

宝盈祥瑞定期开放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 | 5 |
| 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 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| § 7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 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 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |
| 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 | 50 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 50 |
| § 10 重大事件揭示 | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 10.8 其他重大事件 | 53 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| 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 | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| § 12 备查文件目录 | 54 |
| 12.1 备查文件目录 | 54 |
| 12.2 存放地点 | 54 |
| 12.3 查阅方式 | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 宝盈祥颐定期开放混合 | |
| 基金主代码 | 006398 | |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 3 月 20 日 | |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 345,461,937.24 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 宝盈祥颐定期开放混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006398 | 006399 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 319,731,923.22 份 | 25,730,014.02 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金采取稳健的投资策略，在控制下行风险的前提下，确定大类资产配置比例，通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益，适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略和存托凭证投资策略五个部分组成。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×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，属于中等收益/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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张磊 | 许俊 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | zhangl@byfunds.com | fxjd_hq@bank-of-china.com |

| | | |
|--------|------------------------------|------------------|
| 客户服务电话 | 400-8888-300 | 95566 |
| 传真 | 0755-83515599 | 010-66594942 |
| 注册地址 | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501 | 北京市西城区复兴门内大街 1 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | 518034 | 100818 |
| 法定代表人 | 严震 | 葛海蛟 |

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 | 基金管理人办公场所、基金托管人住所 |

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(2023年1月1日-2023年6月30日) | |
|---------------|---------------------------|--------------|
| | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 宝盈祥颐定期开放混合 C |
| 本期已实现收益 | 232,229.39 | -36,996.21 |
| 本期利润 | 78,763.12 | -48,608.89 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0002 | -0.0019 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.02% | -0.18% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.02% | -0.18% |
| 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 | 1,895,588.08 |
| | 期末可供分配基金份额利润 | 0.0737 |

| | | |
|--------------|------------------------|---------------|
| 期末基金资产净值 | 349,224,626.15 | 27,625,602.10 |
| 期末基金份额净值 | 1.0922 | 1.0737 |
| 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 | 9.22% | 7.37% |

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

宝盈祥颐定期开放混合 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 | -0.37% | 0.40% | 0.75% | 0.25% | -1.12% | 0.15% |
| 过去三个月 | -0.27% | 0.41% | -0.17% | 0.24% | -0.10% | 0.17% |
| 过去六个月 | 0.02% | 0.38% | 1.93% | 0.25% | -1.91% | 0.13% |
| 过去一年 | -6.81% | 0.37% | -1.24% | 0.29% | -5.57% | 0.08% |
| 过去三年 | -2.19% | 0.33% | 7.65% | 0.36% | -9.84% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.22% | 0.29% | 15.96% | 0.36% | -6.74% | -0.07% |

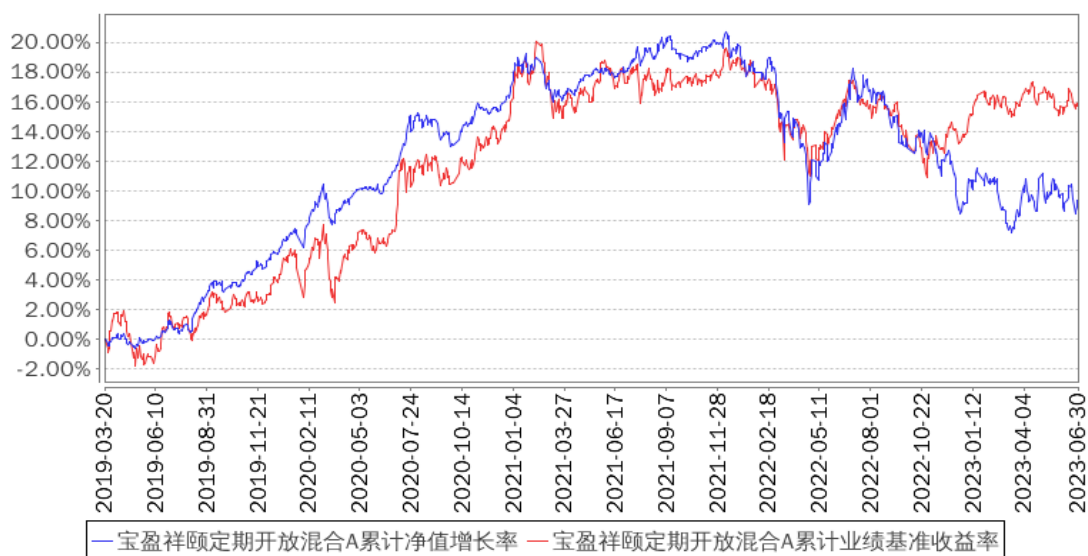
宝盈祥颐定期开放混合 C

| 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 | -0.40% | 0.40% | 0.75% | 0.25% | -1.15% | 0.15% |
| 过去三个月 | -0.37% | 0.41% | -0.17% | 0.24% | -0.20% | 0.17% |

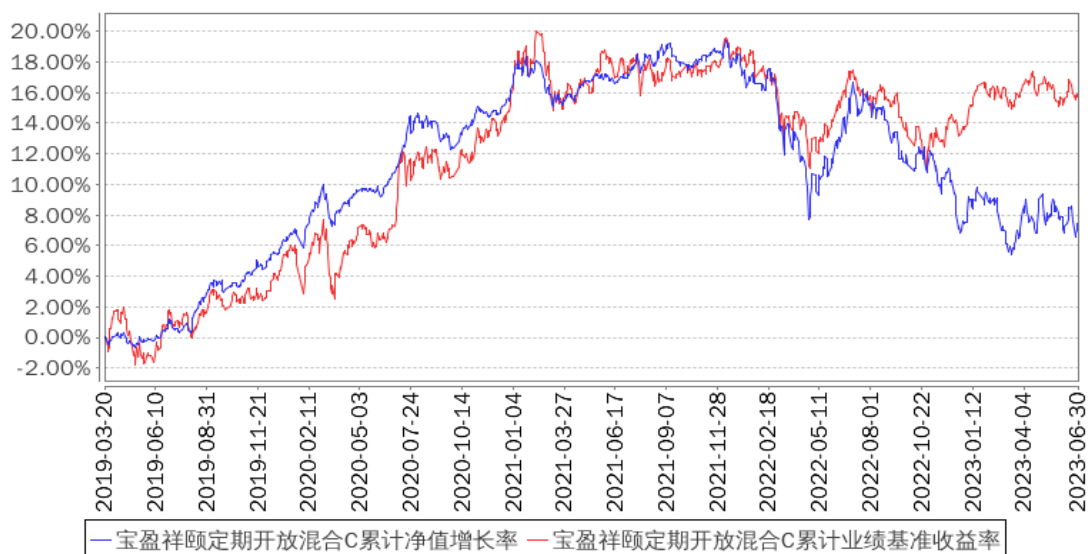
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 过去六个月 | -0.18% | 0.38% | 1.93% | 0.25% | -2.11% | 0.13% |
| 过去一年 | -7.18% | 0.37% | -1.24% | 0.29% | -5.94% | 0.08% |
| 过去三年 | -3.35% | 0.33% | 7.65% | 0.36% | -11.00% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.37% | 0.29% | 15.96% | 0.36% | -8.59% | -0.07% |

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

宝盈祥颐定期开放混合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



宝盈祥颐定期开放混合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 | | |
| 吕 姝 仪 | 本基金、宝盈货币市场证券投资基 | 2021 年 5 月 14 日 | - | 10 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 |

| | | | | | |
|----|--|-----------------|---|------|--|
| | 金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金、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、宝盈祥琪混合型证券投资基金基金经理 | | | | 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，宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
| 邓栋 | 本基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证 | 2019 年 3 月 30 日 | - | 13 年 | 邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008 年 3 月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自 2010 年 1 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部，历任宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金、宝盈聚福 39 个月定期开放债券型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈祥乐一年持有期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。 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；固定收益部总经理 | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

注：1、本基金基金经理均非首任基金经理，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

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，海外地缘冲突加剧，通胀趋势下行但仍显著高于目标值，货币政策继续收紧，经济处于下行区间。国内经济运行延续恢复态势。通胀方面，主要工业品价格先上后下再上、整体有所下行，农产品价格先上后下再上、整体小幅上行，居民消费价格呈下行走势。

权益方面，A股年初上涨后震荡下跌，沪深300指数上半年下跌0.75%，创业板指下跌5.61%。本基金的股票资产仓位上保持较高水平。

债券方面，10年期国债收益率小幅上行至2.9%后震荡下行至2.63%。1年期国债收益率震荡上行至2.3%附近后震荡下行至1.87%。本产品保持了一定的债券久期和杠杆水平，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颐定期开放混合A的基金份额净值为1.0922元，本报告期基金份额净值增长率为0.02%；截至本报告期末宝盈祥颐定期开放混合C的基金份额净值为1.0737元，本报告期基金份额净值增长率为-0.18%。同期业绩比较基准收益率为1.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年下半年，政策积极发力，经济预期弱复苏。

展望下半年，中美利差依然维持高位，离岸美元信用影响全球金融资产定价，A股的趋势与美元周期高度相关，下半年仍需密切关注美元周期的态势，进行大类资产的策略配置。

本基金权益部分将根据市场情况，优化个股持仓，债券部分灵活久期配置。预计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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：宝盈祥瑞定期开放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 | 3,785,908.17 | 37,256,774.77 |
| 结算备付金 | | 1,955,782.16 | 3,393,137.60 |
| 存出保证金 | | 41,361.27 | 89,037.97 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 372,275,124.62 | 354,874,781.45 |
| 其中：股票投资 | | 111,446,041.20 | 127,248,699.19 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 260,829,083.42 | 227,626,082.26 |
| 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 | | 1,391,145.22 | 14,167,163.19 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 379,449,321.44 | 409,780,894.98 |
| 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 | | 1,881,692.48 | 8,581,366.78 |
| 应付赎回款 | | - | 23,472,333.97 |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 310,515.74 | 387,842.38 |
| 应付托管费 | | 62,103.15 | 77,568.50 |
| 应付销售服务费 | | 9,106.58 | 10,595.19 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 6,963.69 | 7,478.65 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 328,711.55 | 423,635.49 |
| 负债合计 | | 2,599,093.19 | 32,960,820.96 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 345,461,937.24 | 345,461,937.24 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 31,388,291.01 | 31,358,136.78 |
| 净资产合计 | | 376,850,228.25 | 376,820,074.02 |
| 负债和净资产总计 | | 379,449,321.44 | 409,780,894.98 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.0922 元，A 类基金份额 319,731,923.22 份；C 类基金份额净值人民币 1.0737 元，C 类基金份额 25,730,014.02 份；宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金份额总额合计为 345,461,937.24 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈祥颐定期开放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 | | 3,572,566.83 | -10,257,953.89 |
| 1. 利息收入 | | 30,689.77 | 68,051.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 30,689.77 | 59,027.30 |
| 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 | | - | 9,024.65 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 3,706,956.01 | -11,070,975.31 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -1,090,279.65 | -25,507,629.65 |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|---------------------------------|------------|--------------|----------------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 4,291,574.19 | 13,206,447.81 |
| 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 | 505,661.47 | 1,230,206.53 |
| 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 | -165,078.95 | 744,969.47 |
| 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 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 3,542,412.60 | 5,707,850.99 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,877,736.35 | 2,966,557.99 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 375,547.25 | 593,311.57 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 55,111.17 | 81,867.35 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 1,111,835.45 | 1,912,031.27 |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | 1,111,835.45 | 1,912,031.27 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 6,174.11 | 33,281.83 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 116,008.27 | 120,800.98 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 30,154.23 | -15,965,804.88 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 30,154.23 | -15,965,804.88 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 30,154.23 | -15,965,804.88 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥颐定期开放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) | 345,461,937.24 | - | 31,358,136.78 | 376,820,074.02 |
| 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) | 345,461,937.24 | - | 31,358,136.78 | 376,820,074.02 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | - | 30,154.23 | 30,154.23 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 30,154.23 | 30,154.23 |
| (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) | - | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.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) | | | | |
| (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) | 345,461,937.24 | - | 31,388,291.01 | 376,850,228.25 |
| 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) | 525,913,894.32 | - | 103,830,953.38 | 629,744,847.70 |
| 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) | 525,913,894.32 | - | 103,830,953.38 | 629,744,847.70 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -103,562,105.87 | - | -31,647,866.15 | -135,209,972.02 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -15,965,804.88 | -15,965,804.88 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| (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) | -103,562,105.87 | - | -15,682,061.27 | -119,244,167.14 |
| 其中:1. 基金申购款 | 668.90 | - | 102.27 | 771.17 |
| 2. 基金赎回款 | -103,562,774.77 | - | -15,682,163.54 | -119,244,938.31 |
| (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) | 422,351,788.45 | - | 72,183,087.23 | 494,534,875.68 |

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

基金管理人负责人

张献锦

主管会计工作负责人

何瑜

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈祥颐定期开放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[2018]第 1381 号《关于准予宝盈祥颐定期开放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《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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 475,345,205.91 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 0169 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 475,557,489.60 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,283.69 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为定期开放式基金。封闭期为自基金合同生效日起(含)或者每一个开放期结束之日次日起(含)6 个月的期间。本基金自封闭期结束之日后第一个工作日起(含)进入五至二十个工作日的开放期,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。本基金封闭期内不办理申购、赎回及转换等业务,也不上市交易。

根据《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈祥颐定期开放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、在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,称为宝盈祥颐定期开放混合 A;在投资人认购/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,称为宝盈祥颐定期开放混合 C。宝盈祥颐定期开放混合 A 和宝盈祥颐定期开放混合 C 分别计算基金份额净值,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《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有较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、次级债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债纯债)、可交换债券等)、

股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、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、权证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。基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 0% - 45%, 开放期内, 持有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; 封闭期内, 本基金不受前述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为: 中证全债指数收益率 \times 70%+沪深 300 指数收益率 \times 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、《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》、《宝盈祥颐定期开放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 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期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 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 3,785,908.17 |
| 等于：本金 | 3,784,416.77 |
| 加：应计利息 | 1,491.40 |
| 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 | 3,785,908.17 |

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 | 117,334,584.11 | - | 111,446,041.20 | -5,888,542.91 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 191,004,048.22 | 2,808,596.17 | 194,156,596.17 | 343,951.78 |
| | 银行间市场 | 66,801,068.71 | 1,237,337.25 | 66,672,487.25 | -1,365,918.71 |
| | 合计 | 257,805,116.93 | 4,045,933.42 | 260,829,083.42 | -1,021,966.93 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 375,139,701.04 | 4,045,933.42 | 372,275,124.62 | -6,910,509.84 | |

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 | - |

| | |
|-----------|------------|
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 230,451.40 |
| 其中：交易所市场 | 229,601.40 |
| 银行间市场 | 850.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 98,260.15 |
| 合计 | 328,711.55 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈祥瑞定期开放混合 A

| 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 | 319,731,923.22 | 319,731,923.22 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 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 | 319,731,923.22 | 319,731,923.22 |

宝盈祥瑞定期开放混合 C

| 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 | 25,730,014.02 | 25,730,014.02 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 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 | 25,730,014.02 | 25,730,014.02 |

注：根据《宝盈祥瑞定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该日）6 个月的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）至 6 个月后的对应日的期间，本基金封闭期内不办理申购、赎回及转换等业务，也不上市交易。

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

宝盈祥颐定期开放混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 31,269,754.46 | -1,855,814.65 | 29,413,939.81 |
| 本期利润 | 232,229.39 | -153,466.27 | 78,763.12 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 31,501,983.85 | -2,009,280.92 | 29,492,702.93 |

宝盈祥颐定期开放混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 上年度末 | 2,087,614.32 | -143,417.35 | 1,944,196.97 |
| 本期利润 | -36,996.21 | -11,612.68 | -48,608.89 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,050,618.11 | -155,030.03 | 1,895,588.08 |

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 | 13,778.18 |
| 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 | 16,452.70 |
| 其他 | 458.89 |
| 合计 | 30,689.77 |

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 | -1,090,279.65 |
| 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 | -1,090,279.65 |
|----|---------------|

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 | 220,628,421.26 |
| 减：卖出股票成本总额 | 221,071,148.57 |
| 减：交易费用 | 647,552.34 |
| 买卖股票差价收入 | -1,090,279.65 |

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 | 5,146,277.98 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -854,703.79 |
| 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 | 4,291,574.19 |

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 | 263,117,888.68 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 261,427,139.40 |
| 减：应计利息总额 | 2,540,613.07 |
| 减：交易费用 | 4,840.00 |
| 买卖债券差价收入 | -854,703.79 |

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 | 505,661.47 |
| 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 | 505,661.47 |

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 | -165,078.95 |
| 股票投资 | -4,267,408.60 |
| 债券投资 | 4,102,329.65 |
| 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 | -165,078.95 |

6.4.7.21 其他收入

无。

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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 8,148.12 |
| 债券账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 116,008.27 |

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 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 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 | 1,877,736.35 | 2,966,557.99 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 936,874.82 | 1,479,606.49 |

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 1.00%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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.00%/

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 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 375,547.25 | 593,311.57 |

注：支付基金托管人中国银行的基金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：日基金托管费=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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
|--------------------|--|-----------------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 宝盈祥颐定期开放混合 C | 合计 |
| 宝盈基金 | - | 65.05 | 65.05 |
| 中国银行 | - | 53,112.86 | 53,112.86 |
| 合计 | - | 53,177.91 | 53,177.91 |
| 获得销售服务费的各关联方 名称 | 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销售服务费 | | |
| | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 宝盈祥颐定期开放混合 C | 合计 |
| 宝盈基金 | - | 97.81 | 97.81 |
| 中国银行 | - | 79,434.01 | 79,434.01 |
| 合计 | - | 79,531.82 | 79,531.82 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金 C 类份额的基金资产净值 0.4%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：

日基金销售服务费=前一日基金 C 类份额的基金资产净值×0.4%/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

本基金本报告期间及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 |
| 中国银行 | 3,785,908.17 | 13,778.18 | 9,614,618.50 | 36,729.68 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 |
| 601061 | 中信金 属 | 2023年 3月30 | 6个月 | 新股流 通受限 | 6.58 | 7.58 | 1,685 | 11,087.30 | 12,772.30 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|----------------|-----|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
| | | 日 | | | | | | | | | |
| 601065 | 江盐集团 | 2023年 3月31日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 10.36 | 11.84 | 635 | 6,578.60 | 7,518.40 | | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023年 3月31日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 11.66 | 12.26 | 515 | 6,004.90 | 6,313.90 | | - |
| 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 | 521 | 9,273.80 | 9,320.69 | | - |
| 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 | 502 | 18,147.30 | 19,141.26 | | - |
| 688249 | 晶合集成 | 2023年 4月24日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 19.86 | 18.06 | 3,048 | 60,533.28 | 55,046.88 | | - |
| 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 | 颀中科技 | 2023年 4月11日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 12.10 | 12.07 | 1,445 | 17,484.50 | 17,441.15 | | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023年 5月12日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 23.60 | 64.67 | 482 | 11,375.20 | 31,170.94 | | - |
| 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 | 211 | 15,825.00 | 19,150.36 | | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023年 4月28日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 5.69 | 5.41 | 5,637 | 32,074.53 | 30,496.17 | | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|--------------------|--------------|-------------------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 688472 | 阿特斯 | 2023年 6月2日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 11.10 | 17.04 | 1,941 | 21,545.10 | 33,074.64 | - |
| 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 | 541 | 21,634.59 | 19,860.11 | - |
| 688507 | 索辰科 技 | 2023年 4月10 日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 245.56 | 122.11 | 87 | 21,363.72 | 10,623.57 | - |
| 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 | 42 | - | 5,128.62 | - |
| 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 | 179 | 27,276.02 | 24,338.63 | - |
| 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 | 352 | 15,371.84 | 18,673.60 | - |
| 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 | 546 | 16,521.96 | 13,830.18 | - |
| 688581 | 安杰思 | 2023年 5月12 日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 125.80 | 118.03 | 128 | 16,102.40 | 15,107.84 | - |
| 688582 | 芯动联 科 | 2023年 6月21 日 | 6个月 | 新股流 通受限 | 26.74 | 40.68 | 532 | 14,225.68 | 21,641.76 | - |
| 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 | 2023年 | 6个月 | 新股流 | 55.00 | 55.00 | 140 | 7,700.00 | 7,700.00 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
| | 技 | 6月30日 | | 通受限 | | | | | | | |
| 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 | 139 | 17,497.32 | 12,063.81 | | - |
| 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份，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低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等收益/风险特征的基金。本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票(含存托凭证)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、权证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人中国银行，因而与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 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 | 20,423,536.98 | 59,758,422.95 |
| 合计 | 20,423,536.98 | 59,758,422.95 |

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 205,426,753.02 | 145,527,371.25 |
| AAA 以下 | 3,837,857.10 | 5,382,915.73 |
| 未评级 | 31,140,936.32 | 16,957,372.33 |
| 合计 | 240,405,546.44 | 167,867,659.31 |

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于约定开放日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于开放期内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》且于基金开放期内按照《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时间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%，于开放期内，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%。

于开放期内，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、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，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 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 | 3,785,908.17 | - | - | - | 3,785,908.17 |
| 结算备付金 | 1,955,782.16 | - | - | - | 1,955,782.16 |
| 存出保证金 | 41,361.27 | - | - | - | 41,361.27 |
| 交易性金融资产 | 54,849,426.00 | 205,979,657.42 | - | -111,446,041.20 | 372,275,124.62 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,391,145.22 | 1,391,145.22 |
| 资产总计 | 60,632,477.60 | 205,979,657.42 | - | -112,837,186.42 | 379,449,321.44 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 310,515.74 | 310,515.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | 62,103.15 | 62,103.15 |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,881,692.48 | 1,881,692.48 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 9,106.58 | 9,106.58 |
| 应交税费 | - | - | - | 6,963.69 | 6,963.69 |
| 其他负债 | - | - | - | 328,711.55 | 328,711.55 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|-----------------|----------------|
| 负债总计 | - | - | - | 2,599,093.19 | 2,599,093.19 |
| 利率敏感度缺口 | 60,632,477.60 | 205,979,657.42 | - | -110,238,093.23 | 376,850,228.25 |
| 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 | 37,256,774.77 | - | - | - | 37,256,774.77 |
| 结算备付金 | 3,393,137.60 | - | - | - | 3,393,137.60 |
| 存出保证金 | 89,037.97 | - | - | - | 89,037.97 |
| 交易性金融资产 | 60,775,308.98 | 141,877,028.51 | 24,973,744.77 | 127,248,699.19 | 354,874,781.45 |
| 应收清算款 | - | - | - | 14,167,163.19 | 14,167,163.19 |
| 资产总计 | 101,514,259.32 | 141,877,028.51 | 24,973,744.77 | 141,415,862.38 | 409,780,894.98 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 23,472,333.97 | 23,472,333.97 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 387,842.38 | 387,842.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | 77,568.50 | 77,568.50 |
| 应付清算款 | - | - | - | 8,581,366.78 | 8,581,366.78 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 10,595.19 | 10,595.19 |
| 应交税费 | - | - | - | 7,478.65 | 7,478.65 |
| 其他负债 | - | - | - | 423,635.49 | 423,635.49 |
| 负债总计 | - | - | - | 32,960,820.96 | 32,960,820.96 |
| 利率敏感度缺口 | 101,514,259.32 | 141,877,028.51 | 24,973,744.77 | 108,455,041.42 | 376,820,074.02 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） | |
| 1. 市场利率下降 25 个基点 | 791,502.16 | 791,245.70 | |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -773,472.35 | -779,267.69 | |

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，通过对宏观经济形势与市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极大类资产配置策略；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(含存托凭证)投资比例为基金资产的 0%-45%；开放期内，持有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；在封闭期内，本基金不受前述 5%的限制。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 | 111,446,041.20 | 29.57 | 127,248,699.19 | 33.77 |
| 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 | 111,446,041.20 | 29.57 | 127,248,699.19 | 33.77 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除中证全债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. 中证全债指数收益率上升 5% | 5,188,889.42 | 4,824,051.95 |
| | 2. 中证全债指数收益率下降 5% | -5,188,889.42 | -4,824,051.95 |

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 | 110,846,938.10 | 140,384,134.38 |
| 第二层次 | 260,905,588.42 | 214,082,256.78 |
| 第三层次 | 522,598.10 | 408,390.29 |
| 合计 | 372,275,124.62 | 354,874,781.45 |

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 111,446,041.20 | 29.37 |
| | 其中：股票 | 111,446,041.20 | 29.37 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 260,829,083.42 | 68.74 |
| | 其中：债券 | 260,829,083.42 | 68.74 |
| | 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 | 5,741,690.33 | 1.51 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,432,506.49 | 0.38 |
| 9 | 合计 | 379,449,321.44 | 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 | 83,909,944.76 | 22.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 8,689.41 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 12,772.30 | 0.00 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| 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 | 27,500,240.25 | 7.30 |
| 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 | 14,394.48 | 0.00 |
| 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 | 111,446,041.20 | 29.57 |

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 | 600872 | 中炬高新 | 538,900 | 19,826,131.00 | 5.26 |
| 2 | 300174 | 元力股份 | 850,700 | 13,415,539.00 | 3.56 |
| 3 | 600600 | 青岛啤酒 | 105,300 | 10,912,239.00 | 2.90 |
| 4 | 600132 | 重庆啤酒 | 114,100 | 10,515,456.00 | 2.79 |
| 5 | 601689 | 拓普集团 | 104,400 | 8,425,080.00 | 2.24 |
| 6 | 002126 | 银轮股份 | 473,200 | 8,375,640.00 | 2.22 |
| 7 | 002555 | 三七互娱 | 228,100 | 7,956,128.00 | 2.11 |
| 8 | 603444 | 吉比特 | 15,400 | 7,563,094.00 | 2.01 |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 157,500 | 7,544,250.00 | 2.00 |
| 10 | 002558 | 巨人网络 | 378,000 | 6,777,540.00 | 1.80 |
| 11 | 002517 | 恺英网络 | 327,300 | 5,151,702.00 | 1.37 |
| 12 | 688506 | 百利天恒 | 55,616 | 4,024,373.76 | 1.07 |
| 13 | 688361 | 中科飞测 | 4,816 | 390,936.28 | 0.10 |
| 14 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.02 |
| 15 | 688249 | 晶合集成 | 3,048 | 55,046.88 | 0.01 |
| 16 | 688472 | 阿特斯 | 1,941 | 33,074.64 | 0.01 |
| 17 | 688469 | 中芯集成 | 5,637 | 30,496.17 | 0.01 |
| 18 | 688531 | 日联科技 | 179 | 24,338.63 | 0.01 |
| 19 | 688582 | 芯动联科 | 532 | 21,641.76 | 0.01 |
| 20 | 688484 | 南芯科技 | 541 | 19,860.11 | 0.01 |
| 21 | 688458 | 美芯晟 | 211 | 19,150.36 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 22 | 688146 | 中船特气 | 502 | 19,141.26 | 0.01 |
| 23 | 688543 | 国科军工 | 352 | 18,673.60 | 0.00 |
| 24 | 688352 | 颀中科技 | 1,445 | 17,441.15 | 0.00 |
| 25 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 26 | 688507 | 索辰科技 | 129 | 15,752.19 | 0.00 |
| 27 | 688581 | 安杰思 | 128 | 15,107.84 | 0.00 |
| 28 | 688334 | 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 29 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 30 | 688570 | 天玛智控 | 546 | 13,830.18 | 0.00 |
| 31 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 32 | 688629 | 华丰科技 | 708 | 13,161.72 | 0.00 |
| 33 | 601061 | 中信金属 | 1,685 | 12,772.30 | 0.00 |
| 34 | 688620 | 安凯微 | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 35 | 688623 | 二元科技 | 139 | 12,063.81 | 0.00 |
| 36 | 688523 | 航天环宇 | 472 | 11,257.20 | 0.00 |
| 37 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 38 | 688479 | 友车科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 39 | 603135 | 中重科技 | 521 | 9,320.69 | 0.00 |
| 40 | 688429 | 时创能源 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 41 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 42 | 601065 | 江盐集团 | 635 | 7,518.40 | 0.00 |
| 43 | 601133 | 柏诚股份 | 515 | 6,313.90 | 0.00 |
| 44 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 45 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 46 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 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 | 600132 | 重庆啤酒 | 13,977,357.87 | 3.71 |
| 2 | 002517 | 恺英网络 | 13,277,833.00 | 3.52 |
| 3 | 600600 | 青岛啤酒 | 11,603,979.24 | 3.08 |
| 4 | 300138 | 晨光生物 | 11,259,835.00 | 2.99 |
| 5 | 301239 | 普瑞眼科 | 11,174,974.50 | 2.97 |
| 6 | 002555 | 三七互娱 | 10,982,103.00 | 2.91 |
| 7 | 300015 | 爱尔眼科 | 9,540,136.74 | 2.53 |
| 8 | 688506 | 百利天恒 | 8,682,499.43 | 2.30 |
| 9 | 300122 | 智飞生物 | 7,688,017.00 | 2.04 |
| 10 | 688008 | 澜起科技 | 7,625,813.85 | 2.02 |
| 11 | 002624 | 完美世界 | 7,557,599.00 | 2.01 |
| 12 | 600276 | 恒瑞医药 | 7,538,144.00 | 2.00 |
| 13 | 300938 | 信测标准 | 7,536,546.62 | 2.00 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 002126 | 银轮股份 | 7,524,245.59 | 2.00 |
| 15 | 601689 | 拓普集团 | 7,521,793.00 | 2.00 |
| 16 | 688111 | 金山办公 | 7,518,607.48 | 2.00 |
| 17 | 002558 | 巨人网络 | 7,493,019.00 | 1.99 |
| 18 | 600487 | 亨通光电 | 7,461,962.00 | 1.98 |
| 19 | 600129 | 太极集团 | 7,364,684.50 | 1.95 |
| 20 | 601222 | 林洋能源 | 5,710,267.00 | 1.52 |

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 | 601155 | 新城控股 | 14,724,130.00 | 3.91 |
| 2 | 301239 | 普瑞眼科 | 13,487,087.75 | 3.58 |
| 3 | 002555 | 三七互娱 | 13,368,549.00 | 3.55 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 11,714,841.00 | 3.11 |
| 5 | 600298 | 安琪酵母 | 11,379,772.00 | 3.02 |
| 6 | 300138 | 晨光生物 | 10,494,868.00 | 2.79 |
| 7 | 600129 | 太极集团 | 9,709,610.00 | 2.58 |
| 8 | 300015 | 爱尔眼科 | 9,126,136.48 | 2.42 |
| 9 | 603606 | 东方电缆 | 8,649,176.15 | 2.30 |
| 10 | 688111 | 金山办公 | 8,186,171.05 | 2.17 |
| 11 | 002517 | 恺英网络 | 7,736,276.00 | 2.05 |
| 12 | 300938 | 信测标准 | 7,387,363.00 | 1.96 |
| 13 | 688008 | 澜起科技 | 7,259,005.36 | 1.93 |
| 14 | 600487 | 亨通光电 | 7,199,180.00 | 1.91 |
| 15 | 002624 | 完美世界 | 6,864,114.00 | 1.82 |
| 16 | 688050 | 爱博医疗 | 6,860,657.60 | 1.82 |
| 17 | 601888 | 中国中免 | 6,850,850.00 | 1.82 |
| 18 | 600763 | 通策医疗 | 6,846,774.00 | 1.82 |
| 19 | 300122 | 智飞生物 | 6,174,994.00 | 1.64 |
| 20 | 603444 | 吉比特 | 5,655,502.00 | 1.50 |

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 | 209,535,899.18 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 220,628,421.26 |

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，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。

7.5 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 164,998,300.30 | 43.78 |
| | 其中: 政策性金融债 | 509,993.31 | 0.14 |
| 4 | 企业债券 | 75,407,246.14 | 20.01 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,423,536.98 | 5.42 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 260,829,083.42 | 69.21 |

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 | 188701 | 国电投 11 | 200,000 | 20,527,065.21 | 5.45 |
| 2 | 188736 | 21 国君 12 | 200,000 | 20,520,165.48 | 5.45 |
| 3 | 149640 | 21 申证 15 | 200,000 | 20,511,210.96 | 5.44 |
| 4 | 127175 | 15 武铁 01 | 200,000 | 20,411,380.82 | 5.42 |
| 5 | 185285 | 22 海通 01 | 200,000 | 20,259,678.90 | 5.38 |

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没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除 14 建行二级 01 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2022 年 9 月 9 日，据银保监罚决字（2022）44 号的行政处罚决定书，中国建设银行股份有限公司涉及三项违法违规行为。一是个人经营贷款“三查”不到位，二是个人经营贷款制度不审慎，三是总行对分支机构管控不力承担管理责任，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，对中国建设银行股份有限公司罚款 260 万元。

2022 年 9 月 30 日，据银保监罚决字（2022）51 号的行政处罚决定书，中国建设银行股份有限公司理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹的违法违规行为，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，对中国建设银行股份有限公司罚款 200 万元。

我们认为相关处罚措施对中国建设银行股份有限公司的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对中国建设银行股份有限公司的债券偿还影响很小。本基金投资 14 建行二级 01 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 | 41,361.27 |
| 2 | 应收清算款 | 1,391,145.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,432,506.49 |

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

| 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 (%) |
| 宝盈祥颐定期开放混合 A | 2,358 | 135,594.54 | - | - | 319,731,923.22 | 100.00 |
| 宝盈祥颐定期开放混合 C | 356 | 72,275.32 | - | - | 25,730,014.02 | 100.00 |
| 合计 | 2,714 | 127,288.85 | - | - | 345,461,937.24 | 100.00 |

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 | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 209.45 | 0.0001 |
| | 宝盈祥颐定期开放混合 C | 8.76 | 0.0000 |
| | 合计 | 218.21 | 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 0 |
| | 宝盈祥颐定期开放混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 0 |
| | 宝盈祥颐定期开放混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 宝盈祥颐定期开放混合 A | 宝盈祥颐定期开放混合 C |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2019年3月20日) 基金份额总额 | 374,346,500.23 | 101,210,989.37 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 319,731,923.22 | 25,730,014.02 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 319,731,923.22 | 25,730,014.02 |

§ 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，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

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 (%) | |
| 华创证券 | 2 | 189,500,718.12 | 44.67 | 174,589.24 | 44.67 | - |
| 中信证券 | 2 | 109,634,597.85 | 25.84 | 101,005.28 | 25.84 | - |
| 中泰证券 | 1 | 84,690,535.98 | 19.96 | 78,026.47 | 19.96 | - |
| 平安证券 | 2 | 24,745,117.59 | 5.83 | 22,797.86 | 5.83 | - |
| 天风证券 | 2 | 15,646,642.21 | 3.69 | 14,415.27 | 3.69 | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、本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：

(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、本基金本报告期交易单元变更情况：

本基金本报告期无新增租用和退租交易单元。

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(%) |
| 华创证 券 | - | - | 267,697,000. 00 | 11.73 | - | - |
| 中信证 券 | 49,920,641. 44 | 36.94 | 1,180,986,00 0.00 | 51.74 | - | - |
| 中泰证 券 | - | - | 833,912,000. 00 | 36.53 | - | - |
| 平安证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证 | 85,204,786. | 63.06 | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|----|---|---|---|---|---|
| 券 | 85 | | | | | |
| 长江证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君 安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏 源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证 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 | 宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金第八个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告 | 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 | 2023-06-29 |
| 2 | 宝盈祥颐定期开放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 |
| 3 | 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 |
| 4 | 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 |
| 5 | 宝盈祥颐定期开放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 |
| 6 | 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 |
| 7 | 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 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, | 2023-03-03 |

| | | | |
|---|---|--------------------------|------------|
| | 费率优惠活动的公告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | |
| 8 | 宝盈祥颐定期开放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 |
| 9 | 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

中国证监会准予宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金注册的文件。

《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上述备查文件文本分别存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日