

宝盈祥和 9 个月定期开放混合型
证券投资基金
2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 1 月 22 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 2025 年 1 月 21 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 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 宝盈祥和 9 个月定开混合 |
| 基金主代码 | 010747 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 4 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 24,964,788.90 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金采取稳健的投资策略，在控制下行风险的前提下，确定大类资产配置比例，通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益，适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略和存托凭证投资策略组成。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市 |

| | | |
|-----------------|---|---------------|
| | 场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 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 | 宝盈祥和9个月定开混合A | 宝盈祥和9个月定开混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010747 | 010748 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,967,037.29份 | 4,997,751.61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（2024年10月1日-2024年12月31日） | |
|-----------------|-----------------------------|--------------|
| | 宝盈祥和9个月定开混合A | 宝盈祥和9个月定开混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 810,034.05 | 195,530.51 |
| 2. 本期利润 | 709,803.26 | 170,645.17 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0355 | 0.0341 |
| 4. 期末基金资产净值 | 21,147,326.57 | 5,235,666.81 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0591 | 1.0476 |

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

宝盈祥和9个月定开混合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 | 3.47% | 0.38% | 1.75% | 0.43% | 1.72% | -0.05% |
| 过去六个月 | 5.16% | 0.35% | 7.24% | 0.41% | -2.08% | -0.06% |
| 过去一年 | 4.10% | 0.35% | 11.50% | 0.35% | -7.40% | 0.00% |

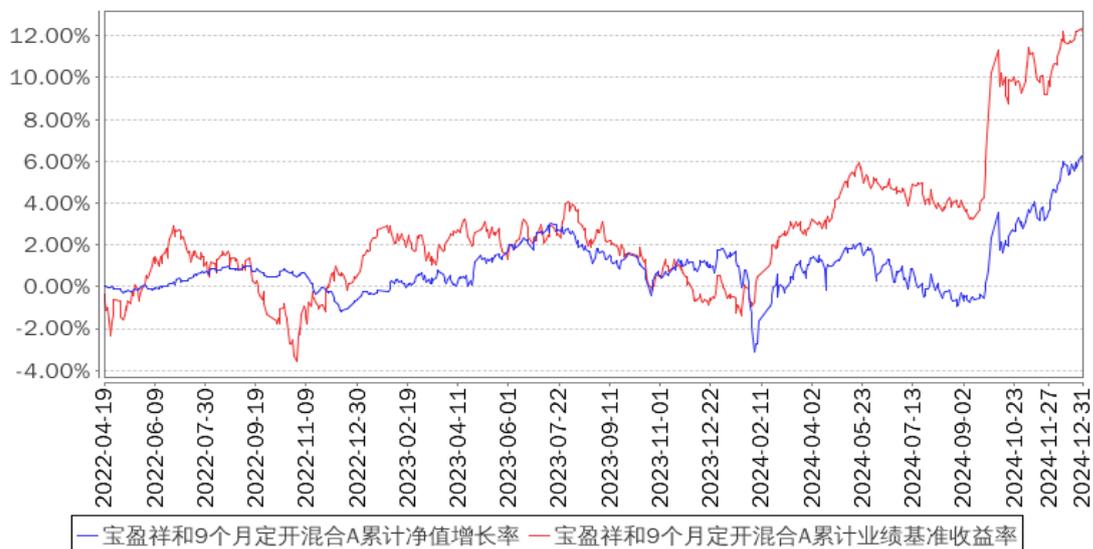
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 5.91% | 0.24% | 12.13% | 0.32% | -6.22% | -0.08% |
|------------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|

宝盈祥和9个月定开混合C

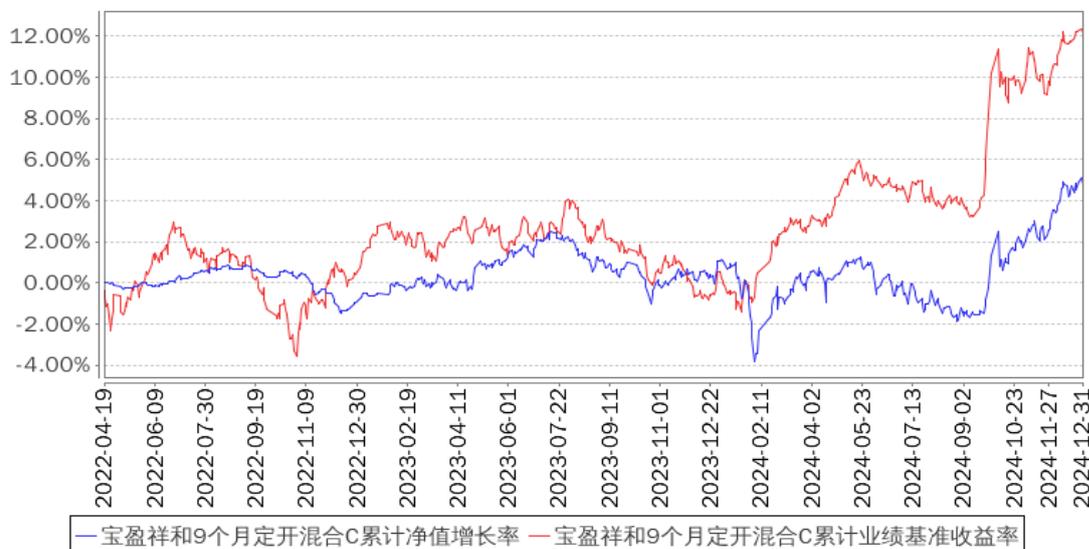
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.36% | 0.38% | 1.75% | 0.43% | 1.61% | -0.05% |
| 过去六个月 | 4.96% | 0.35% | 7.24% | 0.41% | -2.28% | -0.06% |
| 过去一年 | 3.68% | 0.35% | 11.50% | 0.35% | -7.82% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.76% | 0.24% | 12.13% | 0.32% | -7.37% | -0.08% |

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

宝盈祥和9个月定开混合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



宝盈祥和9个月定开混合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



§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 | | 说明 |
|----|---|-------------|------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | |
| 邓栋 | 本基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放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、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；固定收益部总经理 | 2022年4月19日 | - | 14年 邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008年3月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自2010年1月至2017年8月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017年8月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
| 蔡丹 | 本基金、宝盈中证A100指数增强型证券投资基金、宝盈宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥庆9个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥瑞增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金、宝盈华证龙头红利50指数型发起式证券投资基金、宝盈新锐灵活配 | 2023年2月18日 | - | 14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，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

| | | | |
|---|--|--|--|
| 置混合型证券投资基金、宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金经理；量化投资部总经理 | | | |
|---|--|--|--|

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遵规守信情况的说明

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

国内宏观来看，12 月制造业 PMI 指数下行，主要是受季节性因素影响，但在存量政策和一揽子增量政策持续发力显效推动下，当月制造业 PMI 指数连续三个月处于扩张区间，加之近期建筑业、服务业 PMI 指数整体上行，都显示四季度经济景气度明显好于三季度。海外来看，11 月初特朗普赢得美国大选，政策方向上更加注重呵护美国经济、政治在全球的领先地位。对于移民政策和通胀问题更加关注，将制造业、基础设施建设、能源行业作为经济重要发展支柱，美国再通胀压力加大，降息节奏预期放缓。9 月 24 日，国新办就金融支持经济高质量发展举行新闻发布会，发布会上多项重磅政策宣布推出，包括降低存款准备金率和政策利率、降低存量房贷利率和统一

房贷最低首付比例、创设新的货币政策工具支持股票市场稳定发展等。国庆假期期间，投资者情绪高涨，节后首个交易日大幅高开，上证综指于10月8日创出年内最高点3674.40点，随后低走，后续指数维持震荡走势。季末上证综指收于3351.76点，季度上涨0.46%。

在9.24组合拳后，市场交投活跃，本季度两市日均成交1.82万亿，是上个季度的2.7倍，10月8日当天两市成交达到3.45万亿，创历史新高。美联储12月19日鹰派降息25BP，为年内第三次降息，联储通胀和经济预期同步上修，本季度美元相对人民币升值4.03%，季末美元兑人民币即期汇率达到7.2988，位于2015年以来98.58%的分位数。

从市场走势来看，本季度多数指数下跌，中小盘表现好于大盘：国证2000上涨6.2%，中证1000上涨4.36%，中证500下跌0.3%，中证800下跌1.62%，沪深300下跌2.06%，上证50下跌2.56%，中证红利下跌2.07%，中证A100下跌3.54%。分行业来看，中信一级行业有14个行业上涨，涨幅前五的行业：商贸零售（上涨21.25%）、电子（上涨13.07%）、计算机（上涨12.87%）、通信（上涨7.3%）和传媒（上涨7.03%）；跌幅排前的五个行业：有色金属（下跌8.65%）、煤炭（下跌8.18%）、食品饮料（下跌8.04%）、房地产（下跌7.88%）和医药（下跌7.69%）。

从价值成长风格来看，本季度价值风格要略好于成长风格，国证成长下跌3.45%，国证价值下跌1.82%；中证2000上涨8.4%，沪深300下跌2.06%，小盘表现好于大盘。

当前来看，A股主要指数的估值水平处于历史中位数附近，但从基于股息率计算的股权风险溢价来看，还处于历史中位数以上水平。截止2024/12/31中证800指数的PE为14.33X，股息率为2.72%，处于历史87.53%的分位数水平。

报告期内，本基金严格遵守基金合同约定，将绝大多数资产配置在固收类资产上，其余部分配置了价值成长均衡型组合。

海外来看，当前美国经济韧性较强，通胀粘性不低，CPI在首次降息后连续两个月反弹，同时鲍威尔及美联储官员态度逐步转鹰，预计2025年降息2次。特朗普的移民、关税和去监管政策或先落地，对通胀带来扰动，我们预计美元资产整体仍强。国内来看，12月政治局会议提出，2025年将实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，并首次提及“加强超常规逆周期调节”等，部分措辞历史少见，我们认为当前的政策基调已经明确，明年经济刺激的力度和进度或超预期，我们对国内经济修复前景保持乐观。

2024年全年，债券市场呈现出大等级别的牛市行情，十年国债下行接近100bp，三十年国债下行幅度更大，整体收益率曲线呈现出陡峭化下行的走势。从市场节奏上来看，市场收益率下行最快阶段为一季度和年末，而三季度在稳增长政策发力时市场收益率出现一定程度的上行。信用债走势基本跟随利率债走势，收益率也大幅度下行，信用利差变化有些滞后，信用利差年初至三

季度调整前一直压缩，三季度调整信用利差扩张后，年末行情中信用利差继续被动拉开。

展望 2025 年，在增量政策不断推出的刺激下，经济基本面将逐渐企稳，但整体政策仍然是以托底经济为目的，刺激方向也是落实在消费和高质量发展上，很难推动经济大幅向上修复，同时中美贸易关系的冲突在特朗普正式上台后存在较大的不确定性，对外需和出口有较大的负面影响，对经济企稳回升存在负向作用。政策方面，比较明确的是宽松的货币政策与积极的财政政策相配合，货币宽松先行，所以 2025 年仍处于降准降息的周期中，但由于汇率的压力，降准降息的时间和幅度可能会低于预期。

对于债券市场而言，2025 年应该还是处于牛市阶段，市场收益率中枢也将进一步下行，但由于 2024 年底市场抢跑严重，透支了较多的降息预期，所以对于收益率下行的幅度要适当降低预期，同时债券市场已经进入了绝对利率较低的环境，预期市场的波动度会进一步加大，债券市场投资难度进一步加大。

债券方面，本基金以利率债和银行二级债为主要配置，少量配置偏债型大盘银行转债。报告期间，增配交易所长期国债，拉长久期，提升组合进攻性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥和 9 个月定开混合 A 的基金份额净值为 1.0591 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.47%；截至本报告期末宝盈祥和 9 个月定开混合 C 的基金份额净值为 1.0476 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.36%。同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。为降低基金投资者负担，切实保障投资者利益，本基金本报告期内下列固定费用由基金管理人承担：信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、IOPV 计算与发布费（如有）、注册登记费、指数使用费（如有）等。

§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 | 4,426,742.00 | 16.70 |
| | 其中：股票 | 4,426,742.00 | 16.70 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 21,235,773.64 | 80.09 |
| | 其中：债券 | 21,235,773.64 | 80.09 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 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 | 846,657.73 | 3.19 |
| 8 | 其他资产 | 4,487.27 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 26,513,660.64 | 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

| 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 | 277,571.00 | 1.05 |
| C | 制造业 | 2,964,505.00 | 11.24 |
| 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 | 146,493.00 | 0.56 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 455,680.00 | 1.73 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 582,493.00 | 2.21 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 4,426,742.00 | 16.78 |

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

| 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 | 300154 | 瑞凌股份 | 20,100 | 220,296.00 | 0.83 |
| 2 | 601919 | 中远海控 | 10,600 | 164,300.00 | 0.62 |
| 3 | 301345 | 涛涛车业 | 2,400 | 158,640.00 | 0.60 |
| 4 | 002970 | 锐明技术 | 3,300 | 157,179.00 | 0.60 |
| 5 | 603558 | 健盛集团 | 14,500 | 156,020.00 | 0.59 |
| 6 | 605166 | 聚合顺 | 13,000 | 155,610.00 | 0.59 |
| 7 | 688093 | 世华科技 | 7,600 | 153,444.00 | 0.58 |
| 8 | 603508 | 思维列控 | 6,300 | 149,814.00 | 0.57 |
| 9 | 002517 | 恺英网络 | 11,000 | 149,710.00 | 0.57 |
| 10 | 603600 | 永艺股份 | 12,500 | 148,625.00 | 0.56 |

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 | 7,906,508.22 | 29.97 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 8,273,121.75 | 31.36 |
| | 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） | 5,056,143.67 | 19.16 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 21,235,773.64 | 80.49 |

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 | 019743 | 24 国债 11 | 75,000 | 7,906,508.22 | 29.97 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 22,800 | 2,573,126.79 | 9.75 |
| 3 | 110059 | 浦发转债 | 22,780 | 2,483,016.88 | 9.41 |
| 4 | 092280069 | 22 华夏银行二级资本债 01 | 20,000 | 2,089,929.86 | 7.92 |
| 5 | 2128036 | 21 平安银行二级 | 20,000 | 2,080,249.42 | 7.88 |

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 21 平安银行二级的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2024 年 5 月 17 日，国家金融监督管理总局网站发布的金罚决字〔2024〕6 号行政处罚决定书显示，平安银行存在五大违法违规事实。一、治理与内部控制方面，包括个别高管人员未经任职资格核准实际履职，同一股东实质提名董事超比例，部分岗位绩效薪酬延期支付比例低于监管要求，未按监管规定审查审批重大关联交易等。二、信贷业务方面，包括向关系人发放信用贷款，违规发放并购贷款、流动资金贷款、个人贷款，流动资金贷款、个人贷款用途不合规，授信责任认定后问责不到位等。三、同业业务方面，包括违规接受第三方金融机构信用担保，分支机构承

担非标投资信用风险，通过同业投资掩盖资产损失、延缓风险暴露、提供土地储备融资，违规垫付某产品赎回资金，同业非标投资业务未计足风险加权资产，以贵金属产业基金模式融出资金违规用于股权投资等。四、理财业务方面，包括违规向理财产品提供融资、虚构风险缓释品、未计提风险加权资产，代客理财资金用于本行自营业务，理财产品相互交易，理财产品信息披露不合规，理财投资“名股实债”类资产未计入非标债权类资产投资统计，结构性存款业务实质是“假结构”等。五、部分非现场监管统计数据与事实不符，银行承兑汇票保证金来源于贷款资金，未对投保人进行需求分析与风险承受能力测评等。依据相关法律法规，国家金融监督管理总局对平安银行做出行政处罚决定，没收违法所得并处罚款合计 6723.98 万元。

我们认为相关处罚措施对平安银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对平安银行的债券偿还影响很小。本基金投资 21 平安银行二级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 | 4,487.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,487.27 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 2,573,126.79 | 9.75 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 2,483,016.88 | 9.41 |

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

| 项目 | 宝盈祥和9个月定开混合A | 宝盈祥和9个月定开混合C |
|---------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 19,967,037.29 | 4,997,751.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 19,967,037.29 | 4,997,751.61 |

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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祥和9个月定期开放混合型证券投资基金注册的文件。

《宝盈祥和9个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥和9个月定期开放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

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。

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

2025年1月22日