

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资  
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	宝盈国家安全沪港深股票
基金主代码	001877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	725,359,977.69 份
投资目标	本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和金融衍生品投资策略四部分组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服</p>

	<p>务等；（3）信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。</p> <p>（三）固定收益类资产投资策略</p> <p>在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。</p> <p>（四）金融衍生品投资策略</p> <p>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。</p> <p>本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p>
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	宝盈国家安全沪港深股票 A   宝盈国家安全沪港深股票 C

下属分级基金的交易代码	001877	013613
报告期末下属分级基金的份额总额	706,806,688.89 份	18,553,288.80 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）	
	宝盈国家安全沪港深股票 A	宝盈国家安全沪港深股票 C
1. 本期已实现收益	-9,669,785.24	-283,460.36
2. 本期利润	-122,704,407.74	-3,346,658.51
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1696	-0.1813
4. 期末基金资产净值	873,830,070.67	22,812,677.39
5. 期末基金份额净值	1.2363	1.2296

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

宝盈国家安全沪港深股票 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.24%	1.46%	-13.34%	0.73%	1.10%	0.73%
过去六个月	-12.60%	1.64%	-9.72%	0.96%	-2.88%	0.68%
过去一年	-26.24%	1.50%	-19.08%	0.97%	-7.16%	0.53%
过去三年	47.53%	1.63%	-2.67%	1.00%	50.20%	0.63%
过去五年	28.92%	1.60%	-2.69%	0.99%	31.61%	0.61%
自基金合同生效起至今	23.63%	1.49%	14.53%	0.93%	9.10%	0.56%

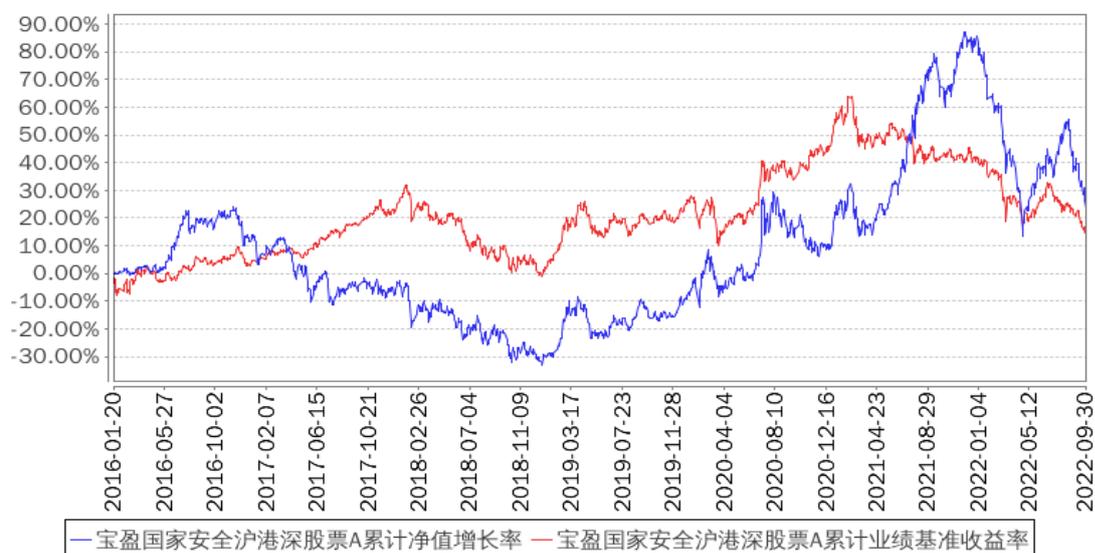
宝盈国家安全沪港深股票 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-12.37%	1.46%	-13.34%	0.73%	0.97%	0.73%
过去六个月	-12.86%	1.64%	-9.72%	0.96%	-3.14%	0.68%
过去一年	-26.65%	1.50%	-19.08%	0.97%	-7.57%	0.53%
自基金合同 生效起至今	-28.63%	1.52%	-18.76%	0.97%	-9.87%	0.55%

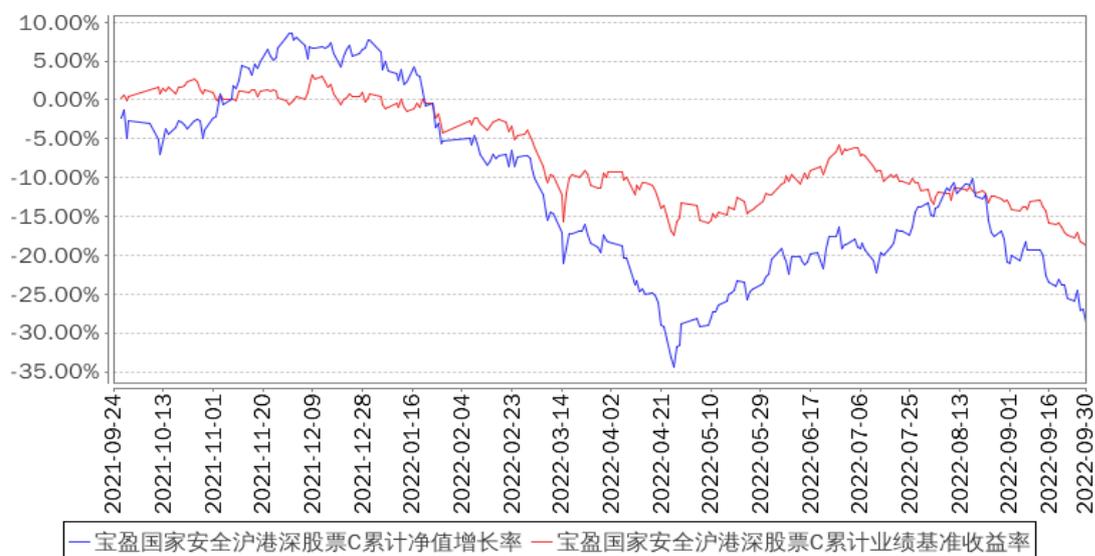
注：本基金于 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈国家安全沪港深股票 C”。

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

宝盈国家安全沪港深股票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



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

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈金伟	本基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈成长精选混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 11 月 21 日	-	8 年	陈金伟先生，北京大学金融学硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司研究员，2015 年 2 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

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

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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

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

其次，我们比较看重估值的重要性，估值的重要性在于即使判断出现失误，损失也是有限的，高估值意味着苛刻的假设，这些假设在长时间看来未必是能够实现的，尤其是时间越长，看错的可能性就越大，我们比较看重估值也是认识到自身研究的局限性，接受自己的不完美。

再次，我们认同产业趋势的价值，产业趋势意味着增量市场空间，在增量市场下，企业更有

可能实现扩张避免陷入内卷，但产业趋势确定性不等同于公司的确定性，尤其是确定的产业趋势会带来确定的供给增加，确定的供给增加会冲击现有公司的确定性，因此我们把产业趋势放在相对靠后的位置。

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

对于投资者，选择流动性更差且不确定性更高的小盘股，往往基于三点比较优势：一是部分公司在同等长期成长性基础上具有更高性价比；二是部分公司在景气上行阶段具有更大盈利弹性；三是流动性角度的股价弹性。

我们最看重第一点，偶尔看中第二点，完全不看重第三点（但会因为第三点阶段性受益或受损）。由于我们更看重第一点，因此在景气方向的仓位暴露不足，从结果上看，今年从年初到目前虽然仍是中证 1000/国证 2000 跑赢沪深 300/上证 50 的市场，但是今年小市值机会更聚焦于新旧能源等景气赛道，而并非“百花齐放”。

基于“好公司>低估值>高景气”的框架，在各行业盈利趋势都向上的周期中，即使我们没有刻意追求景气，客观上股价也受到了景气度的加持；但今年景气的方向更为稀缺，小盘股的行情更为收敛，集中于新老能源等少数领域，因此我们持仓的非新老能源领域成长股表现不佳。

基于以上因素，我们在心理上部分接纳了自己的不佳表现，我们也不认为底层投资方法需要什么改变，但是我们认为在技术层面至少有两方面需要改进：

一是优化组合风险收益特征：我们在行业上做了分散，但是对个股（尤其是流动性一般的小盘股）在极端流动性风险下的波动率考虑不足。我们考虑了在行业以及左/右侧等角度做均衡，也考虑了买入和卖出的冲击成本，但是忽略了组合整体在极端流动性风险下的波动性。小市值公司在极度乐观和极度悲观情况下都是没有合理定价的，在极度乐观情况下（如 7 月底 8 月初），一部分热门赛道小市值公司的估值可以用匪夷所思来形容。但在当下以及 4 月底，一部分非热门赛道小市值公司也因为流动性缺失，造成个股定价失效。而当我们的组合过度暴露在非景气（短期低胜率）以及小市值（高波动）两方面的时候，组合的波动超出我们最初的设想。从最纯粹的投资角度，这种极端环境带来的下跌是机会，但是从代人理财的资产管理行业属性角度，高波动无疑会影响持有人的体验。

二是有一小部分标的买到了盈利周期高点，而没有通过跟踪及时修正。我们一再强调追求景气度带来的当期表现盈利增长并不是真正意义上的“成长”，因此没有刻意追逐热门赛道。但即使是非热门赛道，在某些特定阶段下，他们的中短期盈利增长，也很大程度上来自于外部因素，所以我们也买到了一些“价值陷阱”，这一部分公司大部分业绩增长来自于外因，表现增速看起来很高，表现估值看起来很低，但实际上并不足够优秀。

往后看，除少数热门赛道，大部分公司都处在盈利周期和估值的低位。因为这一点，我们对未来有信心，因为虽然市场普遍认为今年小市值相对强，但是仅限于景气赛道，随着未来盈利的修复，我们的持仓整体上在长期成长性和估值方面是具备比较优势的。随着规模的稳定，我们也将更多精力转向原有持仓的跟踪，这是我们相对薄弱的一环，我们需要通过更紧密的跟踪（但并非景气赛道高频行业数据）来不断修正对公司的判断。

基于乐观者的视角，产业趋势并不存在所谓“均值回归”，新兴产业的未来是星辰大海，以静态视角看问题无疑会错失伟大的投资机会。但另一方面，虽然产业趋势不存在均值回归，但是企业的盈利却存在均值回归，未来市场空间、伟大企业天花板可以“涨到天上”，这是常识；但是任何行业任何企业的资产回报率不会“涨到天上”，这也是常识。我们并不否认热门赛道的投资机会，无论是估值高低还是交易是否拥挤，都不应该是卖出的理由，只是我们会反复问自己两个问题：

1. 一是从长期角度：基于我们对热门赛道的肤浅研究和认知，能否在变化快速且竞争日趋激烈的行业中，看透相对长期（3年以上）谁会最终胜出，并能在波动中坚定长期持有；

2. 二是从短期角度：基于我们对于热门赛道慵懒的跟踪，我们能否在这个高频数据不断变化，且相当多数据并不可预判的行业中，把握短期（周度以内）的高频变化并能短期有效应对。

我们认为一些优秀的投资者能做到以上两点中至少一点，但是令我们持有人失望的是，我们自己不能。

我们看好新能源衍生出来的机会，市场上对“新能源+”存在一定偏见，一种主流观点简单将“新能源+”等同于低估值的传统行业借助新能源热点的估值提升，甚至将这一类标的视为主题炒作。我们对这种观点持保留态度。我们将“新能源+”分为三种类型：第一类是原有业务毫无竞争力，历史上从未证明过自己，近两年“突然”转型新能源，这一类标的和我们的框架没有任何关系，不在我们考虑范围内，我们既不打算相信，也不打算“揣着明白装糊涂”假装相信，因为我们没法保证自己是“明白”的那一个；第二类是原有业务具有较强竞争力，在原来行业证明过自身能力，切入新能源领域，但是在新能源领域的竞争优势相比原有公司并不显著，这一类我们选择性参与，选择的标准在于估值是否具有显著优势；第三类是在原有领域积累了很强的竞争优势，包括技术、渠道等，而新能源行业在技术进步过程中，用到了这一类公司之前就擅长的技术或其他资源，这一类公司在这一领域其实具有降维打击的优势，这一类公司甚至没有主动“拥抱”新能源，而是新能源“拥抱”这一类公司，这一类公司是我们希望找到的。

我们看好受多重因素压制的 TMT（主要是计算机和电子）和地产产业链，这一点不再赘述。

除了我们一直看好市值下沉的机会，一些领域龙头公司的机会也在慢慢浮现，包括医药、电

子、计算机等，从胜率、赔率和流动性角度综合考虑，我们也会增加对这一部分公司的研究。

展望未来一年左右时间，我们对于绝对收益和相对收益都非常乐观。在一季度末泥沙俱下的行情下，我们曾展望对绝对收益乐观，对相对收益不乐观，当下我们对绝对收益、相对收益都非常乐观，虽然当前指数点位和一季度末类似，都处于低位，但是这是综合考虑我们持仓公司所处盈利周期位置、长期成长性和估值水平，对比市场主流品种，做出的判断。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈国家安全沪港深股票 A 的基金份额净值为 1.2363 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.24%；截至本报告期末宝盈国家安全沪港深股票 C 的基金份额净值为 1.2296 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.37%。同期业绩比较基准收益率为-13.34%。

#### 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	823,231,434.58	90.93
	其中：股票	823,231,434.58	90.93
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	74,081,384.63	8.18
8	其他资产	8,028,359.68	0.89
9	合计	905,341,178.89	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,798.44 元，占净值比为 0.00%。

### 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

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	737,817,959.20	82.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,301,336.00	0.48
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,679.98	0.00
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	51,556,285.65	5.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	25,058,493.00	2.79
M	科学研究和技术服务业	4,339,308.87	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	80,950.84	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,155.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,467.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	823,223,636.14	91.81

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非周期性消费品	7,798.44	0.00
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	7,798.44	0.00

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	605166	聚合顺	2,776,700	37,346,615.00	4.17
2	300687	赛意信息	1,390,086	33,236,956.26	3.71
3	601677	明泰铝业	1,788,911	32,522,401.98	3.63
4	688665	四方光电	307,971	31,336,049.25	3.49
5	300833	浩洋股份	324,125	30,347,823.75	3.38
6	603662	柯力传感	2,124,868	30,258,120.32	3.37
7	600529	山东药玻	1,042,832	30,210,843.04	3.37
8	688685	迈信林	1,443,345	29,833,941.15	3.33
9	688199	久日新材	885,586	29,295,184.88	3.27
10	601369	陕鼓动力	2,996,910	28,081,046.70	3.13

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	438,210.41
2	应收证券清算款	7,359,117.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	231,032.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,028,359.68

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈国家安全沪港深股票 A	宝盈国家安全沪港深股票 C
报告期期初基金份额总额	744,189,681.18	18,218,627.01
报告期期间基金总申购份额	14,164,888.21	2,630,336.89
减：报告期期间基金总赎回份额	51,547,880.50	2,295,675.10
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	706,806,688.89	18,553,288.80

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,963,029.22
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,963,029.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.82

### 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

中国证监会准予宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

## 9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日