

# 宝盈祥泰混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	宝盈祥泰混合	
基金主代码	001358	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日	
报告期末基金份额总额	454,406,652.76 份	
投资目标	在严格控制下行风险的前提下，追求稳定的投资回报，为投资人提供稳健的理财工具。	
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回报。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、股票投资策略和金融衍生品投资策略四个部分组成。	
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，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈祥泰混合 A	宝盈祥泰混合 C
下属分级基金的交易代码	001358	007575
报告期末下属分级基金的份额总额	216,130,342.47 份	238,276,310.29 份

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	宝盈祥泰混合 A	宝盈祥泰混合 C
1. 本期已实现收益	1,822,735.61	1,784,110.44
2. 本期利润	2,250,835.09	2,248,276.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0104	0.0094
4. 期末基金资产净值	249,117,320.59	272,205,867.94
5. 期末基金份额净值	1.1526	1.1424

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

宝盈祥泰混合 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	0.91%	0.04%	-3.63%	0.27%	4.54%	-0.23%
过去六个月	1.64%	0.09%	-0.98%	0.35%	2.62%	-0.26%
过去一年	0.58%	0.19%	-3.51%	0.35%	4.09%	-0.16%
过去三年	13.47%	0.36%	7.46%	0.37%	6.01%	-0.01%
过去五年	24.09%	0.36%	12.79%	0.28%	11.30%	0.08%
自基金合同生效起至今	31.17%	0.30%	19.53%	0.23%	11.64%	0.07%

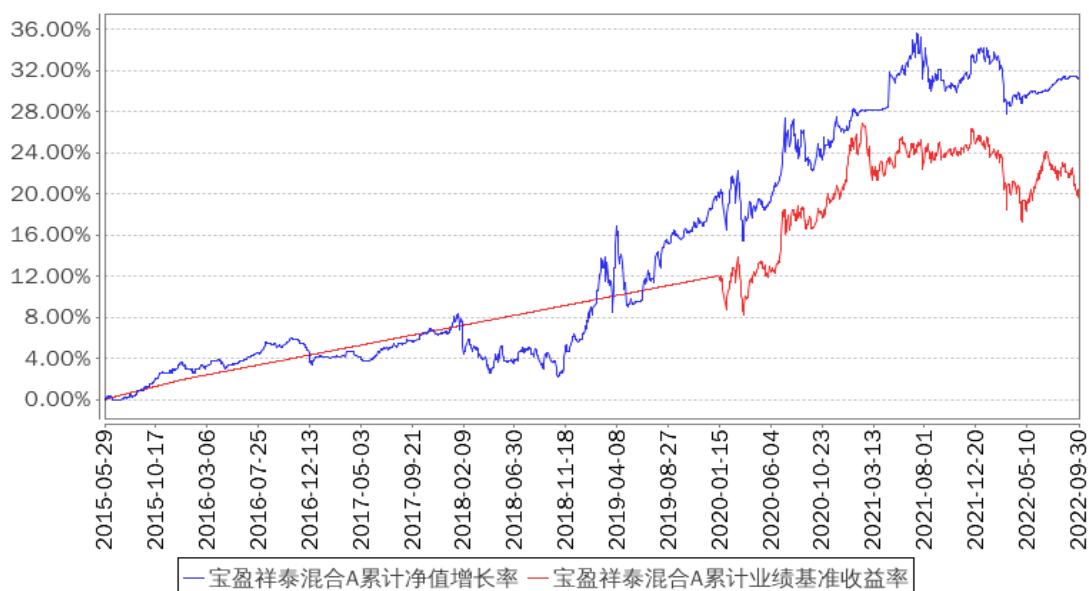
宝盈祥泰混合 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

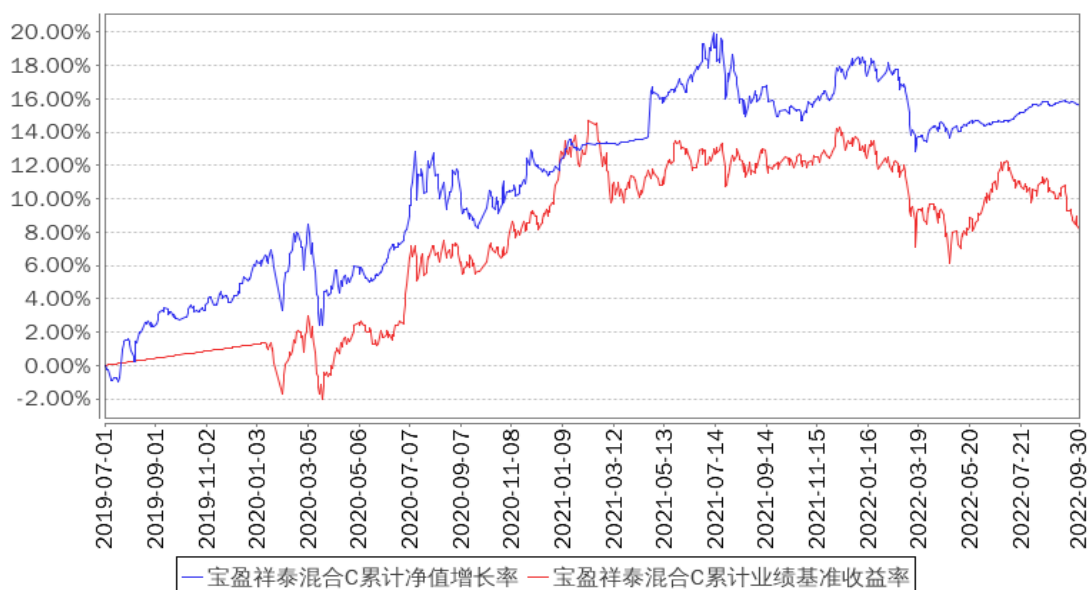
过去三个月	0.84%	0.04%	-3.63%	0.27%	4.47%	-0.23%
过去六个月	1.49%	0.09%	-0.98%	0.35%	2.47%	-0.26%
过去一年	0.29%	0.19%	-3.51%	0.35%	3.80%	-0.16%
过去三年	12.51%	0.36%	7.46%	0.37%	5.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	15.61%	0.35%	8.13%	0.35%	7.48%	0.00%

### 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

宝盈祥泰混合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



宝盈祥泰混合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



注：本基金于 2019 年 7 月 1 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式，其对应的基金份额简称“宝盈祥泰混合 C”。

## § 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、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金基金经理	2021 年 8 月 20 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。
卢贤海	本基金、宝盈盈旭纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈盈润纯债债券型证券投资基金、宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理	2021 年 11 月 26 日	-	7 年	卢贤海先生，清华大学核科学与技术博士。2015 年 7 月至 2017 年 9 月在招商财富资产管理有限公司从事宏观研究工作；2017 年 10 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理，宝盈盈顺纯债债券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

报告期内，本基金债券类资产配置以银行间金融债券、交易所高等级债券为主，权益类资产以业绩稳健的行业龙头为主，行业较为均衡。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥泰混合 A 的基金份额净值为 1.1526 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.91%；截至本报告期末宝盈祥泰混合 C 的基金份额净值为 1.1424 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.84%。同期业绩比较基准收益率为-3.63%。

### 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	5,834,967.16	0.98
	其中：股票	5,834,967.16	0.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	585,320,500.88	98.72
	其中：债券	585,320,500.88	98.72
	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	1,659,922.95	0.28
8	其他资产	124,139.08	0.02
9	合计	592,939,530.07	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		
C	制造业	5,122,344.50	0.98
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	28,532.79	0.01
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	68,388.68	0.01
J	金融业		
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业	17,013.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	567,188.29	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	17,658.80	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	13,841.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	5,834,967.16	1.12

### 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	601233	桐昆股份	327,000	4,414,500.00	0.85
2	688248	南网科技	11,763	545,920.83	0.10
3	688062	迈威生物	15,805	213,367.50	0.04

4	688282	理工导航	3,185	115,711.05	0.02
5	688267	中触媒	3,390	105,768.00	0.02
6	688210	统联精密	3,105	66,136.50	0.01
7	688171	纬德信息	2,821	52,639.86	0.01
8	301101	明月镜片	371	21,313.95	0.00
9	301200	大族数控	497	20,491.31	0.00
10	301201	诚达药业	353	18,285.40	0.00

#### 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	27,586,106.36	5.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,339,951.78	39.39
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	207,375,488.77	39.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	113,942,810.41	21.86
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	31,076,143.56	5.96
10	合计	585,320,500.88	112.28

#### 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	2128005	21 平安银行小微债 01	400,000	41,563,967.12	7.97
2	2128012	21 浦发银行 01	400,000	41,435,682.19	7.95
3	2128024	21 中国银行 02	400,000	40,588,120.55	7.79
4	131900025	19 武汉地铁 GN001	300,000	31,816,364.38	6.10
5	155037	18 电投 13	300,000	31,553,917.81	6.05

#### 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。

### 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 平安银行小微债 01、21 浦发银行 01、21 中国银行 02 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2022 年 3 月 25 日，据（银保监罚决字〔2022〕24 号）显示，平安银行股份有限公司存在违法违规行为如下：不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报抵押物价值 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；漏

报投资资产管理产品业务 EAST 数据；漏报委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；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；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《个人信贷业务借据》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。中国银保监会依据《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，对其罚款人民币 400 万元。

2022 年 8 月 9 日，据中国银保监会大连银保监局行政处罚信息公开表的决定，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行因贷款管理不到位，流动资金贷款流入房地产领域；个人贷款业务内控管理不到位，信贷资金用途管控不严格，未按合同约定用途使用；贷款业务“三查”不到位，导致贷款资金回流借款人；未有效识别集团客户并纳入统一授信管理；授信业务“三查”执行不严格，员工行为管理不到位，形成案件损失；漏报案件信息；员工行为管理不到位，原客户经理挪用客户资金，形成案件损失等行为，违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，被责令改正，并处总计 290 万元罚款。

2021 年 12 月 15 日，根据内银保监罚决字〔2021〕66 号的决定，上海浦东发展银行股份有限公司呼和浩特分行因保险销售从业人员在未进行执业登记的情况下从事保险代理业务，违反《保险代理人监管规定》第九十四条规定，被内蒙古银保监局警告并罚款 5000 元。

2021 年 12 月 7 日，据桂银保监罚决字〔2021〕34 号的决定，上海浦东发展银行南宁凤翔支行因二手房房贷申请材料未按规定进行真实性调查，违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（二）项，被广西银保监局罚款人民币 50 万元。

2022 年 1 月 18 日，根据上海银保监局发布行政处罚信息公开表（沪银保监罚决字〔2022〕3 号）的决定，中国银行股份有限公司上海市虹口支行信息安全和员工行为管理严重违反审慎经营规则，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条第三款、第四十六条第（五）项，《商业银行内部控制指引》第二十条、第二十八条，上海银保监局责令其改正，并处罚款 50 万元。

我们认为相关处罚措施对平安银行、浦发银行、中国银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对平安银行、浦发银行、中国银行的债券偿还影响很小。本基金投资 21 平安银行小微债 01、21 浦发银行 01、21 中国银行 02 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	25,074.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	98,064.68
6	其他应收款	1,000.00
7	其他	-
8	合计	124,139.08

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈祥泰混合 A	宝盈祥泰混合 C
报告期期初基金份额总额	216,213,703.25	237,416,047.46
报告期期间基金总申购份额	23,056.77	2,815,758.36
减：报告期期间基金总赎回份额	106,417.55	1,955,495.53
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	216,130,342.47	238,276,310.29

## § 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

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	20220701-20220930	192,426,366.52	-	-	192,426,366.52	42.3500
	2	20220701-20220930	209,919,751.83	-	-	209,919,751.83	46.2000
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。							

### 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祥泰养老混合型证券投资基金设立的文件。

根据《宝盈基金管理有限公司关于变更宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金名称并修改基金法律文件的公告》将宝盈祥泰养老混合型证券投资基金名称变更为宝盈祥泰混合型证券投资基金。

《宝盈祥泰混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥泰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

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：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### 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

2022 年 10 月 26 日