

宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 48 |
| 7.6 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 | 49 |

| | |
|---|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 49 |
| 7.8 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贵金属投资明细 | 49 |
| 7.9 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 | 49 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 49 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 49 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 50 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 53 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 54 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 54 |
| § 10 重大事件揭示 | 54 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 54 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 54 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 10.8 其他重大事件 | 57 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 59 |
| 11.1 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 | 59 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 59 |
| § 12 备查文件目录 | 60 |
| 12.1 备查文件目录 | 60 |
| 12.2 存放地点 | 60 |
| 12.3 查阅方式 | 60 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 宝盈祥利稳健配置混合 | |
| 基金主代码 | 008324 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 27 日 | |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 85,430,171.14 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 宝盈祥利稳健配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008324 | 008325 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 53,918,259.60 份 | 31,511,911.54 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 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产品收益。 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、存托凭证投资策略、国债期货投资策略和股指期货投资策略六个部分组成。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金、债券型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------------------------------|----------------------|
| 名称 | 宝盈基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张磊 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 |
| | 电子邮箱 | zhangl@byfunds.com |
| 客户服务电话 | 400-8888-300 | 95555 |
| 传真 | 0755-83515599 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | 518034 | 518040 |
| 法定代表人 | 严震 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------|------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
|----------------|------|

| | |
|---------------------|-----------------|
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|--------------------------|
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司 | 广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年01月01日-2022年06月30日) | |
|---------------|------------------------------|---------------|
| | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 宝盈祥利稳健配置混合 C |
| 本期已实现收益 | -3,631,694.58 | -2,628,744.54 |
| 本期利润 | -2,622,141.75 | -2,225,609.77 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0450 | -0.0585 |
| 本期加权平均净值利润率 | -4.02% | -5.25% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.07% | -3.21% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 5,680,537.59 | 3,055,610.53 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1054 | 0.0970 |
| 期末基金资产净值 | 61,494,309.18 | 35,670,184.48 |
| 期末基金份额净值 | 1.1405 | 1.1320 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 14.05% | 13.20% |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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

宝盈祥利稳健配置混合 A

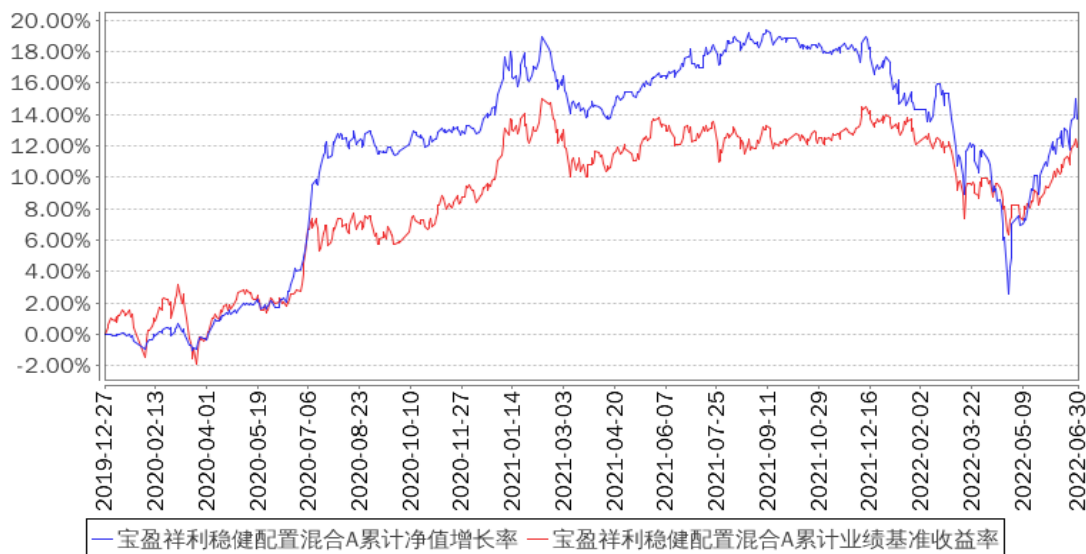
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 2.73% | 0.65% | 2.80% | 0.32% | -0.07% | 0.33% |
| 过去三个月 | 2.49% | 0.75% | 2.75% | 0.42% | -0.26% | 0.33% |
| 过去六个月 | -3.07% | 0.68% | -1.31% | 0.44% | -1.76% | 0.24% |
| 过去一年 | -3.22% | 0.51% | -0.61% | 0.37% | -2.61% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.05% | 0.39% | 12.46% | 0.39% | 1.59% | 0.00% |

宝盈祥利稳健配置混合 C

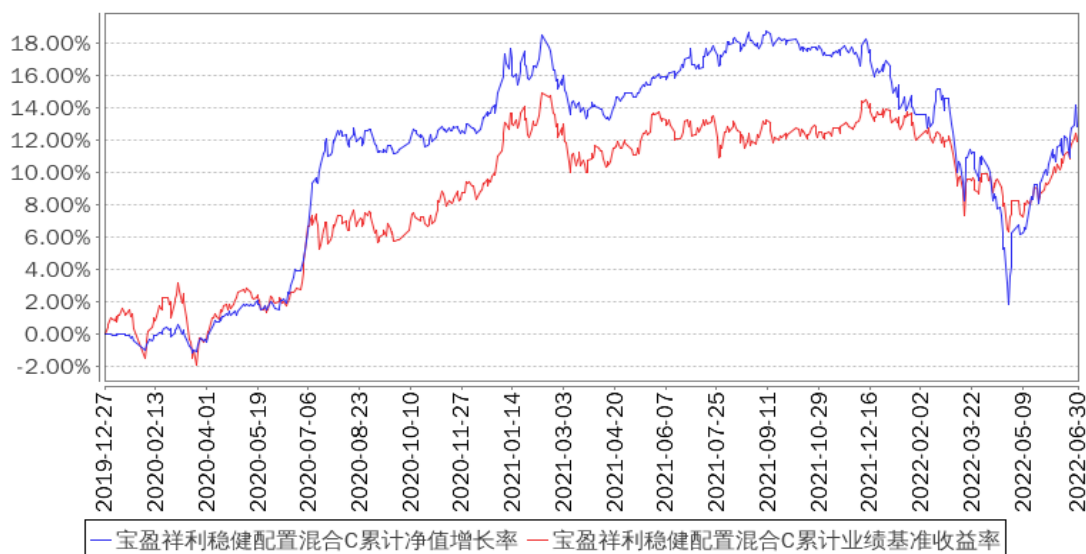
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 2.70% | 0.65% | 2.80% | 0.32% | -0.10% | 0.33% |
| 过去三个月 | 2.42% | 0.75% | 2.75% | 0.42% | -0.33% | 0.33% |
| 过去六个月 | -3.21% | 0.68% | -1.31% | 0.44% | -1.90% | 0.24% |
| 过去一年 | -3.50% | 0.51% | -0.61% | 0.37% | -2.89% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.20% | 0.39% | 12.46% | 0.39% | 0.74% | 0.00% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

宝盈祥利稳健配置混合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



宝盈祥利稳健配置混合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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值

混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数、宝盈优质成长混合、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合、宝盈祥和 9 个月定开混合、宝盈安盛中短债债券、宝盈祥琪混合、宝盈新能源产业混合发起式五十七只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）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、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、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、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、宝盈祥琪混合型证券投资基金基金经理 | 2019 年 12 月 27 日 | - | 9 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。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

| | | | | | |
|----|--|-----------------|---|-----|--|
| 王灏 | 本基金、宝盈祥乐一年持有期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基金经理 | 2022 年 3 月 15 日 | - | 4 年 | 王灏先生，西南财经大学金融硕士。曾任特变电工衡阳变压器有限公司投标项目经理；2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格 |
|----|--|-----------------|---|-----|--|

注：1、吕姝仪为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、王灏为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2022 年 6 月 30 日。

4.1.3 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，全球地缘政治冲突加剧，通胀走高，宽松财政货币政策退出，欧美等国家消费逐

渐回落。我国经济受疫情影响，复苏态势不均衡，外需好于内需，出口韧性支撑了工业生产增速，但内需恢复速度仍然偏慢。居民消费不足、消费意愿更加保守，财政发力支撑基建投资，制造业投资高增，房地产销售市场冷淡，房地产投资延续去年下半年以来的下行走势。

权益方面，A 股震荡下跌至 4 月底反弹。沪深 300 指数下跌 9.22%，创业板指下跌 15.41%。本产品的股票资产也有一定幅度的下跌，伴随权益市场下跌仓位有所增加。

债券方面，10 年期国债收益率窄幅震荡，1 年期国债收益率震荡下行。本产品债券仓位整体较为平稳，债券组合的久期和杠杆水平不高，获取了稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥利稳健配置混合 A 的基金份额净值为 1.1405 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.07%；截至本报告期末宝盈祥利稳健配置混合 C 的基金份额净值为 1.1320 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.21%。同期业绩比较基准收益率为-1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年经济运行仍面临较大的不确定性。出口对于经济的支撑大概率趋弱，随着欧美通胀高位运行，加息已经成为必然，出口需求将继续承压；由于疫情反复出现，居民收入和消费场景受到影响，消费复苏将会是缓慢的过程；地产目前仍处于磨底阶段，在政策托底下预计会有较弱的复苏，叠加去年下半年较低的基数，地产销售及投资可能会有相对不错的同比增长。在宏观经济弱复苏叠加流动性宽裕的背景下，证券市场预计仍将保持结构性行情，部分复苏相对快的行业将成为下一阶段的主要市场方向。

展望下半年，经济恢复基础尚不稳固，资金面难言迅速收紧，市场对后续经济修复的可持续性持观望态度，债市调整空间有限。权益市场需要关注海外衰退预期、区域疫情反弹等影响，另外大宗商品走势将成为影响企业利润的重要因素。

本基金权益部分将根据市场情况，优化个股持仓，择机增加景气复苏方向的持仓。预计下半年市场整体仍然呈震荡格局，以结构性机会为主，本基金将继续寻找优质公司的股权和债权的投资机会，力争为组合提供稳健的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人

员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|------------------------|--------------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,261,867.24 | 5,702,411.86 |
| 结算备付金 | | 199,542.30 | 1,477,637.95 |
| 存出保证金 | | 55,412.22 | 45,772.99 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 97,260,450.33 | 174,244,231.42 |
| 其中: 股票投资 | | 35,833,185.98 | 42,827,231.42 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 61,427,264.35 | 131,417,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中: 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 677,678.29 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 5,548.17 | 11,611.98 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 1,548,597.48 |
| 资产总计 | | 100,460,498.55 | 183,030,263.68 |
| 负债和净资产 | | 本期末 | 上年度末 |
| | 附注号 | 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 33,000,000.00 |
| 应付清算款 | | 2,789,784.54 | 4,950,320.40 |
| 应付赎回款 | | 172,451.93 | 257,620.26 |
| 应付管理人报酬 | | 47,498.41 | 77,765.08 |
| 应付托管费 | | 15,832.79 | 25,921.67 |
| 应付销售服务费 | | 8,704.00 | 14,661.43 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 3,960.69 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 261,733.22 | 340,257.59 |
| 负债合计 | | 3,296,004.89 | 38,670,507.12 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 85,430,171.14 | 122,977,482.97 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 11,734,322.52 | 21,382,273.59 |
| 净资产合计 | | 97,164,493.66 | 144,359,756.56 |
| 负债和净资产总计 | | 100,460,498.55 | 183,030,263.68 |

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.1405 元，A 类基金份额 53,918,259.60 份；C 类基金份额净值人民币 1.1320 元，C 类基金份额 31,511,911.54 份；宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金份额总额合计为 85,430,171.14 份。

2、以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | -3,998,575.59 | 16,504,472.96 |
| 1. 利息收入 | | 15,989.67 | 10,719,516.73 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 15,989.67 | 43,867.11 |
| 债券利息收入 | | - | 10,638,693.97 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 36,955.65 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -5,429,233.58 | 10,688,449.26 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -8,514,878.73 | 11,592,768.68 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 2,728,623.51 | -1,631,466.27 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 357,021.64 | 727,146.85 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 1,412,687.60 | -4,986,852.98 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 1,980.72 | 83,359.95 |
| 减：二、营业总支出 | | 849,175.93 | 5,337,716.77 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 322,098.47 | 1,950,498.37 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 107,366.16 | 650,166.13 |
| 3. 销售服务费 | | 63,467.40 | 251,026.93 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 242,127.11 | 1,194,971.03 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 242,127.11 | 1,194,971.03 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 695.43 | 11,617.35 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 113,421.36 | 1,279,436.96 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -4,847,751.52 | 11,166,756.19 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -4,847,751.52 | 11,166,756.19 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -4,847,751.52 | 11,166,756.19 |

注：以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|----|---------------------------------------|--------|-------|-------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| | | | | |

| | | | | |
|--|--|------------|----------------|-----------------|
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 122,977,482.97 | - | 21,382,273.59 | 144,359,756.56 |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 (基金净值) | 122,977,482.97 | - | 21,382,273.59 | 144,359,756.56 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -37,547,311.83 | - | -9,647,951.07 | -47,195,262.90 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -4,847,751.52 | -4,847,751.52 |
| (二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数 (净值减少以“-”号 填列) | -37,547,311.83 | - | -4,800,199.55 | -42,347,511.38 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 975,595.97 | - | 121,644.58 | 1,097,240.55 |
| 2. 基金赎回款 | -38,522,907.80 | - | -4,921,844.13 | -43,444,751.93 |
| (三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益 结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 (基金净值) | 85,430,171.14 | - | 11,734,322.52 | 97,164,493.66 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综 合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 708,968,791.66 | - | 107,665,257.03 | 816,634,048.69 |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 (基金净值) | 708,968,791.66 | - | 107,665,257.03 | 816,634,048.69 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -279,277,403.62 | - | -31,410,847.29 | -310,688,250.91 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 11,166,756.19 | 11,166,756.19 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | -279,277,403.62 | - | -42,577,603.48 | -321,855,007.10 |
| 其中：1. 基金申购款 | 17,984,086.65 | - | 2,975,581.19 | 20,959,667.84 |
| 2. 基金赎回款 | -297,261,490.27 | - | -45,553,184.67 | -342,814,674.94 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 429,691,388.04 | - | 76,254,409.74 | 505,945,797.78 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨凯

张献锦

何瑜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2220号《关于准予宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币789,625,027.92元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0763号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为789,765,058.50份基金份额,其中认购资金利息折合140,030.58份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的

不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥利稳健配置混合 A；投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥利稳健配置混合 C。宝盈祥利稳健配置混合 A 和宝盈祥利稳健配置混合 C 分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、公开发行的次级债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 0% - 45%。每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年中期经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除以下会计政策变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度

报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项

等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收

益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年中期财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 5,702,411.86 元、1,477,637.95 元、45,772.99 元、1,548,597.48 元和 11,611.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 5,702,901.84 元、1,478,369.34 元、45,795.65 元、0.00 元和 11,611.98 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 174,244,231.42 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 175,791,584.87 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 33,000,000.00 元、4,950,320.40 元、257,620.26 元、77,765.08 元、25,921.67 元、14,661.43 元、163,572.45 元、-12,314.92 元和 0.06 元。新金融工具准则下

以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 32,987,685.08 元、4,950,320.40 元、257,620.26 元、77,765.08 元、25,921.67 元、14,661.43 元、163,572.45 元、0.00 元和 0.06 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率

缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 2,261,867.24 |
| 等于：本金 | 2,261,791.24 |
| 加：应计利息 | 76.00 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |

| | |
|--------|--------------|
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 2,261,867.24 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 32,967,124.92 | - | 35,833,185.98 | 2,866,061.06 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 602,167.02 | 46,143,679.42 | -147,065.75 |
| | 银行间市场 | 145,084.93 | 15,283,584.93 | -16,703.97 |
| | 合计 | 747,251.95 | 61,427,264.35 | -163,769.72 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 93,810,907.04 | 747,251.95 | 97,260,450.33 | 2,702,291.34 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-----------|-------------------|
| 应付赎回费 | 0.26 |
| 应付证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|------------|
| 应付交易费用 | 163,472.81 |
| 其中：交易所市场 | 162,360.81 |
| 银行间市场 | 1,112.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 98,260.15 |
| 合计 | 261,733.22 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈祥利稳健配置混合 A

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 76,233,034.08 | 76,233,034.08 |
| 本期申购 | 302,085.38 | 302,085.38 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -22,616,859.86 | -22,616,859.86 |
| 本期末 | 53,918,259.60 | 53,918,259.60 |

宝盈祥利稳健配置混合 C

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 46,744,448.89 | 46,744,448.89 |
| 本期申购 | 673,510.59 | 673,510.59 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,906,047.94 | -15,906,047.94 |
| 本期末 | 31,511,911.54 | 31,511,911.54 |

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

宝盈祥利稳健配置混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期期初 | 12,649,680.98 | 810,141.73 | 13,459,822.71 |
| 本期利润 | -3,631,694.58 | 1,009,552.83 | -2,622,141.75 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,337,448.81 | 75,817.43 | -3,261,631.38 |
| 其中：基金申购款 | 46,490.90 | 735.50 | 47,226.40 |
| 基金赎回款 | -3,383,939.71 | 75,081.93 | -3,308,857.78 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 5,680,537.59 | 1,895,511.99 | 7,576,049.58 |

宝盈祥利稳健配置混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

| | | | |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期期初 | 7,423,884.75 | 498,566.13 | 7,922,450.88 |
| 本期利润 | -2,628,744.54 | 403,134.77 | -2,225,609.77 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,739,529.68 | 200,961.51 | -1,538,568.17 |
| 其中：基金申购款 | 75,234.54 | -816.36 | 74,418.18 |
| 基金赎回款 | -1,814,764.22 | 201,777.87 | -1,612,986.35 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,055,610.53 | 1,102,662.41 | 4,158,272.94 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 8,803.24 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 6,753.99 |
| 其他 | 432.44 |
| 合计 | 15,989.67 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -8,514,878.73 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -8,514,878.73 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 126,317,706.45 |
| 减：卖出股票成本总额 | 134,456,771.50 |
| 减：交易费用 | 375,813.68 |
| 买卖股票差价收入 | -8,514,878.73 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,313,707.54 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,414,915.97 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 2,728,623.51 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 134,829,092.84 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 131,619,913.77 |
| 减：应计利息总额 | 1,792,435.91 |
| 减：交易费用 | 1,827.19 |
| 买卖债券差价收入 | 1,414,915.97 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 357,021.64 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 357,021.64 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------|----|
|------|----|

| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 1,412,687.60 |
| 股票投资 | 2,752,267.75 |
| 债券投资 | -1,339,580.15 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 1,412,687.60 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,972.37 |
| 基金转换费收入 | 8.35 |
| 合计 | 1,980.72 |

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 中债登账户维护费 | 9,000.00 |
| 上清所账户维护费 | 9,000.00 |
| 汇款费 | 5,561.21 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 113,421.36 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------|-----------------------|
| 宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国对外经济贸易信托有限公司（“中国外贸信托”） | 基金管理人的股东 |
| 中铁信托有限责任公司（“中铁信托”） | 基金管理人的股东 |
| 中铁宝盈资产管理有限公司（“中铁宝盈”） | 基金管理人的子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 322,098.47 | 1,950,498.37 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 130,634.54 | 424,811.77 |

注：支付基金管理人宝盈基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 107,366.16 | 650,166.13 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|-----------------|------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 宝盈祥利稳健配置混合 C | 合计 |
| 宝盈基金 | - | 41.90 | 41.90 |
| 招商银行 | - | 62,015.25 | 62,015.25 |
| 合计 | - | 62,057.15 | 62,057.15 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 宝盈祥利稳健配置混合 C | 合计 |
| 招商银行 | - | 179,688.07 | 179,688.07 |

| | | | |
|------|---|------------|------------|
| 宝盈基金 | - | 4,040.38 | 4,040.38 |
| 合计 | - | 183,728.45 | 183,728.45 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日宝盈祥利稳健配置混合 C 的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日宝盈祥利稳健配置混合 C 的基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------------------------|--|--|
| | | 宝盈祥利稳健配置混合 A |
| 基金合同生效日(2019 年 12 月 27 日)持有的基金份额 | 0.00 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 17,735,213.27 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份 额 | 0.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 17,735,213.27 | - |
| 报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 32.89% | - |

| 项目 | 上年度可比期间 | 上年度可比期间 |
|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 宝盈祥利稳健配置混合 C |
| 基金合同生效日(2019 年 12 月 27 日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 17,735,213.27 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减: 报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 17,735,213.27 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 5.01% | - |

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|---------------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 2,261,867.24 | 8,803.24 | 2,607,705.61 | 18,686.12 |

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|--------------|------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 600938 | 中国海油 | 2022年4月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.80 | 15.86 | 84,004 | 907,243.20 | 1,332,303.44 | - |

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金

参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含存托凭证)、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 5,158,427.63 | 10,007,000.00 |
| 合计 | 5,158,427.63 | 10,007,000.00 |

注：未评级部分为国债、政策性金融债，短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 45,979,220.28 | 91,051,000.00 |
| AAA 以下 | - | 20,230,000.00 |

| | | |
|-----|---------------|----------------|
| 未评级 | 10,289,616.44 | 10,129,000.00 |
| 合计 | 56,268,836.72 | 121,410,000.00 |

注：未评级部分为国债、政策性金融债，中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|--------------|---------------|------|---------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,261,867.24 | - | - | - | 2,261,867.24 |
| 结算备付金 | 199,542.30 | - | - | - | 199,542.30 |
| 存出保证金 | 55,412.22 | - | - | - | 55,412.22 |
| 交易性金融资产 | 5,158,427.63 | 56,268,836.72 | - | 35,833,185.98 | 97,260,450.33 |
| 应收申购款 | - | - | - | 5,548.17 | 5,548.17 |
| 应收清算款 | - | - | - | 677,678.29 | 677,678.29 |
| 资产总计 | 7,675,249.39 | 56,268,836.72 | - | 36,516,412.44 | 100,460,498.55 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|----------------|-------|---------------|----------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | 172,451.93 | 172,451.93 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 47,498.41 | 47,498.41 |
| 应付托管费 | - | - | - | 15,832.79 | 15,832.79 |
| 应付清算款 | - | - | - | 2,789,784.54 | 2,789,784.54 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 8,704.00 | 8,704.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 261,733.22 | 261,733.22 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,296,004.89 | 3,296,004.89 |
| 利率敏感度缺口 | 7,675,249.39 | 56,268,836.72 | - | 33,220,407.55 | 97,164,493.66 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 5,702,411.86 | - | - | - | 5,702,411.86 |
| 结算备付金 | 1,477,637.95 | - | - | - | 1,477,637.95 |
| 存出保证金 | 45,772.99 | - | - | - | 45,772.99 |
| 交易性金融资产 | 20,090,000.00 | 111,327,000.00 | - | 42,827,231.42 | 174,244,231.42 |
| 应收申购款 | - | - | - | 11,611.98 | 11,611.98 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,548,597.48 | 1,548,597.48 |
| 资产总计 | 27,315,822.80 | 111,327,000.00 | - | 44,387,440.88 | 183,030,263.68 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 33,000,000.00 | - | - | - | 33,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 4,950,320.40 | 4,950,320.40 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 257,620.26 | 257,620.26 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 77,765.08 | 77,765.08 |
| 应付托管费 | - | - | - | 25,921.67 | 25,921.67 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 14,661.43 | 14,661.43 |
| 应交税费 | - | - | - | 3,960.69 | 3,960.69 |
| 其他负债 | - | - | - | 340,257.59 | 340,257.59 |
| 负债总计 | 33,000,000.00 | - | - | 5,670,507.12 | 38,670,507.12 |
| 利率敏感度缺口 | -5,684,177.20 | 111,327,000.00 | - | 38,716,933.76 | 144,359,756.56 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2022年6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 259,105.96 | 650,633.25 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -256,883.06 | -643,824.20 |

| | | | |
|--|-----|--|--|
| | 个基点 | | |
|--|-----|--|--|

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 0% - 45%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 35,833,185.98 | 36.88 | 42,827,231.42 | 29.67 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----|---------------|-------|---------------|-------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 35,833,185.98 | 36.88 | 42,827,231.42 | 29.67 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|-----------|-----------------------------|------------------------|---------------|
| 假设 | 除沪深 300 指数收益率以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | | |
| | 本期末（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） | |
| 分析 | 1. 沪深 300 指数收益率上升 5% | 1,903,757.99 | 2,643,058.26 |
| | 2. 沪深 300 指数收益率下降 5% | -1,903,757.99 | -2,643,058.26 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 34,500,882.54 | 40,405,294.80 |
| 第二层次 | 61,427,264.35 | 131,480,084.49 |
| 第三层次 | 1,332,303.44 | 2,358,852.13 |
| 合计 | 97,260,450.33 | 174,244,231.42 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未

发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 35,833,185.98 | 35.67 |
| | 其中：股票 | 35,833,185.98 | 35.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 61,427,264.35 | 61.15 |
| | 其中：债券 | 61,427,264.35 | 61.15 |
| | 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 | 2,461,409.54 | 2.45 |
| 8 | 其他各项资产 | 738,638.68 | 0.74 |
| 9 | 合计 | 100,460,498.55 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 4,988,973.44 | 5.13 |
| C | 制造业 | 29,655,694.54 | 30.52 |
| 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 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,188,518.00 | 1.22 |
| 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 | 35,833,185.98 | 36.88 |

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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 | 601677 | 明泰铝业 | 154,380 | 3,674,244.00 | 3.78 |
| 2 | 601058 | 赛轮轮胎 | 266,700 | 3,005,709.00 | 3.09 |
| 3 | 600256 | 广汇能源 | 255,300 | 2,690,862.00 | 2.77 |
| 4 | 002407 | 多氟多 | 45,600 | 2,230,296.00 | 2.30 |
| 5 | 600529 | 山东药玻 | 70,100 | 1,959,295.00 | 2.02 |
| 6 | 300806 | 斯迪克 | 66,700 | 1,893,613.00 | 1.95 |
| 7 | 601615 | 明阳智能 | 55,600 | 1,879,280.00 | 1.93 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 900 | 1,840,500.00 | 1.89 |
| 9 | 300019 | 硅宝科技 | 82,300 | 1,829,529.00 | 1.88 |
| 10 | 603181 | 皇马科技 | 116,000 | 1,750,440.00 | 1.80 |
| 11 | 605166 | 聚合顺 | 114,800 | 1,464,848.00 | 1.51 |
| 12 | 300833 | 浩洋股份 | 16,200 | 1,411,992.00 | 1.45 |
| 13 | 600938 | 中国海油 | 84,004 | 1,332,303.44 | 1.37 |
| 14 | 000301 | 东方盛虹 | 78,600 | 1,329,126.00 | 1.37 |
| 15 | 601702 | 华峰铝业 | 98,500 | 1,300,200.00 | 1.34 |
| 16 | 002027 | 分众传媒 | 176,600 | 1,188,518.00 | 1.22 |
| 17 | 603681 | 永冠新材 | 41,000 | 1,007,780.00 | 1.04 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 18 | 688300 | 联瑞新材 | 12,651 | 982,350.15 | 1.01 |
| 19 | 601225 | 陕西煤业 | 45,600 | 965,808.00 | 0.99 |
| 20 | 002709 | 天赐材料 | 15,300 | 949,518.00 | 0.98 |
| 21 | 000420 | 吉林化纤 | 187,500 | 894,375.00 | 0.92 |
| 22 | 688778 | 厦钨新能 | 863 | 96,198.61 | 0.10 |
| 23 | 600746 | 江苏索普 | 3,900 | 45,162.00 | 0.05 |
| 24 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.04 |
| 25 | 001323 | 慕思股份 | 573 | 28,111.38 | 0.03 |
| 26 | 001318 | 阳光乳业 | 1,142 | 25,249.62 | 0.03 |
| 27 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.01 |
| 28 | 603272 | 联翔股份 | 443 | 9,723.85 | 0.01 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 601000 | 唐山港 | 6,311,228.00 | 4.37 |
| 2 | 601677 | 明泰铝业 | 6,125,437.36 | 4.24 |
| 3 | 601058 | 赛轮轮胎 | 5,962,609.00 | 4.13 |
| 4 | 600256 | 广汇能源 | 5,546,612.00 | 3.84 |
| 5 | 300122 | 智飞生物 | 5,412,701.00 | 3.75 |
| 6 | 000906 | 浙商中拓 | 5,327,603.00 | 3.69 |
| 7 | 300568 | 星源材质 | 4,369,811.00 | 3.03 |
| 8 | 601888 | 中国中免 | 3,679,207.00 | 2.55 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 3,608,415.00 | 2.50 |
| 10 | 300833 | 浩洋股份 | 3,361,597.00 | 2.33 |
| 11 | 601233 | 桐昆股份 | 3,128,319.00 | 2.17 |
| 12 | 605366 | 宏柏新材 | 3,024,163.00 | 2.09 |
| 13 | 601225 | 陕西煤业 | 2,957,194.00 | 2.05 |
| 14 | 300750 | 宁德时代 | 2,551,397.00 | 1.77 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 2,516,000.33 | 1.74 |
| 16 | 600048 | 保利发展 | 2,420,980.00 | 1.68 |
| 17 | 000683 | 远兴能源 | 2,395,141.00 | 1.66 |
| 18 | 601899 | 紫金矿业 | 2,384,193.00 | 1.65 |
| 19 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,342,265.00 | 1.62 |
| 20 | 300919 | 中伟股份 | 2,318,479.00 | 1.61 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 1 | 601000 | 唐山港 | 6,425,008.00 | 4.45 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 6,366,672.00 | 4.41 |
| 3 | 000906 | 浙商中拓 | 5,038,139.00 | 3.49 |
| 4 | 300122 | 智飞生物 | 4,988,442.00 | 3.46 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 4,202,790.00 | 2.91 |
| 6 | 600256 | 广汇能源 | 3,689,302.00 | 2.56 |
| 7 | 601058 | 赛轮轮胎 | 3,677,869.00 | 2.55 |
| 8 | 002466 | 天齐锂业 | 3,445,111.00 | 2.39 |
| 9 | 002241 | 歌尔股份 | 3,217,996.00 | 2.23 |
| 10 | 300568 | 星源材质 | 3,168,853.00 | 2.20 |
| 11 | 300750 | 宁德时代 | 2,834,378.00 | 1.96 |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 2,812,521.00 | 1.95 |
| 13 | 600048 | 保利发展 | 2,779,146.00 | 1.93 |
| 14 | 601888 | 中国中免 | 2,774,308.00 | 1.92 |
| 15 | 603259 | 药明康德 | 2,756,321.00 | 1.91 |
| 16 | 605366 | 宏柏新材 | 2,693,699.00 | 1.87 |
| 17 | 000858 | 五粮液 | 2,665,699.00 | 1.85 |
| 18 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,657,088.72 | 1.84 |
| 19 | 300833 | 浩洋股份 | 2,626,945.00 | 1.82 |
| 20 | 601233 | 桐昆股份 | 2,539,645.00 | 1.76 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 124,710,458.31 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 126,317,706.45 |

注：买入股票成本（成交）总额与卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 5,158,427.63 | 5.31 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 15,283,584.93 | 15.73 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,289,616.44 | 10.59 |
| 4 | 企业债券 | 40,985,251.79 | 42.18 |
| 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 | 61,427,264.35 | 63.22 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 190203 | 19 国开 03 | 100,000 | 10,289,616.44 | 10.59 |
| 2 | 188399 | 21 银河 G5 | 50,000 | 5,163,682.74 | 5.31 |
| 3 | 188418 | 21 兴业 03 | 50,000 | 5,161,996.71 | 5.31 |
| 4 | 019658 | 21 国债 10 | 50,620 | 5,158,427.63 | 5.31 |
| 5 | 175630 | 21 海通 01 | 50,000 | 5,144,303.56 | 5.29 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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，以套期保值和流动性管理为目的，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 海通 01、21 中金 G5、19 国开 03、21 中证 02、21 安信 G1、21 平证 05、21 国君 G3 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2021 年 9 月 28 日，根据重庆监管局《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2021〕5 号），存在在执行奥瑞德 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。

2021 年 11 月 5 日，中国证监会北京监管局认定中金公司存在使用成本法对私募资管计划中部分资产进行估值以及对具有相同特征的同一投资品种采用的估值技术不一致的情况，决定对公

司采取责令改正的行政监督管理措施。

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。

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。

2022 年 1 月 19 日,浙江证监局发布对安信证券采取责令改正措施的决定。经查,浙江证监局发现安信证券在开展亚太药业 2015 年重大资产购买项目、2019 年公开发行可转债项目中未勤勉尽责,未能对亚太药业信息披露文件的真实性、准确性进行充分核查和验证,尽职调查不充分,

未按规定履行持续督导义务，内部质量控制不完善。浙江证监局决定对安信证券采取责令改正的监督管理措施。

2022 年 6 月 24 日，根据深圳证监局对平安证券股份有限公司采取暂停保荐机构资格监管措施的决定，平安证券在保荐乐视网信息技术（北京）股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市的执业过程中，尽职调查未勤勉尽责、内控机制执行不到位，出具的发行保荐书中发行人财务数据与实际不符，违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第 58 号）第四条第一款、第二十四条、第二十九条第一款、第三十条、第三十八条的规定。根据《证券发行上市保荐业务管理办法》第六十七条的规定，深圳证监局决定对平安证券采取暂停保荐机构资格 3 个月的监管措施，暂停期间自 2022 年 6 月 23 日至 9 月 22 日。

2022 年 2 月 21 日，根据江西证监局对国泰君安证券股份有限公司江西分公司采取责令改正措施的决定，经查，江西证监局发现公司存在以下问题：一是对部分符合回访筛选标准的赣江-同兴投顾签约投资者未进行回访，违反了《证券投资顾问业务暂行规定》（证监会公告〔2020〕66 号）第二十一条的规定。二是赣江-同兴投资顾问易思敏在提供证券投资顾问服务过程中，存在通过微信及微信群向投资者发布误导性陈述的行为。国泰君安证券对易思敏提供证券投资顾问服务合规管理不到位，违反了《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。

我们认为相关处罚措施对海通证券、中金公司、国家开发银行、中信证券、安信证券、平安证券、国泰君安证券的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对海通证券、中金公司、国家开发银行、中信证券、安信证券、平安证券、国泰君安证券的债券偿还影响很小。本基金投资 21 海通 10、21 中金 G5、19 国开 03、21 中证 02、21 安信 G1、21 平证 05、21 国君 G3 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 55,412.22 |
| 2 | 应收清算款 | 677,678.29 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,548.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 738,638.68 |

7.12.4 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。

7.12.5 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股票。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|-----------|------------|---------------|------------|---------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 宝盈祥利稳健配置混合 A | 513 | 105,103.82 | 17,735,213.27 | 32.89 | 36,183,046.33 | 67.11 |
| 宝盈祥利稳健配置混合 C | 1,303 | 24,184.12 | - | - | 31,511,911.54 | 100.00 |
| 合计 | 1,816 | 47,043.05 | 17,735,213.27 | 20.76 | 67,694,957.87 | 79.24 |

注：① 本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

② 户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|--------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 5.00 | 0.0000 |
| | 宝盈祥利稳健配置混合 C | 105.05 | 0.0003 |
| | 合计 | 110.05 | 0.0001 |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金

份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------|--------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 0 |
| | 宝盈祥利稳健配置混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 0 |
| | 宝盈祥利稳健配置混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 宝盈祥利稳健配置混合 A | 宝盈祥利稳健配置混合 C |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2019 年 12 月 27 日) 基金份额总额 | 171,303,624.82 | 618,461,433.68 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 76,233,034.08 | 46,744,448.89 |
| 本报告期基金总申购份额 | 302,085.38 | 673,510.59 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 22,616,859.86 | 15,906,047.94 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 53,918,259.60 | 31,511,911.54 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

(1) 根据宝盈基金管理有限公司第六届董事会第五次会议决议，同意马永红不再担任宝盈基金管理有限公司董事长，严震担任宝盈基金管理有限公司董事长；

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(2) 根据宝盈基金管理有限公司股东会 2022 年第一次会议决议，同意马永红、陈格不再担任宝盈基金管理有限公司董事，陈赤、邹纯余担任宝盈基金管理有限公司董事；陈林不再担任宝盈基金管理有限公司监事，兰敏担任宝盈基金管理有限公司监事；

(3) 根据宝盈基金管理有限公司第六届监事会第四次会议决议，同意陈林不再担任宝盈基金管理有限公司监事会主席，兰敏担任宝盈基金管理有限公司监事会主席。

2、报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 中信证券 | 1 | 115,368,401.81 | 46.24 | 105,593.55 | 46.26 | - |
| 兴业证券 | 1 | 107,692,194.72 | 43.17 | 98,503.65 | 43.15 | - |
| 方正证券 | 2 | 26,423,784.01 | 10.59 | 24,182.83 | 10.59 | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的
需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨
询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交
易席位租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(I) 租用交易单元情况

新租用德邦证券上海、深圳交易单元各一个。

(II) 退租交易单元情况

未退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------------------|----------------|----------------------------|------|--------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的 比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回 购成交总额的 比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证 成交总额的 比例 (%) |
| 中信证券 | 10,192,412.32 | 9.33 | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 99,007,359.44 | 90.67 | 527,000,000.00 | 98.50 | - | - |
| 方正证券 | - | - | 8,000,000.00 | 1.50 | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|---|------------|
| 1 | 宝盈基金管理有限公司关于基金经理结束产假恢复履行职务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-30 |
| 2 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-20 |
| 3 | 宝盈基金管理有限公司关于新增博时财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-14 |
| 4 | 宝盈基金管理有限公司关于新增洪泰财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-07 |
| 5 | 宝盈基金管理有限公司关于新增鼎信汇金为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-13 |
| 6 | 宝盈基金管理有限公司关于新增浦领基金为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-12 |
| 7 | 宝盈基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-06 |
| 8 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-22 |
| 9 | 宝盈基金管理有限公司旗下 53 只基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2022-04-22 |
| 10 | 宝盈基金管理有限公司旗下公募基金产品基金转换费用的业务规则说明 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-18 |
| 11 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-30 |

| | | | |
|----|---|---|------------|
| 12 | 宝盈基金管理有限公司旗下 50 只基金 2021 年年度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2022-03-30 |
| 13 | 宝盈基金管理有限公司关于新增华瑞保险为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-29 |
| 14 | 宝盈基金管理有限公司关于董事长(法定代表人)变更的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-25 |
| 15 | 宝盈基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-25 |
| 16 | 宝盈基金管理有限公司关于新增排排网为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-22 |
| 17 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金(宝盈祥利稳健配置混合 A 份额)基金产品资料概要(更新) | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-17 |
| 18 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金(宝盈祥利稳健配置混合 C 份额)基金产品资料概要(更新) | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-17 |
| 19 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金更新招募说明书 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-17 |
| 20 | 宝盈基金管理有限公司关于新增北京中植基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-16 |
| 21 | 宝盈基金管理有限公司关于新增泰信财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-16 |
| 22 | 宝盈基金管理有限公司关于新增凯石财富为旗下部分基金代销机构的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-16 |
| 23 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-15 |
| 24 | 宝盈基金管理有限公司关于 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, | 2022-03-10 |

| | | | |
|----|--|---|------------|
| | 旗下基金参加中信建投证券股份有限公司手续费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | |
| 25 | 宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-24 |
| 26 | 宝盈基金管理有限公司旗下 52 只基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2022-01-24 |
| 27 | 宝盈基金关于暂停杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-18 |
| 28 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金可参与北京证券交易所股票投资及相关风险揭示的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-07 |
| 29 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 | 20220509-20220630 | 17,735,213.27 | - | - | 17,735,213.27 | 20.76 |
| 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。 | | | | | | | |

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金注册的文件；

《宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》；

《宝盈祥利稳健配置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。

12.2 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：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

12.3 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 8 月 31 日