

宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资  
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 12 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	宝盈国证证券龙头指数发起式
基金主代码	015859
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 12 日
报告期末基金份额总额	19,341,300.53 份
投资目标	本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制策略进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p>
业绩比较基准	国证证券龙头指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指

	数基金，具有与标的指数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	宝盈国证证券龙头指数发起式 A	宝盈国证证券龙头指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	015859	015860
报告期末下属分级基金的份额总额	14,153,385.65 份	5,187,914.88 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 12 日（基金合同生效日）-2022 年 9 月 30 日）	
	宝盈国证证券龙头指数发起式 A	宝盈国证证券龙头指数发起式 C
1. 本期已实现收益	176,955.67	49,116.98
2. 本期利润	-1,541,647.25	-474,429.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1062	-0.1111
4. 期末基金资产净值	12,641,425.85	4,631,183.53
5. 期末基金份额净值	0.8932	0.8927

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。

4、本基金合同生效日为 2022 年 7 月 12 日，截至本报告期末本基金合同生效不足一季度。

#### 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

宝盈国证证券龙头指数发起式 A

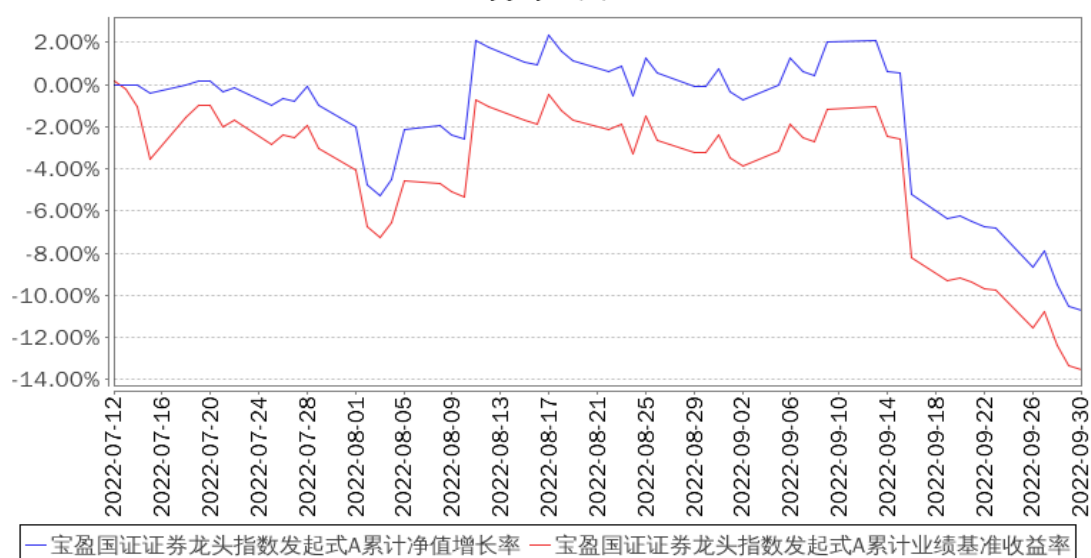
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-10.68%	1.35%	-13.50%	1.42%	2.82%	-0.07%

宝盈国证证券龙头指数发起式 C

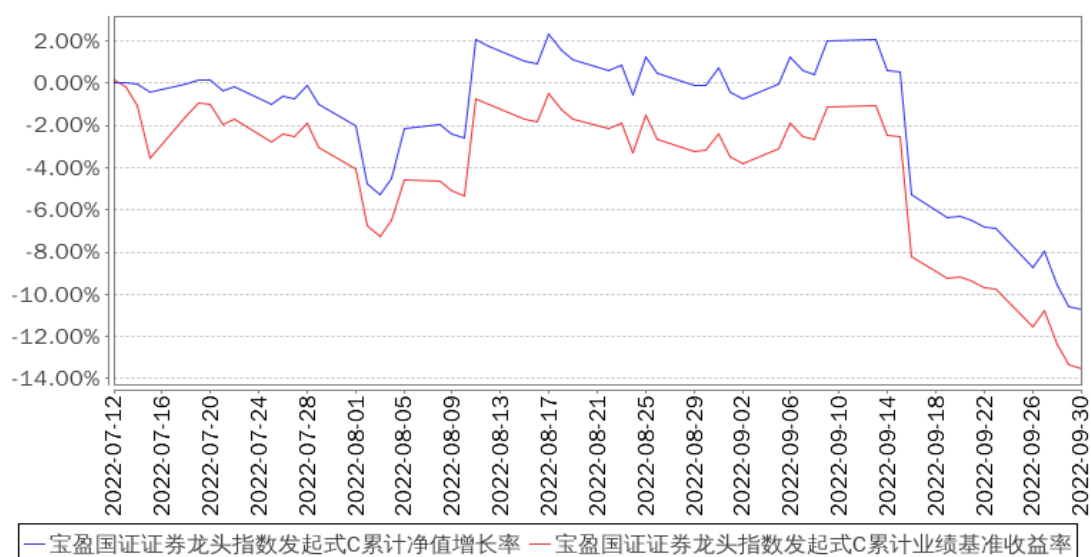
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-10.73%	1.35%	-13.50%	1.42%	2.77%	-0.07%

### 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

宝盈国证证券龙头指数发起式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



宝盈国证证券龙头指数发起式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 2022 年 7 月 12 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。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将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		
蔡丹	本基金、宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金基金经理	2022 年 7 月 12 日	-	12 年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任宝盈策略增长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。

#### 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

本基金于 2022 年 7 月 12 日成立，之后进入建仓阶段，于 2022 年 9 月 21 日开放申赎。

在完成建仓后，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，用量化方法来跟踪和控制偏离度，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

9 月 16 日，科创板首批做市商名单出炉，作为科创板建设中的一项重要交易制度安排，引入做市商机制有助于进一步提升科创板股票流动性、增强市场韧性，促进科创板的长远健康发展。对于券商而言，做市商制度的推出有助于延伸券商原有的投行业务服务链条，提升资金利用效率，有效盘活券商资产，增厚业绩并改善业绩稳定性。

9 月 27 日，国常会召开，确定对政策支持、商业化运营的个人养老金予以税收优惠：缴费期每年 12000 元的限额予以税前扣除、积累期投资收益暂不征税、领取期实际税负由 7.5% 降为 3%。个人养老金税收政策落地，体现国家对推动支柱养老金发展大力支持的态度，在居民老龄化程度上升养老需求不断上涨、国家对市场化运营养老金发展大力支持双重驱动下，居民财富持续入市，长期资金来源占比不断提升已成为确定性趋势，为各类养老金融产品提供广阔的发展空间。

最近一年多以来，随着国内疫情反复、地缘冲突、全球主要央行加快收紧货币政策等风险事件扰动，市场风险偏好降低，二级市场情绪低迷。国证证券龙头指数从 2021 年 12 月 9 日起震荡下跌，截止本季末累计下跌幅度达到 32.25%。本季末，指数最新 PE 为 14.18 倍，位于历史以来 10.38% 的分位数，指数最新 PB 为 1.23 倍，位于历史以来 4.98% 的分位数水平，估值处于较低水平，具有较高的安全边际。从长期看，资本市场改革持续深化，财富管理赛道长逻辑未变，龙头券商在资本实力、风险管理能力、研究定价能力、业务协同能力方面均有优势。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈国证证券龙头指数发起式 A 的基金份额净值为 0.8932 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.68%；截至本报告期末宝盈国证证券龙头指数发起式 C 的基金份额净值为 0.8927 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.73%。同期业绩比较基准收益率为-13.50%。

### 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	16,257,810.00	93.03
	其中：股票	16,257,810.00	93.03
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	1,058,344.68	6.06
8	其他资产	159,860.99	0.91
9	合计	17,476,015.67	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
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	-	-
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	-	-
J	金融业	16,257,810.00	94.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-

S	综合		
	合计	16,257,810.00	94.12

### 5.2.2 报告期末积极投资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积极投资的境内股票。

### 5.2.3 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 报告期末指数投资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	600030	中信证券	139,400	2,428,348.00	14.06
2	300059	东方财富	116,100	2,045,682.00	11.84
3	601688	华泰证券	127,700	1,547,724.00	8.96
4	000776	广发证券	87,400	1,247,198.00	7.22
5	600999	招商证券	95,900	1,183,406.00	6.85
6	600958	东方证券	153,100	1,177,339.00	6.82
7	601377	兴业证券	193,940	1,056,973.00	6.12
8	600837	海通证券	107,500	930,950.00	5.39
9	601108	财通证券	100,200	677,352.00	3.92
10	601788	光大证券	40,000	526,000.00	3.05

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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。

## 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和流动性风险，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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

### 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除海通证券、中信证券、光大证券、招商证券的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2021 年 10 月 14 日，根据重庆监管局《行政处罚决定书》（[2021]5 号），海通证券在执行奥瑞德 2017 年度持续督导过程中，未对奥瑞德违规对外担保事项保持充分关注，仅执行了询问及检

查“三会”记录、用印记录等程序，未获取当期奥瑞德企业信用报告并保存于奥瑞德持续督导工作底稿中，未对当期奥瑞德企业信用报告进行必要的审阅和查看，导致未能发现奥瑞德违规对外提供担保事项，未能发现奥瑞德相关信息披露存在遗漏；奥瑞德及其子公司涉及民间借贷事项违法违规，海通证券在奥瑞德已公告公司及子公司涉及借款纠纷被提起诉讼的情况下，未保持合理职业怀疑对奥瑞德涉及的民间借贷事项进行充分核查和验证，仅获取了奥瑞德董事会出具的书面声明等内部证据，未获取相关借款合同、起诉状、法院相关法律文书等外部客观证据，未执行向法院及案件代理律师等第三方进行核查的工作程序，未通过法院庭审公开网等公开渠道检索有关案件信息，导致未能发现奥瑞德未依法披露其相关重大借款合同及实际控制人占用奥瑞德资金；奥瑞德未将上述借款纠纷所涉及的借贷资金记入财务账簿，其 2017 年度财务报表存在虚假记载，且对相关借款、向控股股东、实际控制人提供资金的关联交易和违规提供对外担保等重大事项均未按法律相关规定履行临时信息披露义务，也未在 2017 年年度报告中披露上述事项，海通证券未充分履行持续督导义务，涉嫌存在未能勤勉尽责情形，在 2018 年 5 月 2 日出具并由奥瑞德在 2018 年 5 月 4 日披露的《2017 年度现场检查报告》和《2017 年度持续督导意见》存在虚假记载等问题。因违反 2005 年《证券法》第一百七十三条规定，依据 2005 年《证券法》第二百二十三条的规定，责令海通证券改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；对李春、贾文静给予警告，并分别处以 5 万元罚款。

2022 年 1 月 18 日，根据全国股转公司《关于给予海通证券股份有限公司及相关责任主体纪律处分的情况公示》，存在缺乏有效的内控机制；相关责任人在持续督导过程中未做到诚实守信、勤勉尽责等问题，因违反《全国中小企业股份转让系统主办券商持续督导工作指引》及相关业务规则的规定，对海通证券通报批评；对倪煜、张瑞华公开谴责；对陈若琪公开谴责，暂不受理其出具的业务文件三十六个月，并向相关部门出具监管建议函。

2022 年 3 月 1 日，根据江西证监局《关于对中信证券股份有限公司江西分公司采取责令增加内部合规检查次数措施的决定》，存在负责人强制离岗期间审批了 OA 系统流程，实际代为履职人员与向监管部门报告的情况不一致，违反了《证券公司分支机构监管规定》（证监会公告〔2020〕66 号修订）第十四条第一款、第二款的规定；部分办公电脑未按要求及时录入 CRM 员工交易地址监控维护系统，无法提供 OA 系统代为履职授权记录，违反了《证券公司内部控制指引》（证监机构字〔2003〕260 号）第七条第一项的规定；增加经营场所未及时向监管部门报告，违反了《证券公司分支机构监管规定》第九条的规定；向风险等级高于其风险承受能力的投资者发送产品推介短信的情形，违反了《证券期货投资者适当性管理办法》（证监会令〔2020〕177 号）第二十二条第（三）项的规定；融资融券合同、股票期权经纪合同、投资者开户文本未采取领用、登记控制，

未采取连号控制、作废控制，保管人与使用人未分离，违反了《证券公司内部控制指引》第十三条第（一）项、第二十三条的规定；部分柜台业务存在客户开户资料重要信息填写缺失、《法定代表人授权委托书》缺少等问题，违反了《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告〔2010〕11号）第三条第（一）项、第（二）项的规定；合规经营存在问题、内部控制不完善等问题。因违反《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第166号修订）第六条的规定，按照《证券公司监督管理条例》第七十条及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条的规定，决定责令中信证券股份有限公司在本决定下发之日起1年内，每6个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日内，向江西证监局报送合规检查报告。

2021年11月16日，根据中国证券监督管理委员会发布的《关于对光大证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》，光大证券存在以下违规行为：一是融资融券业务授信管理不审慎、风控措施执行不到位。2020年9月，大幅上调多名客户的两融授信额度，但未对大额资金来源合理性、客户风险承担能力和违约可能性予以充分评估；公司风险管理部门关于压降高风险标的股票两融负债的要求未被有效执行。二是风险全覆盖存在不足。光大证券尚未实现对光大资本、光大发展、光大租赁3家子公司及香港子公司的系统对接。三是风险数据不准确，信息录入缺乏复核勾稽。信用风险管理系统对融资融券信用风险敞口数据采集不准确，场外衍生品合约的名义本金数据存在人工录入错误。据此责令光大证券改正。

2022年3月1日，根据上海证券交易所《关于对光大证券股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》，光大证券在信息披露方面存在以下违规行为：重大合同披露不及时，未披露公司全资子公司光大资本向招商银行、瑞华银行出具《差额补足函》等事项；重大诉讼事项进展披露不及时，未及时披露光大资本分别就招商银行诉光大资本案、华瑞银行诉光大资本案一审判决向上海市高级人民法院提出上诉；重大交易披露不完整，公司在资产购买及后续进展公告中未完整披露光证金控对新鸿金融集团的认沽义务及对应的履约保障等事项。据此，上交所作出纪律处分决定：对光大证券以及时任董事长兼总裁薛峰予以通报批评。

2022年9月19日，招商证券股份有限公司收到了中国证监会《行政处罚决定书》（〔2022〕50号），主要内容如下：

招商证券作为中安科重大资产重组的独立财务顾问，履职过程中未勤勉尽责，导致出具的《独立财务顾问报告》存在误导性陈述，且后续在并购重组当事人发生较大变化对本次重组构成较大影响的情况时未能予以高度关注，未按照规定及时向中国证监会报告，违反了《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》（证监会令第54号）（以下简称《财务顾问管理办法》）第三条、第十九条第四项、第二十八条第五项之规定和2005年《证券法》第二十条第二款和第一百七十三条之

规定，中国证监会依法责令招商证券改正违法行为，没收业务收入 3,150 万元，并处以 3,150 万元罚款。

我们认为相关处罚措施对海通证券、中信证券、光大证券、招商证券的正常经营会产生一定影响，但影响可控。本基金投资海通证券、中信证券、光大证券、招商证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	159,860.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	159,860.99

### 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

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	宝盈国证证券龙头指数发起式 A	宝盈国证证券龙头指数发起式 C
基金合同生效日(2022年7月12日)基金	14,543,214.65	4,231,118.26

份额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	38,749.98	1,465,831.46
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	428,578.98	509,034.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	14,153,385.65	5,187,914.88

## § 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

基金合同生效日(2022年7月12日)管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	51.70

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	10,000,000.00	51.70	10,000,000.00	51.70	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	51.70	10,000,000.00	51.70	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20220712-20220930	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	51.7000
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。							

### 9.2 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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金注册的文件。

《宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金基金合同》。

《宝盈国证证券龙头指数型发起式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。

### 10.2 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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

### 10.3 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