

宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈科技 30 混合
基金主代码	000698
交易代码	000698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 13 日
报告期末基金份额总额	797,966,300.49 份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于以科技创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月1日—2020年9月30日）
1. 本期已实现收益	323,947,633.53
2. 本期利润	217,648,026.92
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2483
4. 期末基金资产净值	2,254,806,643.98
5. 期末基金份额净值	2.826

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

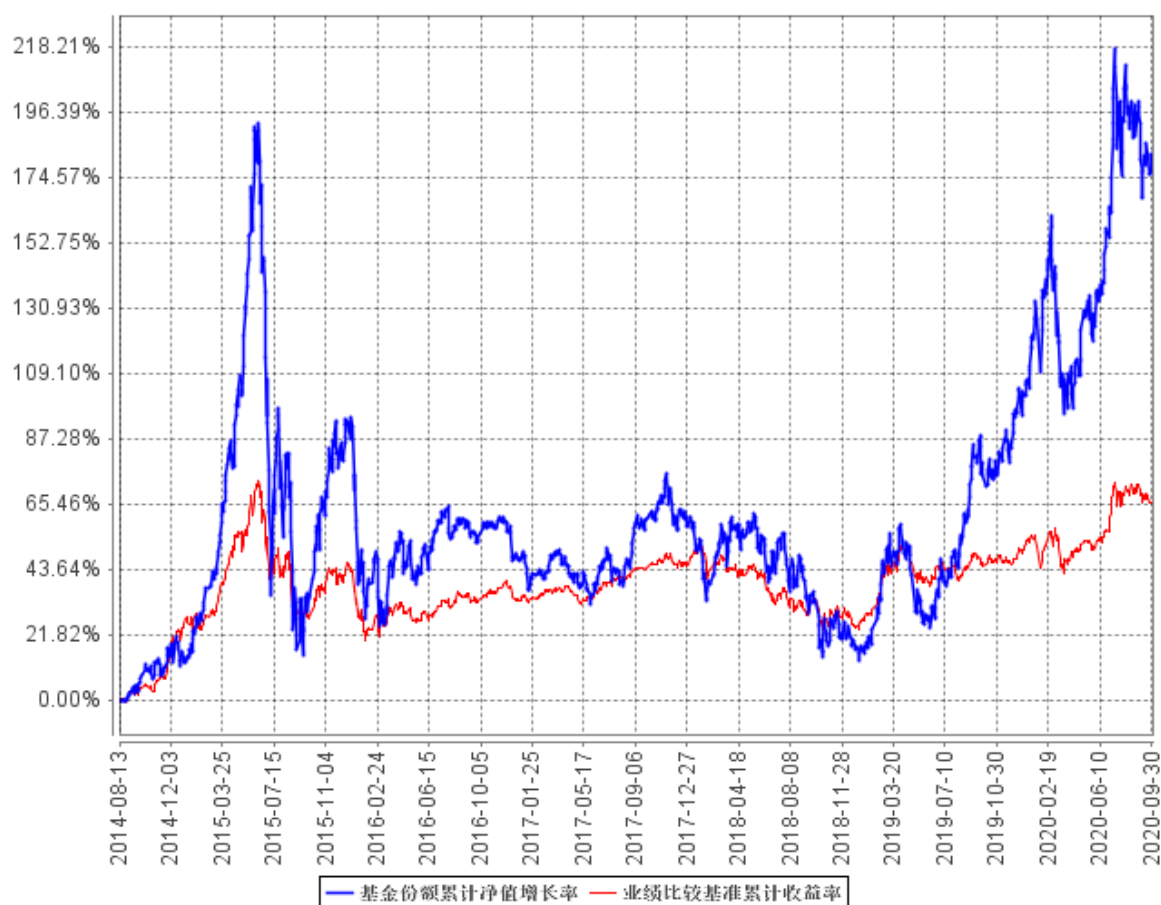
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	6.88%	2.27%	5.30%	0.96%	1.58%	1.31%
过去六个月	42.94%	2.11%	13.75%	0.79%	29.19%	1.32%
过去一年	61.49%	2.15%	14.42%	0.84%	47.07%	1.31%
过去三年	76.07%	1.94%	15.13%	0.80%	60.94%	1.14%
过去五年	111.05%	1.89%	29.91%	0.79%	81.14%	1.10%
自基金合同 生效起至今	182.60%	2.15%	65.84%	0.93%	116.76%	1.22%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张仲维	本基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金、宝盈人工智能主题股票型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈创新驱动股票型证券投资基金、宝盈发展新动能股票型证券投资基金的基金经理	2016年9月21日	-	10年	张仲维先生，台湾政治大学国际贸易硕士。曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司国际部研究员、基金经理，华润元大基金管理有限公司研究员、基金经理；自2015年5月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员、投资经理。中国台湾籍，证券投资基金从业人员资格。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年三季度沪深 300 指数上涨 10.17%，创业板指数上涨 5.6%。新冠疫情一季度在国内爆发，二季度在海外的蔓延造成宏观及行业较大的波动。随着疫情逐渐控制，国内开始复工复产，A 股市场在二季度末与三季度初出现较大幅度反弹。叠加国际关系形势变化的影响，国防军工板块在三季度涨幅领先。行业上来看（以中信一级行业），第三季度国防军工和消费者服务分别上涨 32.02%和 26.56%；跌幅较大的行业为商贸零售和通信，分别下跌 3.05%和 8.03%。疫情之下，龙头公司竞争优势壁垒显现，各行业龙头公司份额加速集中。报告期内，本基金持仓优选集中在各细分领域中的龙头公司。此外，我们认为疫情只是延后科技产业的发展，不改 5G 带来科技行业的发展大周期。

本基金主要投资科技行业中高增长的公司，报告期内基金重点布局消费电子、半导体、新能源汽车、云计算和电商直播等相关板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.826 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.88%，业绩比较基准收益率为 5.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,114,175,931.65	93.36
	其中：股票	2,114,175,931.65	93.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,410.40	0.00
	其中：债券	1,410.40	0.00
	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	147,718,046.21	6.52
8	其他资产	2,767,019.72	0.12
9	合计	2,264,662,407.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,528,683,763.99	67.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,708.88	0.00
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	158,007.10	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	33,256.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	465,512,450.07	20.65

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	652.37	0.00
M	科学研究和技术服务业	180,995.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	78,654.94	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	119,491,413.26	5.30
S	综合	-	-
	合计	2,114,175,931.65	93.76

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	938,326	196,297,799.20	8.71
2	002475	立讯精密	3,191,200	182,313,256.00	8.09
3	601689	拓普集团	4,300,000	172,000,000.00	7.63
4	688111	金山办公	500,000	165,000,000.00	7.32
5	002241	歌尔股份	3,920,000	158,485,600.00	7.03
6	600745	闻泰科技	1,316,100	153,799,446.00	6.82
7	002371	北方华创	900,000	143,154,000.00	6.35
8	300413	芒果超媒	1,772,200	119,446,280.00	5.30
9	002812	恩捷股份	1,300,000	118,911,000.00	5.27
10	300792	壹网壹创	704,480	97,838,182.40	4.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,410.40	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,410.40	0.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	8	1,410.40	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除恩捷股份和拓普集团的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

(1) 恩捷股份。因公司于 2018 年 8 月 3 日擅自将海关监管减免税货物挤出设备等共计 25 台（货物价值 16,914.45 万元）抵押给银行，中华人民共和国斗门海关于 2020 年 6 月 13 日根据

《中华人民共和国海关行政处罚实施条例》对珠海恩捷处以罚款 85 万元。

本基金认为上述事项因公司经营过程对相关法律法规的适用未做出审慎决策所致，该事项发生于 2018 年，且公司经营未造成明显影响，不影响公司长期投资价值。在关注恩捷股份公司业务发展的同时，本基金也会加强关注公司在法务团队与制度建设方面的完善改进。

(2) 拓普集团。2020 年 8 月 1 日，因公司堆放杂物堵塞疏散通道，辽宁省沈阳市沈北新区公安消防大队处以罚款 1.12 万元。

本基金认为上述事项对公司正常经营未造成实质影响，不影响公司长期投资价值。在关注拓普集团公司业务发展的同时，本基金也会加强关注公司在安全生产管理制度方面的完善改进。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,160,748.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,939.09
5	应收申购款	1,572,331.78
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,767,019.72

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,096,896,749.73
报告期期间基金总申购份额	155,834,461.99
减：报告期期间基金总赎回份额	454,764,911.23
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

报告期期末基金份额总额	797,966,300.49
-------------	----------------

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

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

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

9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2020 年 10 月 28 日