67	0.0003

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 4 月 15 日) 基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	587,574,681.47
本报告期基金总申购份额	97,819,077.10
减：本报告期基金总赎回份额	36,568,760.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	648,824,998.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

(1) 根据宝盈基金管理有限公司第六届董事会第五次会议决议，同意马永红不再担任宝盈基金管理有限公司董事长，严震担任宝盈基金管理有限公司董事长；

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资

基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(2) 根据宝盈基金管理有限公司股东会 2022 年第一次会议决议，同意马永红、陈格不再担任宝盈基金管理有限公司董事，陈赤、邹纯余担任宝盈基金管理有限公司董事；陈林不再担任宝盈基金管理有限公司监事，兰敏担任宝盈基金管理有限公司监事；

(3) 根据宝盈基金管理有限公司第六届监事会第四次会议决议，同意陈林不再担任宝盈基金管理有限公司监事会主席，兰敏担任宝盈基金管理有限公司监事会主席。

2、报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
申万宏源	1	698,972,812.37	33.45	638,353.48	33.43	-
中金公司	2	613,629,448.83	29.37	559,202.19	29.29	-
东北证券	1	381,654,531.82	18.26	348,729.81	18.26	-
信达证券	1	233,501,217.07	11.17	214,643.40	11.24	-
长江证券	3	77,480,583.16	3.71	71,383.44	3.74	-
国海证券	1	52,751,811.36	2.52	48,072.75	2.52	-
安信证券	2	20,025,944.35	0.96	18,449.04	0.97	-
国金证券	2	11,596,792.69	0.55	10,567.42	0.55	-
浙商证券	2	21,049.47	0.00	19.39	0.00	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- ① 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- ③ 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- ④ 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- ⑤ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- ⑥ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询
服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交
易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

① 租用交易单元情况

新租浙商证券上海、深圳交易单元各一个；新租国融证券上海、深圳交易单元各一个；新租

长江证券北交所交易单元一个。

② 退租交易单元情况

退租长城证券上海、深圳交易单元各一个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯信息科技有限公司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	2022-06-20
2	宝盈基金管理有限公司关于新增博时财富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	2022-06-14
3	宝盈基金管理有限公司关于新增洪泰财富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	2022-06-07
4	宝盈基金管理有限公司关于新增鼎信汇金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	2022-05-13
5	宝盈基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2022-05-06
6	宝盈资源优选混合型证券投资基金 2022 年第 1 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	2022-04-22
7	宝盈基金管理有限公司旗下 53 只基金 2022 年第 1 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	2022-04-22
8	宝盈基金管理有限公司旗下公募基金产品基金转换费用的业务规则说明	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	2022-04-18

		网站	
9	宝盈资源优选混合型证券投资基金 2021 年年度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
10	宝盈基金管理有限公司旗下 50 只基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-03-30
11	宝盈基金管理有限公司关于新增华瑞保险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	2022-03-29
12	宝盈基金管理有限公司关于董事长 (法定代表人) 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	2022-03-25
13	宝盈基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2022-03-25
14	宝盈基金管理有限公司关于新增排排网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	2022-03-22
15	宝盈基金管理有限公司关于增加申万宏源证券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	证券日报, 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-22
16	宝盈基金管理有限公司关于新增北京中植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	2022-03-16
17	宝盈基金管理有限公司关于新增泰信财富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	2022-03-16
18	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投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	2022-03-10

		网站	
19	宝盈资源优选混合型证券投资基金更新招募说明书	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-02-23
20	宝盈资源优选混合型证券投资基金基金产品资料概要 (更新)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-02-23
21	宝盈资源优选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	2022-02-19
22	宝盈资源优选混合型证券投资基金 2021 年第 4 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	2022-01-24
23	宝盈基金管理有限公司旗下 52 只基金 2021 年第 4 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	2022-01-24
24	宝盈基金关于暂停杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2022-01-18
25	宝盈资源优选混合型证券投资基金第五次分红公告	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	2022-01-10
26	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金可参与北京证券交易所股票投资及相关风险揭示的公告	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	2022-01-07
27	宝盈资源优选混合型证券投资基金限制大额申购、转换转入、定期定额投资公告	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	2022-01-06
28	宝盈基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批复鸿飞基金的名称变更为宝盈资源优选股票型证券投资基金的文件。

根据《关于宝盈资源优选股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈资源优选股票型证券投资基金名称变更为宝盈资源优选混合型证券投资基金。

《宝盈资源优选混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈资源优选混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

12.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日