

宝盈创新驱动股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈创新驱动股票
基金主代码	009491
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 10 日
报告期末基金份额总额	1, 210, 879, 262. 29 份
投资目标	本基金主要投资于创新驱动主题相关的证券，在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略和股指期货投资策略。其中创新驱动主题的界定如下：</p> <p>党的十八大提出实施创新驱动发展战略，强调科技创新是提高社会生产力和综合国力的战略支撑，必须摆在国家发展全局的核心地位。具体到本基金而言，创新驱动是指主要通过技术创新引领发展的企业，以及通过技术创新与制度创新、管理创新、商业模式创新、业态创新和文化创新的结合，进而推动其向依靠持续的知识积累、技术进步和劳动力素质提升转变的企业。</p> <p>参照《国家创新驱动发展战略纲要》对创新驱动发展战略所涵盖重点产业的总体布局，本基金拟投资上市公司主要包括：</p> <p>（1）通过技术创新，加快工业化和信息化深度融合，把数字化、网络化、智能化、绿色化作为核心竞争力的上市公司，包括但不限于发展新一代信息网络</p>

	<p>技术、发展智能绿色制造技术、发展安全清洁高效的现代能源技术、发展资源高效利用和生态环保技术、发展智慧城市和数字社会技术、发展先进有效、安全便捷的健康技术、发展引领产业变革的颠覆性技术的上市公司。</p> <p>(2)通过其他多种创新方式给企业带来实质性生产力和效率提升的上市公司，如产品创新、服务创新、管理创新、营销创新、流程创新、组织与制度创新、商业模式创新、市场创新等。包括受益于专利发明、激励模式、设计流程、营销模式、产业链整合优化等的上市公司。</p> <p>从行业角度看，与以上主题界定相关的行业包括但不限于电子、计算机、传媒、通信、电气设备、机械设备、国防军工、采掘、化工、汽车、家用电器、医药生物等。对于以上行业之外的其他行业，如果其中某些细分行业符合创新驱动的投资主题，本基金也将对这些细分行业的公司进行积极投资。</p> <p>未来如果由于经济发展、技术进步或政策调整造成创新驱动主题的覆盖范围发生变动，本基金将动态调整创新驱动主题所涉及的相关产业和上市公司范围。</p>	
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中证综合债券指数收益率×15%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈创新驱动股票 A	宝盈创新驱动股票 C
下属分级基金的交易代码	009491	009492
报告期末下属分级基金的份额总额	986,278,117.91 份	224,601,144.38 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（2021年7月1日—2021年9月30日）	
	宝盈创新驱动股票 A	宝盈创新驱动股票 C
1. 本期已实现收益	174,167,532.45	38,515,373.99

2. 本期利润	-25,846,606.08	-5,677,805.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0234	-0.0227
4. 期末基金资产净值	1,273,539,746.12	288,367,982.34
5. 期末基金份额净值	1.2913	1.2839

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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

宝盈创新驱动股票 A

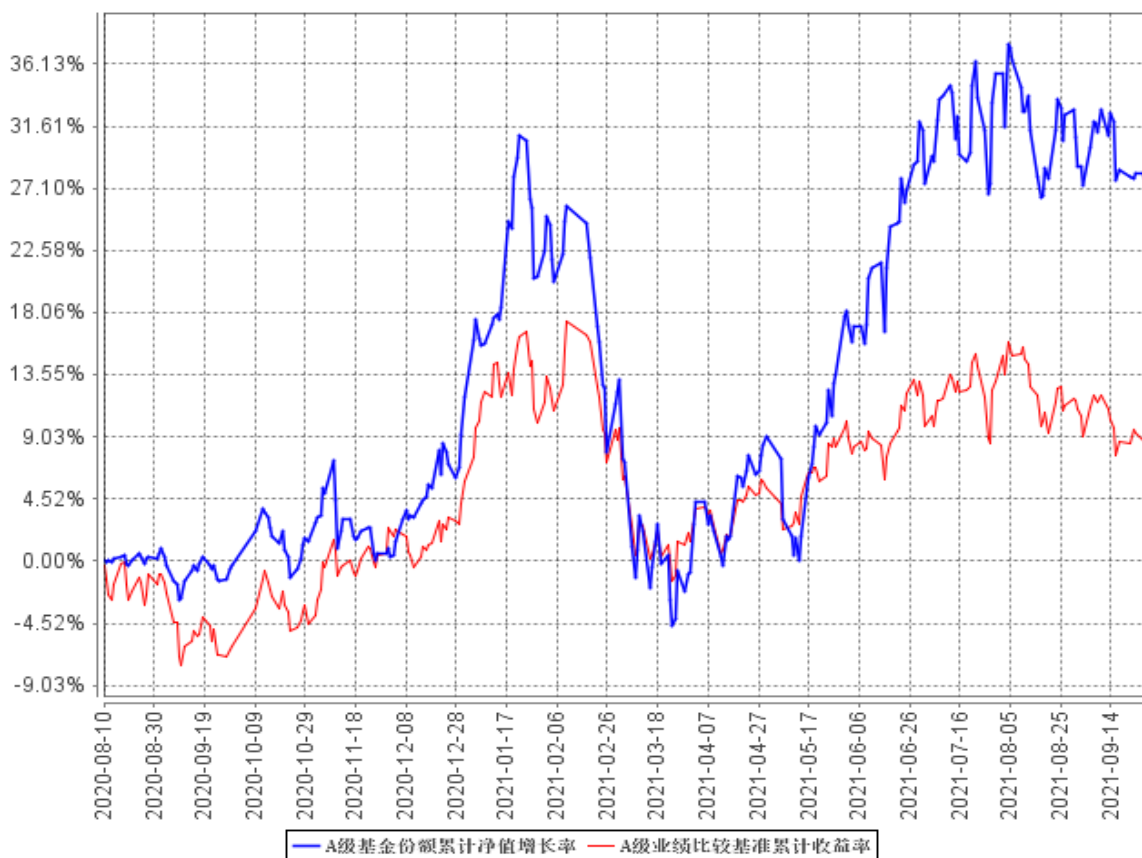
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.09%	1.74%	-4.25%	1.15%	2.16%	0.59%
过去六个月	30.24%	1.77%	6.69%	1.08%	23.55%	0.69%
过去一年	29.57%	1.80%	15.42%	1.19%	14.15%	0.61%
自基金合同生效起至今	29.13%	1.68%	8.21%	1.17%	20.92%	0.51%

宝盈创新驱动股票 C

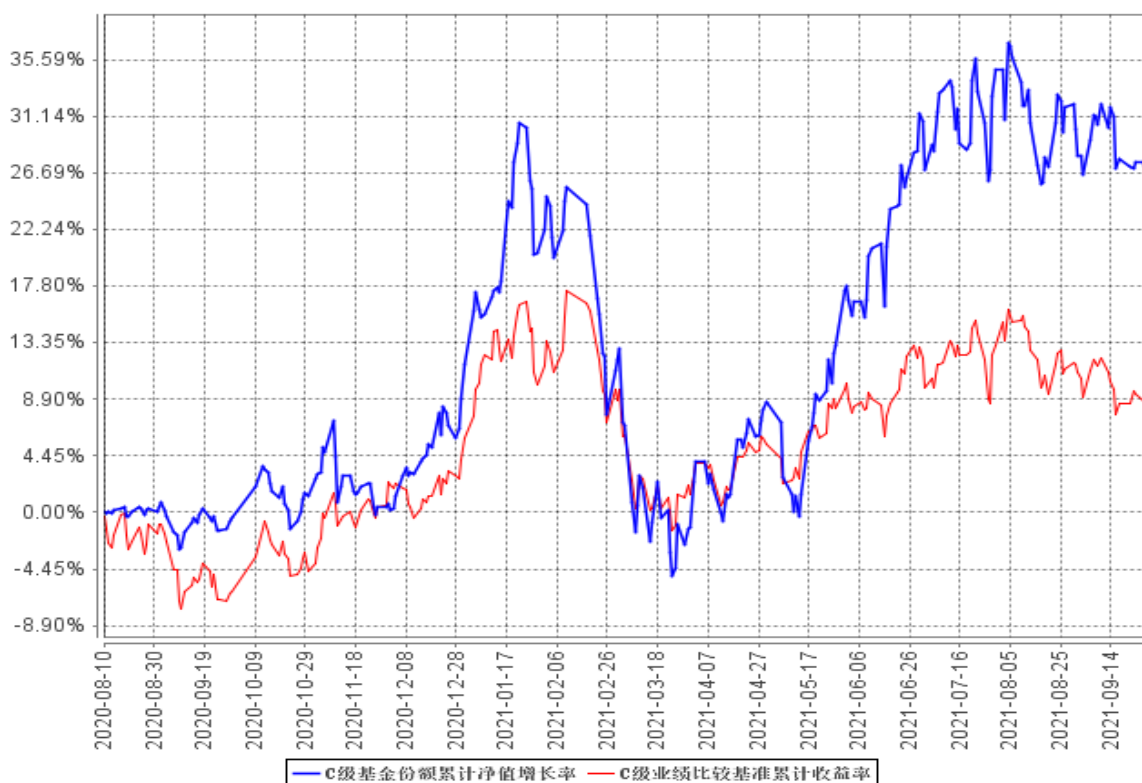
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.21%	1.74%	-4.25%	1.15%	2.04%	0.59%
过去六个月	29.91%	1.77%	6.69%	1.08%	23.22%	0.69%
过去一年	28.92%	1.80%	15.42%	1.19%	13.50%	0.61%
自基金合同生效起至今	28.39%	1.68%	8.21%	1.17%	20.18%	0.51%

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

A级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



C级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



注：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		
张仲维	本基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、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、宝盈发展新动能股票型证券投资基金、宝盈智慧生活混合型证券投资基金、宝盈研究精选混合型证券投资基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；海外投资部总经理	2020 年 8 月 10 日	-	11 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年三季度，沪深 300 指数下跌 6.85%，创业板指数下跌 6.69%。随着上市公司半年报业绩的披露，业绩兑现较好的优质标的出现快速反弹，同时以新能源和半导体为代表的高景气度行业整体业绩实现超预期增长、行业内优质公司涨幅较大。进入三季度，上游资源品价格上涨明显，导致中下游行业面临盈利收窄的风险，在滞涨风险担忧之下，整体市场出现震荡下行。行业上来看（以中信一级行业），三季度涨幅最大的为煤炭和有色金属板块，分别上涨 40.87%和 26.63%；跌幅较大的行业为医药和消费者服务板块，分别下跌 14.67%和 17.89%。

本基金主要投资于创新驱动主题行业中高增长的公司，本基金在报告期内下跌主因：我们重点持仓在原材料价格上涨的环境下，利润率受到压制，股价震荡下行。同时本基金在三季度对仓位进行了适当的调减操作，基金跌幅略小于沪深 300 和创业板指数。报告期内本基金重点布局新能源汽车及汽车电子供应链、光伏、半导体等相关板块。我们认为新能源行业作为全球产业重大趋势（包含新能源汽车和光伏）持续维持高速增长，除中国以外，欧洲、美国等国家也在大力推动行业的发展，这保证了行业未来的成长空间和成长速度，并且中国优质上市公司有望在全球范围内获得更高市场份额，这将保证重仓个股业绩有望持续高速增长。此外汽车电子、智能驾驶和半导体也都是未来长周期的产业趋势，相关优质公司将充分享受行业红利。因此我们坚定持有我们看好的方向与持仓，优选细分领域中的龙头公司，优质的公司通过业绩高速增长能消化较高的估值，终将实现股价的上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈创新驱动股票 A 基金份额净值为 1.2913 元，本报告期基金份额净值增长

率为-2.09%；截至本报告期末宝盈创新驱动股票 C 基金份额净值为 1.2839 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.21%；同期业绩比较基准收益率为-4.25%。

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	1,273,088,550.96	81.00
	其中：股票	1,273,088,550.96	81.00
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	296,521,670.37	18.87
8	其他资产	2,029,255.72	0.13
9	合计	1,571,639,477.05	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 150,955,716.61 元，占净值比为 9.66%。

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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	936,139,672.84	59.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,916.20	0.00
E	建筑业	18,114.41	0.00
F	批发和零售业	82,112.98	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,753,856.34	5.43
J	金融业	76,135,289.79	4.87
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	1,030,785.53	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	58,201.98	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	23,776,670.40	1.52
R	文化、体育和娱乐业	10,863.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,122,132,834.35	71.84

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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	34,664,285.38	2.22
C 消费者常用品	28,455,913.40	1.82
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	57,777,480.10	3.70
I 电信服务	30,058,037.73	1.92
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	150,955,716.61	9.66

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	300750	宁德时代	290,600	152,777,138.00	9.78
2	002709	天赐材料	903,633	137,460,651.96	8.80
3	002371	北方华创	364,206	133,186,492.14	8.53
4	002241	歌尔股份	2,225,242	95,907,930.20	6.14
5	300496	中科创达	676,931	84,744,991.89	5.43
6	300059	东方财富	2,215,167	76,135,289.79	4.87
7	002920	德赛西威	893,175	75,098,154.00	4.81
8	300274	阳光电源	492,200	73,032,636.00	4.68

9	601012	隆基股份	790,820	65,226,833.60	4.18
10	601689	拓普集团	1,644,613	59,929,697.72	3.84

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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，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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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未受到公开谴责、处罚。

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	720,854.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,211.42
5	应收申购款	1,283,189.91
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,029,255.72

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

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	宝盈创新驱动股票 A	宝盈创新驱动股票 C
报告期期初基金份额总额	1,402,044,617.35	304,112,496.11
报告期期间基金总申购份额	76,460,080.92	45,854,363.80
减：报告期期间基金总赎回份额	492,226,580.36	125,365,715.53
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	986,278,117.91	224,601,144.38

§ 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

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创新驱动股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈创新驱动股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈创新驱动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

基金托管人办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 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

2021 年 10 月 27 日