

宝盈资源优选混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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	6
2.4 信息披露方式	6
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	9
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	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈资源优选混合型证券投资基金
基金简称	宝盈资源优选混合
基金主代码	213008
交易代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 15 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
报告期末基金份额总额	595,324,812.94 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期，处于稀缺状态的资源凸现其强大的经济价值，相关上市公司体现出较好的投资价值。本基金根据研究部的估值模型，优选各个行业中具有资源优势的上市公司，建立股票池。在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。</p>
投资策略	<p>本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合，并注重资产在各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。</p> <p>在个股选择层面，本基金以净资产收益率、预期 PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。</p> <p>3、债券及短期金融工具投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取主动投资策略，运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。</p>

	<p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。</p> <p>5、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将结合宏观经济状况和发行人所处行业的景气度，关注发行人基本面情况、公司竞争优势、公司治理结构、有关信息披露情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，选择投资价值高的存托凭证进行投资，谨慎决定存托凭证的标的选择和配置比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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，属于中高收益/风险特征的基金。

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	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637228
传真	0755-83515599	021-60635778
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518034	100033
法定代表人	严震	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-53,958,286.14
本期利润	63,253,267.17

加权平均基金份额本期利润	0.1054
本期加权平均净值利润率	6.86%
本期基金份额净值增长率	7.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	38,200,167.77
期末可供分配基金份额利润	0.0642
期末基金资产净值	921,681,079.57
期末基金份额净值	1.5482
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	149.74%

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。

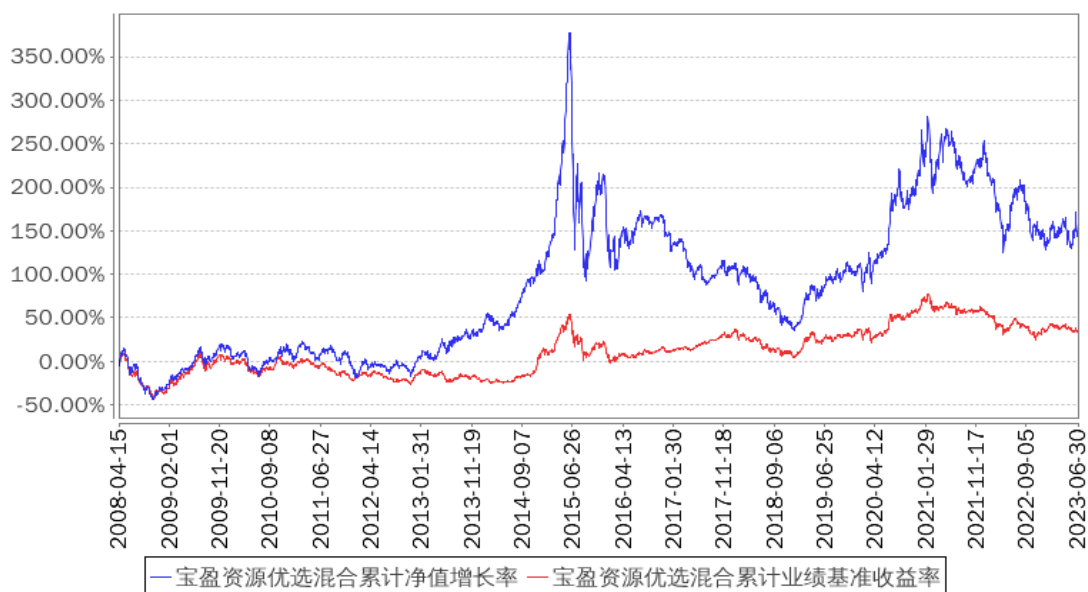
3.2 基金净值表现

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

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	2.31%	2.38%	0.99%	0.65%	1.32%	1.73%
过去三个月	-2.09%	2.04%	-3.51%	0.62%	1.42%	1.42%
过去六个月	7.23%	1.76%	0.04%	0.63%	7.19%	1.13%
过去一年	-13.93%	1.64%	-9.93%	0.74%	-4.00%	0.90%
过去三年	4.41%	1.63%	-2.37%	0.90%	6.78%	0.73%
自基金合同生效起至今	149.74%	1.76%	34.43%	1.18%	115.31%	0.58%

3.2.2 自基金转型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

宝盈资源优选混合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：本基金由原封闭式基金鸿飞转型而来，转型生效日为 2008 年 4 月 15 日。

§ 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、宝盈优质成长混合、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、宝盈国证证券龙头指数发起式、宝盈聚鑫一年定期开放债券发起式、宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式、宝盈半导体产业混合发起式五十九只基金，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		
赵国进	本基金、宝盈核心优势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基金经理	2022 年 2 月 19 日	-	9 年	赵国进先生，南开大学精算学硕士。曾任天津灵杰科技有限公司软件研发工程师，广发证券股份有限公司证券分析师，中国国际金融股份有限公司证券分析师，2015 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈基础产业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。

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

2、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 2023 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

2023 年上半年，A 股市场运行出现波动，在 4 月份进入向下调整阶段。报告期内，沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%。行业上来看（中信一级行业），涨幅领先的行业板块为通信、传媒，上涨幅度分别为 45.41%、43.43%；跌幅较大的行业为房地产、消费者服务，分别下跌 14.07%、27.92%。

宏观经济方面，经济活动恢复低于市场预期，因此 A 股市场在二季度出现较大调整。然而在微观行业方面，AI 技术正在不断迭代创新，国内外互联网公司纷纷推出大语言模型，基于大模型的 AI 创新应用逐渐涌现。与此同时，苹果公司如期发布 MR 设备，打开下一代计算设备革命。我们正处于信息技术新一轮革命的拐点，积极拥抱创新是穿越经济周期的法宝。与一季度相似，A 股市场在二季度依然呈现非常明显的结构性特征，以通信和传媒为代表的人工智能板块成交量占比明显提高，超额收益显著。

本基金主要投资于在驱动经济增长和社会进步过程中具有核心技术资源的公司。本基金经理认为，科技是第一生产力，科技竞争力是企业最重要的资源禀赋，因此本基金更侧重于投资泛科技成长性板块，包括 TMT、新能源、军工等。在 2023 年一季度，本基金增加了对信息技术领域的投资，重点围绕人工智能、数字经济和 IT 国产化等方向进行布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5482 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.23%，业绩比较基准收益率为 0.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受多种因素影响，国内有效需求不足，上半年宏观经济恢复略低于预期，下半年经济增长压力与动力并存。关键时刻，中共中央政治局召开会议对下半年经济工作作出部署，提出要加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险，不断推动经济运行持续好转、内生动力持续增强、社会预期持续改善、风险隐患持续化解，拟推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。会议还提出要活跃资本市场，提振投资者信心。随着各方面刺激政策落地，下半年证券市场机会显著。

与此同时，从行业发展趋势来看，科技产业正迎来“奇点”时刻，将不断孕育新的投资机会，我们看好以下几个方向：

(1) 人工智能：ChatGPT 横空出世，标志着信息技术产业在经历个人 PC 时代与互联网时代之后进入了一个新的时代，人工智能将对每一个行业带来重要影响。随着人工智能应用的普及以及由此带来的增量算力需求，2B 和 2C 领域都存在巨大投资机会。

(2) MR 终端设备：即使经过多年培育，VR/AR 市场曲折发展，根本原因在于产品成熟度与用户需求预期的不一致。苹果公司正式发布万众期待的 Vision Pro，将扭转这一局面，带领行业进入成熟期。

(3) 数字经济：在大数据时代，数据要素成为与土地、劳动力、资本、技术并列的第五大生产要素。数字经济已经是国之大计，随着国家大数据局的正式成立，相关政策支持制度落地，相关产业链的投资机会来自于订单兑现。

(4) 卫星互联网：低轨卫星通信是下一代通信技术的延伸，在军民两个领域都存在显著价值。美国 Starlink 公司已经开启先河，考虑到卫星轨道资源的有限性，中国发展低轨卫星通信已经迫在眉睫。随着首批两个卫星互联网技术试验卫星的成功发射，预计后续将大批量发射以满足基本通信需求，配套产业链的投资机会爆发在即。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：宝盈资源优选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	65,901,774.16	55,592,296.79
结算备付金		981,563.41	1,074,916.79
存出保证金		297,027.60	241,452.01
交易性金融资产	6.4.7.2	860,394,836.86	816,983,556.95
其中：股票投资		860,394,836.86	777,004,956.95
基金投资		-	-
债券投资		-	39,978,600.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		43,825.23	49,653.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		927,619,027.26	873,941,875.55
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		3,209,360.78	1,740.06
应付赎回款		211,424.83	141,419.03
应付管理人报酬		1,150,757.74	1,150,839.65
应付托管费		191,792.95	191,806.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,174,611.39	868,908.17
负债合计		5,937,947.69	2,354,713.52
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	547,309,627.81	555,000,382.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	374,371,451.76	316,586,779.22
净资产合计		921,681,079.57	871,587,162.03
负债和净资产总计		927,619,027.26	873,941,875.55

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，宝盈资源优选混合型证券投资基金基金份额净值为人民币 1.5482 元，基金份额总额 595,324,812.94 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈资源优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		71,391,641.08	-215,113,934.11
1. 利息收入		207,618.29	313,778.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	198,536.23	313,778.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,082.06	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-46,042,588.75	-242,328,089.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-50,718,197.62	-245,975,352.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	81,787.85	49,665.07
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	4,593,821.02	3,597,598.31
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	117,211,553.31	26,854,609.96
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	15,058.23	45,766.59
减：二、营业总支出		8,138,373.91	10,130,353.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,869,790.65	8,573,078.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,144,965.00	1,428,846.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	123,618.26	128,428.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,253,267.17	-225,244,287.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		63,253,267.17	-225,244,287.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		63,253,267.17	-225,244,287.93

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宝盈资源优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	555,000,382.81	-	316,586,779.22	871,587,162.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基	555,000,382.81	-	316,586,779.22	871,587,162.03

金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,690,755.00	-	57,784,672.54	50,093,917.54
(一)、综合收益总额	-	-	63,253,267.17	63,253,267.17
(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)	-7,690,755.00	-	-5,468,594.63	-13,159,349.63
其中:1.基金申购款	13,353,075.76	-	8,870,801.93	22,223,877.69
2.基金赎回款	-21,043,830.76	-	-14,339,396.56	-35,383,227.32
(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、本期末净	547,309,627.81	-	374,371,451.76	921,681,079.57

资产(基金净值)				
项目	上年度可比期间 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)	540,184,114.21	-	901,237,684.25	1,441,421,798.46
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)	540,184,114.21	-	901,237,684.25	1,441,421,798.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	56,310,261.81	-	-330,599,149.57	-274,288,887.76
(一)、综合收益总额	-	-	-225,244,287.93	-225,244,287.93
(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)	56,310,261.81	-	65,351,704.36	121,661,966.17
其中:1.基金申购款	89,929,939.85	-	98,721,363.63	188,651,303.48
2	-33,619,678.04	-	-33,369,659.27	-66,989,337.31

基金赎回款				
(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)	-	-	-170,706,566.00	-170,706,566.00
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	596,494,376.02	-	570,638,534.68	1,167,132,910.70

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

宝盈资源优选混合型证券投资基金(原名为宝盈资源优选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原鸿飞证券投资基金(以下简称“基金鸿飞”)基金份额持有人大会于 2008 年 2 月 6 日至 2008 年 2 月 28 日决议通过的《关于鸿飞证券投资基金转型有关事项的议案》,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2008]392 号《关于核准鸿飞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》,由原鸿飞证券投资基金转型而来。原基金鸿飞为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2008 年 4 月 14 日止。根据深交所深证复[2008]17 号《关于同意鸿飞证券投资基金终止上市的批复》,原基金鸿飞于 2008

年 4 月 14 日进行终止上市权利登记。自 2008 年 4 月 15 日起，原基金鸿飞终止上市，原基金鸿飞更名为宝盈资源优选股票型证券投资基金，《鸿飞证券投资基金基金合同》失效的同时《宝盈资源优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金鸿飞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 587,318,195.00 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《宝盈资源优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原鸿飞证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 6 月 25 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:1.0877285，并于 2008 年 6 月 25 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2008 年 5 月 22 日至 2008 年 6 月 20 日期间内开放集中申购，共募集 53,001,904.19 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 19,187.54 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报(验)字(08)第 0006 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2008 年 6 月 25 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 53,001,904.19 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 19,187.54 份基金份额，并于 2008 年 6 月 25 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈资源优选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股票(含存托凭证)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)投资的比例范围为基金资产的 60%-95%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0%-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有资源优势的股票。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《宝盈资源优选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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产(基金净值)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

本基金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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	65,901,774.16
等于：本金	65,894,298.75
加：应计利息	7,475.41
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	65,901,774.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	784,134,652.59	-	860,394,836.86	76,260,184.27
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	784,134,652.59	-	860,394,836.86	76,260,184.27

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	265.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,061,207.57
其中：交易所市场	1,061,207.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	113,138.35
合计	1,174,611.39

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	603,690,303.58	555,000,382.81
本期申购	14,524,495.73	13,353,075.76
本期赎回（以“-”号填列）	-22,889,986.37	-21,043,830.76
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	595,324,812.94	547,309,627.81

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	92,941,485.53	223,645,293.69	316,586,779.22
本期利润	-53,958,286.14	117,211,553.31	63,253,267.17
本期基金份额交易产生的变动数	-783,031.62	-4,685,563.01	-5,468,594.63
其中：基金申购款	1,544,073.21	7,326,728.72	8,870,801.93
基金赎回款	-2,327,104.83	-12,012,291.73	-14,339,396.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,200,167.77	336,171,283.99	374,371,451.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	184,629.11
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	11,843.80
其他	2,063.32
合计	198,536.23

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-50,718,197.62
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	-50,718,197.62

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,190,881,769.25
减：卖出股票成本总额	1,238,028,048.95

减：交易费用	3,571,917.92
买卖股票差价收入	-50,718,197.62

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	83,742.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,955.00
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	81,787.85

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,000,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	109,876,480.00
减：应计利息总额	125,000.00
减：交易费用	475.00
买卖债券差价收入	-1,955.00

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,593,821.02
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	4,593,821.02

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	117,211,553.31
股票投资	117,212,753.31
债券投资	-1,200.00
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	117,211,553.31

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	14,768.56
基金转换费收入	289.67
合计	15,058.23

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	879.91
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	123,618.26

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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无需要披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,869,790.65	8,573,078.90
其中：支付销售机构的客户维护费	2,270,744.49	2,780,502.19

注：支付基金管理人宝盈基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
当期发生的基金应支付的托管费		1,144,965.00		1,428,846.52

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国建设银行	65,901,774.16	184,629.11	118,942,455.65	301,230.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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（2023 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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,163	13,816.44	24,446.26	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301170	锡南	2023年	6个月	新股流	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

	科技	6月16日		通受限							
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01		-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,979	61,052.15	46,763.77		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10		-
301281	科源制药	2023年5月26日	1-6个月(含)	新股流通受限-送股	-	25.10	97	-	2,434.70		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59		-

301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	新股流通受限-送股	-	53.24	131	-	6,974.44	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-

		日									
301355	南王科技	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25		-
301357	北方长龙	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10		-
301358	湖南裕能	2023年 2月1日	6个月	新股流 通受限	23.77	42.89	1,130	26,860.10	48,465.70		-
301360	荣旗科技	2023年 4月17日	6个月	新股流 通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40		-
301373	凌玮科技	2023年 1月20日	6个月	新股流 通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
301376	致欧科技	2023年 6月14日	6个月	新股流 通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20		-
301382	蜂助手	2023年 5月9日	6个月	新股流 通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72		-
301383	天键股份	2023年 5月31日	6个月	新股流 通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96		-
301386	未来电器	2023年 3月21日	6个月	新股流 通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62		-
301387	光大同创	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52		-
301397	溯联股份	2023年 6月15日	6个月	新股流 通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40		-
301399	英特科技	2023年 5月16日	6个月	新股流 通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01		-
301408	华人健康	2023年 2月22日	6个月	新股流 通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05		-
301419	阿莱德	2023年 2月2日	6个月	新股流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪	2023年	6个月	新股流	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-

	恒通	5月10日		通受限							
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	3,144	20,687.52	23,831.52		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92		-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	935	33,800.25	35,651.55		-

688249	晶合集成	2023年 4月24日	6个月	新股流 通受限	19.86	18.06	5,862	116,419.32	105,867.72	-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股流 通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	硕中科技	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年 5月12日	6个月	新股流 通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年 6月20日	6个月	新股流 通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年 4月7日	6个月	新股流 通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年 4月28日	6个月	新股流 通受限	5.69	5.41	11,088	63,090.72	59,986.08	-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	11.10	17.04	3,555	39,460.50	60,577.20	-
688479	友车科技	2023年 5月4日	6个月	新股流 通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年 3月28日	6个月	新股流 通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023年 6月20日	1-6个月(含)	新股流 通受限- 送股	-	122.11	72	-	8,791.92	-
688523	航天环宇	2023年 5月26日	6个月	新股流 通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年 3月24日	6个月	新股流 通受限	152.38	135.97	335	51,047.30	45,549.95	-

		日									
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32		-

注：1. 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份不适用《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，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，属于中高收益/风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资（含存托凭证）和权证投资等。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中国建设银行股份有限公司，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。

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	39,978,600.00
合计	-	39,978,600.00

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

无。

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）。

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	65,901,774.16	-	-	-	65,901,774.16
结算备付金	981,563.41	-	-	-	981,563.41
存出保证金	297,027.60	-	-	-	297,027.60

交易性金融资产	-	-	-	-860,394,836.86	860,394,836.86
应收申购款	-	-	-	43,825.23	43,825.23
资产总计	67,180,365.17	-	-	-860,438,662.09	927,619,027.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	211,424.83	211,424.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,150,757.74	1,150,757.74
应付托管费	-	-	-	191,792.95	191,792.95
应付清算款	-	-	-	3,209,360.78	3,209,360.78
其他负债	-	-	-	1,174,611.39	1,174,611.39
负债总计	-	-	-	5,937,947.69	5,937,947.69
利率敏感度缺口	67,180,365.17	-	-	-854,500,714.40	921,681,079.57
上年度末 2022 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	55,592,296.79	-	-	-	55,592,296.79
结算备付金	1,074,916.79	-	-	-	1,074,916.79
存出保证金	241,452.01	-	-	-	241,452.01
交易性金融资产	39,978,600.00	-	-	-777,004,956.95	816,983,556.95
应收申购款	-	-	-	49,653.01	49,653.01
资产总计	96,887,265.59	-	-	-777,054,609.96	873,941,875.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	141,419.03	141,419.03
应付管理人报酬	-	-	-	1,150,839.65	1,150,839.65
应付托管费	-	-	-	191,806.61	191,806.61
应付清算款	-	-	-	1,740.06	1,740.06
其他负债	-	-	-	868,908.17	868,908.17
负债总计	-	-	-	2,354,713.52	2,354,713.52
利率敏感度缺口	96,887,265.59	-	-	-774,699,896.44	871,587,162.03

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.59%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

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，采用“自上而下”进行资产配置和行业配置、“自下而上”精选个股的积极投资策略。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投资(含存托凭证)比例为基金总资产的 60%-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有资源优势的股票。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 2023年6月30日		上年度末 2022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	860,394,836.86	93.35	777,004,956.95	89.15
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	860,394,836.86	93.35	777,004,956.95	89.15

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	34,532,957.23	38,979,675.24
	2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-34,532,957.23	-38,979,675.24

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	858,207,305.60	774,893,812.07
第二层次	647,795.70	39,978,600.00
第三层次	1,539,735.56	2,111,144.88
合计	860,394,836.86	816,983,556.95

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。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 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	860,394,836.86	92.75
	其中：股票	860,394,836.86	92.75
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	66,883,337.57	7.21
8	其他各项资产	340,852.83	0.04
9	合计	927,619,027.26	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	-	-
C	制造业	240,272,205.69	26.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	26,864,592.78	2.91
F	批发和零售业	64,536,069.67	7.00

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	528,063,993.53	57.29
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	180,760.49	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	163,450.27	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	278,316.96	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	860,394,836.86	93.35

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	688111	金山办公	187,290	88,442,083.80	9.60
2	301263	泰恩康	3,083,048	64,374,042.24	6.98
3	002368	太极股份	1,445,900	59,527,703.00	6.46
4	002555	三七互娱	1,641,500	57,255,520.00	6.21
5	300308	中际旭创	381,600	56,266,920.00	6.10
6	300634	彩讯股份	1,808,900	47,754,960.00	5.18
7	600941	中国移动	466,544	43,528,555.20	4.72
8	688277	天智航	2,306,692	42,535,400.48	4.61
9	300502	新易盛	622,440	42,307,246.80	4.59
10	688777	中控技术	618,753	38,845,313.34	4.21
11	300212	易华录	1,161,659	38,601,928.57	4.19
12	600050	中国联通	7,826,000	37,564,800.00	4.08
13	688668	鼎通科技	347,765	34,011,417.00	3.69
14	300533	冰川网络	576,450	28,799,442.00	3.12
15	002777	久远银海	808,100	28,663,307.00	3.11
16	300442	润泽科技	899,460	27,667,389.60	3.00
17	000032	深桑达 A	815,500	26,829,950.00	2.91
18	600536	中国软件	543,490	25,478,811.20	2.76
19	601728	中国电信	4,245,000	23,899,350.00	2.59
20	002463	沪电股份	873,400	18,288,996.00	1.98
21	300476	胜宏科技	388,700	9,371,557.00	1.02

22	688246	嘉和美康	206,112	8,629,909.44	0.94
23	688249	晶合集成	58,616	1,101,335.70	0.12
24	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.07
25	688472	阿特斯	35,544	647,895.24	0.07
26	688469	中芯集成	110,878	625,795.38	0.07
27	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.04
28	688146	中船特气	9,346	390,595.75	0.04
29	688352	颀中科技	23,609	314,070.39	0.03
30	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.03
31	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.03
32	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.03
33	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
34	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.03
35	301307	美利信	6,865	230,766.00	0.03
36	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.02
37	688458	美芯晟	2,206	210,955.41	0.02
38	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.02
39	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.02
40	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.02
41	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.02
42	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.02
43	688623	二元科技	1,776	162,256.88	0.02
44	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.02
45	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.02
46	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.02
47	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.02
48	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.02
49	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.02
50	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.02
51	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.02
52	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
53	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
54	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
55	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
56	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.01
57	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
58	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
59	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
60	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
61	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.01
62	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.01
63	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.01
64	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.01

65	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
66	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.01
67	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.01
68	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.01
69	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
70	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
71	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01
72	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
73	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
74	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
75	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
76	301358	湖南裕能	1,130	48,465.70	0.01
77	301260	格力博	1,979	46,763.77	0.01
78	688531	日联科技	335	45,549.95	0.00
79	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
80	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
81	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
82	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
83	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
84	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
85	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
86	001287	中电港	1,163	24,446.26	0.00
87	601061	中信金属	3,144	23,831.52	0.00
88	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
89	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
90	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
91	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
92	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
93	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
94	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
95	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
96	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
97	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
98	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
99	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
100	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
101	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
102	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
103	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
104	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
105	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
106	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
107	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00

108	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
109	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
110	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
111	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
112	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
113	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

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	002555	三七互娱	64,804,004.43	7.44
2	002368	太极股份	56,914,922.80	6.53
3	300533	冰川网络	54,101,733.96	6.21
4	300634	彩讯股份	53,366,684.79	6.12
5	688489	三未信安	47,172,778.80	5.41
6	600050	中国联通	46,297,569.61	5.31
7	300212	易华录	46,247,217.44	5.31
8	300308	中际旭创	46,179,084.18	5.30
9	300442	润泽科技	45,655,321.00	5.24
10	688277	天智航	42,293,166.01	4.85
11	600941	中国移动	41,212,566.40	4.73
12	600536	中国软件	38,525,257.64	4.42
13	300299	富春股份	38,237,924.97	4.39
14	603108	润达医疗	37,235,049.00	4.27
15	688111	金山办公	36,716,490.16	4.21
16	300502	新易盛	31,863,601.86	3.66
17	601728	中国电信	29,261,769.00	3.36
18	300059	东方财富	29,185,860.36	3.35
19	603138	海量数据	28,960,009.32	3.32
20	002777	久远银海	28,425,466.66	3.26
21	002261	拓维信息	28,213,709.93	3.24
22	002955	鸿合科技	28,044,838.60	3.22
23	000032	深桑达 A	27,168,409.00	3.12
24	688668	鼎通科技	27,067,302.14	3.11
25	300174	元力股份	26,240,659.82	3.01
26	300693	盛弘股份	22,775,069.35	2.61
27	688777	中控技术	18,496,734.86	2.12
28	002463	沪电股份	18,481,927.03	2.12
29	002841	视源股份	18,330,579.48	2.10
30	688498	源杰科技	17,979,258.30	2.06

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	300750	宁德时代	91,734,483.00	10.52
2	688777	中控技术	65,513,216.57	7.52
3	300604	长川科技	50,745,826.35	5.82
4	301117	佳缘科技	50,651,289.28	5.81
5	002049	紫光国微	48,481,590.76	5.56
6	603138	海量数据	47,408,540.64	5.44
7	300174	元力股份	47,171,015.98	5.41
8	002920	德赛西威	46,789,323.78	5.37
9	002371	北方华创	44,589,930.00	5.12
10	688489	三未信安	44,036,241.95	5.05
11	300014	亿纬锂能	41,643,995.57	4.78
12	603876	鼎胜新材	41,018,522.28	4.71
13	688111	金山办公	39,780,930.18	4.56
14	688800	瑞可达	35,790,850.01	4.11
15	301095	广立微	35,122,676.37	4.03
16	603108	润达医疗	31,175,265.00	3.58
17	002121	科陆电子	30,390,454.00	3.49
18	300533	冰川网络	30,302,580.00	3.48
19	688536	思瑞浦	29,598,003.36	3.40
20	600536	中国软件	28,651,722.25	3.29
21	002261	拓维信息	27,269,012.00	3.13
22	300299	富春股份	24,466,982.00	2.81
23	002955	鸿合科技	22,708,930.60	2.61
24	300059	东方财富	22,431,847.40	2.57
25	002841	视源股份	20,659,879.07	2.37
26	300693	盛弘股份	19,720,296.00	2.26
27	300212	易华录	19,359,882.67	2.22
28	002368	太极股份	19,248,263.82	2.21
29	688498	源杰科技	18,716,036.35	2.15
30	002555	三七互娱	18,036,749.18	2.07

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	1,204,205,175.55
卖出股票收入（成交）总额	1,190,881,769.25

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指买卖成交金额，即成交单价乘以成交数量，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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

7.11.2 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。

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除三七互娱的发行主体外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。

三七互娱网络科技集团股份有限公司于 2023 年 6 月 27 日分别收到中国证券监督管理委员会下发的《中国证券监督管理委员会立案告知书》（编号：证监立案字 03720230061 号、证监立案字 03720230062 号、证监立案字 03720230063 号）。因涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，证监会决定对三七互娱网络科技集团股份

有限公司立案。

我们认为立案调查暂未对三七互娱正常经营产生影响，不改变公司长期投资价值，基金管理人未来会持续关注此类事件的发展趋势。

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	297,027.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	43,825.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	340,852.83

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情况。

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

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 (%)
52,236	11,396.83	49,236,343.51	8.27	546,088,469.43	91.73

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,079.67	0.0003

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年4月15日） 基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	603,690,303.58
本报告期基金总申购份额	14,524,495.73
减：本报告期基金总赎回份额	22,889,986.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	595,324,812.94

§ 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：

宝盈基金管理有限公司股东中铁信托有限责任公司、中国对外经济贸易信托有限公司以股东直接作出决定的方式通过宝盈基金管理有限公司独立董事变更事项，同意王汀汀辞去宝盈基金管理有限公司独立董事职务，何茵担任宝盈基金管理有限公司独立董事职务。

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，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金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 (%)	
长江证券	3	885,388,017.67	37.23	815,708.89	37.23	-
东方财富证券	2	431,187,922.30	18.13	397,253.39	18.13	-
中信建投证券	2	415,187,259.25	17.46	382,514.04	17.46	-
招商证券	1	342,232,668.30	14.39	315,290.22	14.39	-
东方证券	2	165,616,963.15	6.96	152,582.08	6.96	-
信达证券	1	95,037,928.20	4.00	87,558.55	4.00	-
广发证券	2	33,787,322.66	1.42	31,128.50	1.42	-
东吴证券	4	6,404,254.28	0.27	5,900.21	0.27	-
浙商证券	2	3,209,108.22	0.13	2,956.55	0.13	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	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 经营行为规范，财务状况良好，内控制度健全，在业内有良好的信誉。
- ② 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。
- ③ 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能
力，能及时、全面的向公司提供高质量的信息服务；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的
交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
- ④ 本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，并与被选择的券商签订
证券交易单元租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

- ① 租用交易单元情况
无。
- ② 退租交易单元情况
无。

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(%)
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方财	-	-	-	-	-	-

富证券						
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前	-	-	-	-	-	-

海证券						
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	宝盈资源优选混合型证券投资基金 2023 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	2023-04-21
2	宝盈基金管理有限公司旗下 59 只基金 2023 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	2023-04-21
3	宝盈基金管理有限公司关于新增中欧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	2023-04-21
4	宝盈资源优选混合型证券投资基金 2022 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	2023-03-30
5	宝盈基金管理有限公司旗下 56 只基金 2022 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	2023-03-30
6	宝盈基金管理有限公司关于新增华夏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	2023-03-03

7	宝盈资源优选混合型证券投资基金 2022 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	2023-01-20
8	宝盈基金管理有限公司旗下 57 只基金 2022 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	2023-01-20

§ 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

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。

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

中国证监会批复鸿飞基金名称变更为宝盈资源优选股票型证券投资基金的文件。

根据《关于宝盈资源优选股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈资源优选股票型证券投资基金名称变更为宝盈资源优选混合型证券投资基金。

《宝盈资源优选混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈资源优选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：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

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

2023 年 8 月 30 日