

# 宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月25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2022年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	宝盈中债3-5年国开行债券指数
基金主代码	011958
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月2日
报告期末基金份额总额	80,265,799.51份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资策略。
业绩比较基准	中债-3-5年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司

基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 A	宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 C
下属分级基金的交易代码	011958	011959
报告期末下属分级基金的份额总额	80,092,610.88 份	173,188.63 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 A	宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 C
1. 本期已实现收益	852,423.95	547.44
2. 本期利润	1,407,967.64	-609.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0155	-0.0071
4. 期末基金资产净值	81,863,399.40	176,953.34
5. 期末基金份额净值	1.0221	1.0217

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 A

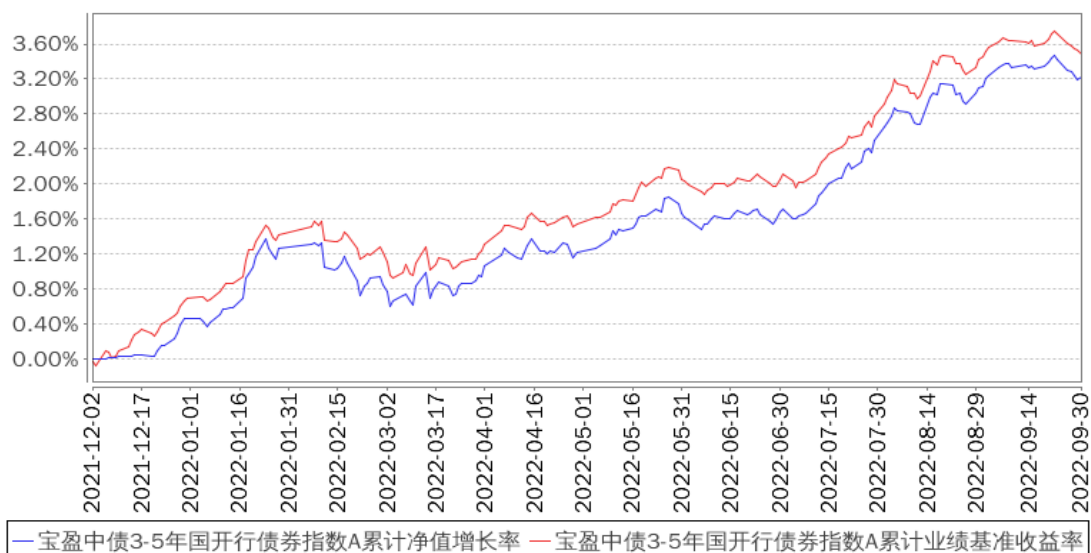
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.51%	0.07%	1.40%	0.07%	0.11%	0.00%
过去六个月	2.25%	0.07%	2.22%	0.06%	0.03%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.22%	0.08%	3.48%	0.07%	-0.26%	0.01%

宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 C

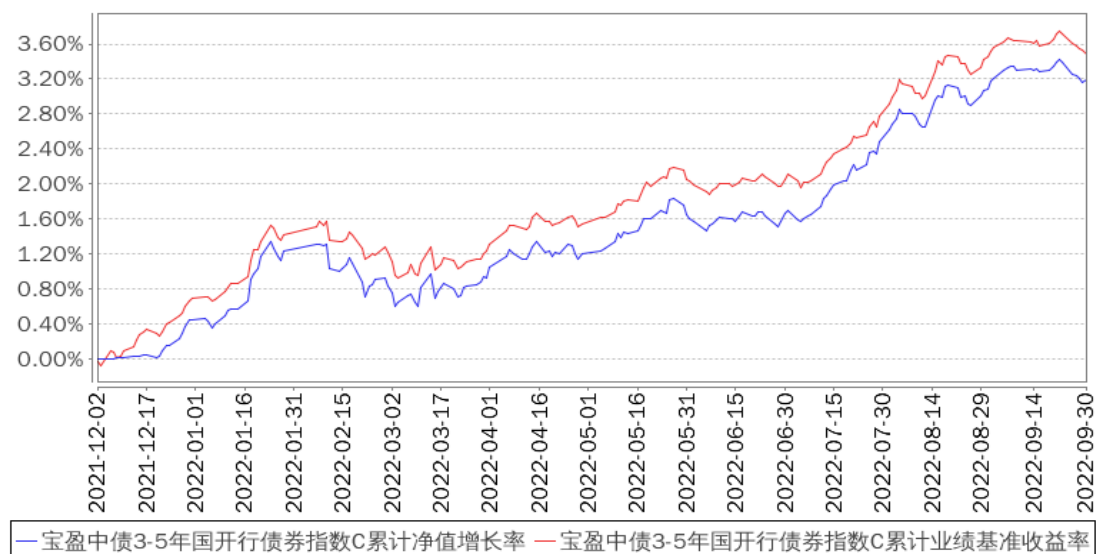
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.49%	0.07%	1.40%	0.07%	0.09%	0.00%
过去六个月	2.23%	0.07%	2.22%	0.06%	0.01%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.18%	0.08%	3.48%	0.07%	-0.30%	0.01%

### 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

宝盈中债3-5年国开行债券指数A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



宝盈中债3-5年国开行债券指数C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、本基金合同于2021年12月2日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

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符合基金合同中的相关约定。

## § 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		
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、宝盈祥颐定期开放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、宝盈祥乐一年持有期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、宝盈祥琪混合型证券投资基金基金经理	2021年12月2日	-	10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，宝盈中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年3季度，全球疫情仍在持续演变，外部环境严峻复杂，国内经济总体延续恢复发展态势，但仍面临压力。消费方面，1-8月社会消费品零售总额累计同比仅增长0.5%。投资方面，房地产投资仍面临下行压力，1-8月房地产开发投资同比收缩7.4%；基建投资显著提速，8月全口径基建投资同比增长15.4%，创年内新高；制造业投资仍保持强劲，1-8月制造业累计同比增长10.0%。进出口方面，8月出口金额同比增速较5-7月17.6%的平均水平下降至7.1%，进口金额同比增速回落至0.3%。通胀方面，主要工业品价格同比增速逐月下行，8月居民消费价格略低于预期。金融市场整体稳定，股市震荡下行，上证指数下跌11.01%，深圳成指下跌16.42%，创业板指下跌18.56%。长端美债收益率先下后上，因核心通胀超预期。10年期国债先下后上，中美利差持续倒挂。3-5年期国开债下行后震荡，其中3年期国开债收至2.39%附近，5年期国开债收至2.65%附近，5-3年期国开债利差较2季度末走扩。

报告期内，本基金严格遵守基金合同约定，跟踪标的指数变化，未来将保持组合流动性，控制跟踪误差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 A 的基金份额净值为 1.0221 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.51%;截至本报告期末宝盈中债 3-5 年国开行债券指数 C 的基金份额净值为 1.0217 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.49%。同期业绩比较基准收益率为 1.40%。

#### 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,266,293.19	99.69
	其中:债券	91,266,293.19	99.69
	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	277,027.57	0.30
8	其他资产	5,499.14	0.01
9	合计	91,548,819.90	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

#### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

##### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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	4,538,885.53	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	86,727,407.66	105.71
	其中：政策性金融债	86,727,407.66	105.71
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	91,266,293.19	111.25

#### 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	160210	16国开10	440,000	45,640,983.01	55.63
2	160213	16国开13	300,000	30,629,753.42	37.33
3	210203	21国开03	100,000	10,456,671.23	12.75
4	019674	22国债09	32,000	3,229,603.07	3.94
5	019679	22国债14	10,000	1,004,417.53	1.22

#### 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国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。



### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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除 16 国开 10、16 国开 13、21 国开 03 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2022 年 3 月 25 日，根据银保监罚决字(2022)8 号，国家开发银行存在监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送违法违规行为，未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；未报送债券投资业务 EAST 数据；漏报权益类投资业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据；漏报保函业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；漏报分户账 EAST 数据；漏报授信信息 EAST 数据；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；理财产品登记不规范等问题，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，处以 440 万元罚款。

我们认为相关处罚措施对国家开发银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对国家开发银行的债券偿还影响很小。本基金投资 16 国开 10、16 国开 13、21 国开 03 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,499.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,499.14

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈中债 3-5 年国开行债券 指数 A	宝盈中债 3-5 年国开行债 券指数 C
报告期期初基金份额总额	129,614,241.27	4,570.88
报告期期间基金总申购份额	1,954.27	636,160.91
减：报告期期间基金总赎回份额	49,523,584.66	467,543.16
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	80,092,610.88	173,188.63

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220701-20220930	79,999,000.00	-	-	79,999,000.00	99.6700
	2	20220701-20220719	49,523,573.69	-	49,523,573.69	-	-
产品特有风险							

本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，在极端情况下可能存在流动性等风险，敬请投资人留意。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金注册的文件。

《宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》。

《宝盈中债 3-5 年国开行债券指数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：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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

### 9.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人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 10 月 26 日