

# 宝盈祥乐一年持有期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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	8
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 其他指标 .....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	16
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 .....	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	22
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
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 .....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈祥乐一年持有期混合	
基金主代码	010857	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 21 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,388,787.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈祥乐一年持有期混合 A	宝盈祥乐一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010857	010858
报告期末下属分级基金的份额总额	47,350,521.52 份	5,038,265.90 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过把握债券、股票市场的投资机会，在严格控制组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、债券投资策略</p> <p>本基金以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点，结合估值研究、投资者行为研究，自上而下确定组合整体杠杆率以及货币类、利率类、信用类的债券配置比例。同时，本基金注重微观层面的投资研究及策略，尤其是在信用债券领域，具体投资标的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。</p> <p>本基金采用的投资策略主要包括债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略、流动性管理策略。</p> <p>（1）债券资产配置策略。组合杠杆率及货币类、利率类、信用类债券的配置比例决策主要参考以下几个方面的研究：</p> <p>1）宏观经济变量（包括但不限于宏观经济增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业周期等）、流动性条件、行业基本面等研究；</p> <p>2）利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究；</p> <p>3）宏观流动性环境及货币市场流动性研究；</p> <p>4）大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。</p> <p>（2）行业配置策略。基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法，并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究，本基金以分散化配置模式为基础，实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异，在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上，合理地决定不同行业的配置比</p>

例。

(3) 公司配置策略。基于公司价值研究的重要性, 本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况, 在充分考虑组合流动性特征的前提下, 结合行业周期研究, 甄别具有估值优势、基本面改善的公司, 以分散化配置模式为基础策略。

(4) 流动性管理策略。本策略侧重对组合可质押券的管理。信用债的质押率水平与其基本面存在一定的相关关系。本基金将在基金合同约定的组合杠杆率以及既定债券资产配置策略下的杠杆率范围内, 充分考虑发行人基本面的当前和未来变化的可能性及趋势, 合理配置于不同发行主体所发行的债券。

## 2、信用债投资策略

本基金主要采用外部信用评级和内部信用评级相结合的信用研究体系, 研究债券发行主体企业的基本面, 以确定债券的实际信用状况。基金管理人内部信用评级体系主要分为定量分析和定性分析, 定量分析是根据行业公司财务特征设定阈值, 进行财务打分。定性分析包括主体股权结构分析、公司历史分析、行业分析、公司经营分析、公司管理层分析、公司融资及外部支持分析、公司偿债分析等几个部分。其中, 经营分析注重公司的获现能力、经营稳定性等, 财务分析关注公司的资产质量、隐性债务、财务真实性等方面。

本基金参与信用类债券投资的, 其信用评级需在 AA (含) 及以上, 其中, 信用评级为 AAA 的信用类债券投资不低于基金资产净值的 30%, 投资于信用评级为 AA+ 的信用类债券占基金资产净值的比例为 0-70%, 投资于信用评级为 AA 的信用类债券占基金资产净值的比例为 0-20%。本基金投资的金融债 (不含政策性金融债)、次级债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券 (含分离交易可转债)、可交换债券等信用类债券的信用评级参照评级机构出具的债项信用评级; 本基金投资的短期融资券、超短期融资券等短期信用类债券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级 (不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构), 如出现多家评级机构所出具信用评级不同的情况, 基金管理人还需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定。

## 3、可转换债券 (含可交换债券) 投资策略

基于行业研究、公司研究可转债估值模型分析, 本基金在一、二级市场投资可转换债券 (含可交换债券), 主要的投资策略包括行业配置策略、个券精选策略、转股策略、条款博弈策略等。

本基金主动投资于可转换债券 (含分离交易可转债)、可交换债券的市值合计不超过基金资产净值的 20%。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析、公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略, 在严格控制风险的情况下, 通过信用研究和流动性管理, 选择风险调整后收益高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。

## 5、股票投资策略

本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨

	<p>潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。</p> <p>(1)使用定量分析的方法,通过财务和运营数据进行企业价值评估,初步筛选出具备优势的股票作为备选投资标的。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面对股票进行考量。</p> <p>(2)在定量分析的基础上,基金管理人将深入调研上市公司,并基于公司治理、公司发展战略、基本面变化、竞争优势、管理水平、估值比较和行业景气度趋势等关键因素,评估上市公司的中长期发展前景、成长性和核心竞争力,进一步优化备选投资标的。</p> <p>(3)参与定向增发投资策略</p> <p>基金管理人将通过实地调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息;对定向增发价格的合理性做出判断,并结合上市公司大股东参与定向增发的情况,在进行全面和深入研究的基础上做出投资决定,在控制风险的基础上力求获取较高的收益。</p> <p>6、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> <p>7、港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将对港股通标的股票进行系统性分析,在采用上述个股精选策略的基础上,结合香港股票市场情况,重点投资于港股通标的股票范围内具备长期成长潜力且估值合理的优质上市公司股票。</p> <p>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险;利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>9、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。</p> <p>若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金可相应调整和更新相关投资策略。</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×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。

	本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

## 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊	韩笑微
	联系电话	0755-83276688	010-68858113
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	95580
传真		0755-83515599	010-68858120
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 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		518034	100808
法定代表人		严震	刘建军

## 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)	
	宝盈祥乐一年持有期混合 A	宝盈祥乐一年持有期混合 C
本期已实现收益	1,115,130.48	67,446.25
本期利润	2,941,955.17	132,042.53
加权平均基金份额本期利润	0.0420	0.0233
本期加权平均净值利润率	4.32%	2.42%



本期基金份额净值增长率	2.53%	2.28%
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	-1,250,343.09	-180,609.04
期末可供分配基金份额利润	-0.0264	-0.0358
期末基金资产净值	46,100,178.43	4,857,656.86
期末基金份额净值	0.9736	0.9642
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	-2.64%	-3.58%

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

宝盈祥乐一年持有期混合 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	-0.52%	0.31%	1.15%	0.26%	-1.67%	0.05%
过去三个月	0.37%	0.29%	0.24%	0.25%	0.13%	0.04%
过去六个月	2.53%	0.33%	1.90%	0.25%	0.63%	0.08%
过去一年	-0.08%	0.40%	-0.27%	0.31%	0.19%	0.09%
自基金合同生效起	-2.64%	0.46%	-1.60%	0.35%	-1.04%	0.11%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

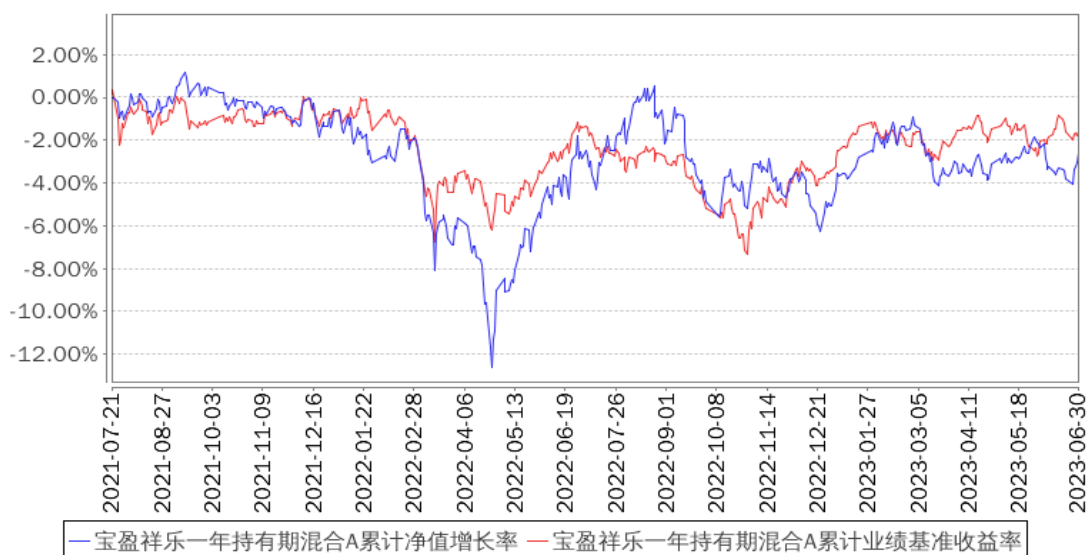
## 宝盈祥乐一年持有期混合 C

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	-0.56%	0.31%	1.15%	0.26%	-1.71%	0.05%
过去三个月	0.25%	0.29%	0.24%	0.25%	0.01%	0.04%
过去六个月	2.28%	0.33%	1.90%	0.25%	0.38%	0.08%
过去一年	-0.58%	0.40%	-0.27%	0.31%	-0.31%	0.09%
自基金合同生效起至今	-3.58%	0.46%	-1.60%	0.35%	-1.98%	0.11%

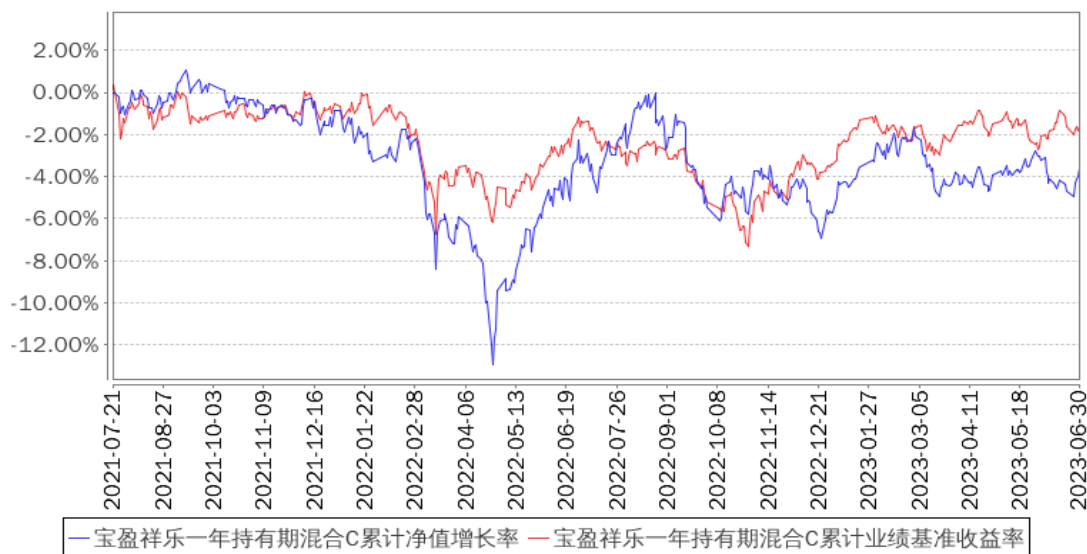
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

### 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

宝盈祥乐一年持有期混合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



宝盈祥乐一年持有期混合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



### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈优质成长混合、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、宝盈祥颐定期开放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	2021 年 8 月 20 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。

	金经理				
王灏	本基金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈发展新动能股票型证券投资基金基金经理	2022 年 3 月 15 日	-	5 年	王灏先生，西南财经大学金融硕士。曾任特变电工衡阳变压器有限公司投标项目经理；2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格

注：1、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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害

基金持有人利益的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，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。报告期内，国内经济复苏大幅低于预期，地产、消费持续低位、出口从高位大幅回落，经济仍然承受很大的压力。据国家统计局数据，1-5 月份全国规模以上工业企业利润总额同比下降 22.9%，同时人工智能、信创、数字经济等主题性行情贯穿整个报告期，对其他板块挤压效应明显，本基金持仓以中下游制造业为主，业绩受到影响。

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%。本产品债券部分杠杆和久期不高，获取了稳健的收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥乐一年持有期混合 A 的基金份额净值为 0.9736 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.53%；截至本报告期末宝盈祥乐一年持有期混合 C 的基金份额净值为 0.9642 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.28%。同期业绩比较基准收益率为 1.90%。

#### 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。

未来宏观经济将持续弱复苏走势，证券市场将出现底部弱改善。管理人员在股票运作上坚持优质个股挖掘，看好 5 个比较大的方向：

1、农药等需求受宏观经济影响较小，会是工业品中率先完成去库存的品种，属于底部反转中较好的选择。

2、由于国内地产等需求端难有明显好转，大宗商品将持续弱势，火电板块将是受益方向，有望同时受益于煤价下跌和高电价。

3、在经济增速下台阶的过程中，传统成长板块压力很大，短期来看高确定性的高股息板块仍有配置价值。

4、电池材料领域虽然长期来看盈利能力仍将下降，但中期来看，部分环节价格已经降到高成本产能成本线，存在较强支撑，在需求端仍保持较高增速的背景下存在投资机会。

5、虽然出口处于下行过程中，但大部分企业的出口利润率高于国内，制造业企业如果想取得较好发展，摆脱内卷走向海外仍是最好选择，长线看好重视海外扩张的企业。

#### 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈祥乐一年持有期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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

## 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、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：宝盈祥乐一年持有期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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,708,645.75	8,073,110.13
结算备付金		54,387.06	251,234.73
存出保证金		57,633.50	110,865.45
交易性金融资产	6.4.7.2	40,148,849.65	97,311,054.40
其中：股票投资		18,766,420.15	35,025,420.01
基金投资		-	-
债券投资		21,382,429.50	62,285,634.39
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		1,484,069.68	1,053,121.82
应收股利		127,359.32	-
应收申购款		-	20.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		51,580,944.96	106,799,406.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	368,817.09
应付赎回款		426,175.52	257,712.52
应付管理人报酬		34,247.63	72,888.47
应付托管费		8,561.92	18,222.13
应付销售服务费		2,025.01	2,514.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		320.19	1,749.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	151,779.40	288,558.55
负债合计		623,109.67	1,010,462.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	52,388,787.42	111,450,233.99
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,430,952.13	-5,661,290.00
净资产合计		50,957,835.29	105,788,943.99
负债和净资产总计		51,580,944.96	106,799,406.53

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 0.9736 元，A 类基金份额 47,350,521.52 份；C 类基金份额净值人民币 0.9642 元，C 类基金份额 5,038,265.90 份；宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金份额总额合计为 52,388,787.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈祥乐一年持有期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	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,564,012.70	-2,354,181.22
1. 利息收入		28,167.07	33,952.84
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,167.07	33,952.84
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,644,424.66	-5,578,322.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	875,078.49	-9,106,229.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	292,146.27	2,764,178.53
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	477,199.90	763,727.67
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,891,420.97	3,190,188.83
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		490,015.00	1,781,138.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	294,358.32	804,309.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,589.53	201,077.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,581.01	34,589.73
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	629,721.33
其中：卖出回购金融资产支出		-	629,721.33
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		496.25	3,580.01
8. 其他费用	6.4.7.23	107,989.89	107,860.15
<b>三、利润总额（亏损总额</b>		3,073,997.70	-4,135,319.58

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,073,997.70	-4,135,319.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,073,997.70	-4,135,319.58

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宝盈祥乐一年持有期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）	111,450,233.99	-	-5,661,290.00	105,788,943.99
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）	111,450,233.99	-	-5,661,290.00	105,788,943.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-59,061,446.57	-	4,230,337.87	-54,831,108.70
（一）、综合收益总额	-	-	3,073,997.70	3,073,997.70
（二）、本期基金份额交易产生的基	-59,061,446.57	-	1,156,340.17	-57,905,106.40

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	78,505.58	-	-2,920.33	75,585.25
2. 基金赎回款	-59,139,952.15	-	1,159,260.50	-57,980,691.65
(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、本期末净资产(基金净值)	52,388,787.42	-	-1,430,952.13	50,957,835.29
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)	213,060,998.57	-	-1,383,467.05	211,677,531.52
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-

更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	213,060,998.57	-	-1,383,467.05	211,677,531.52
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	-	-	-4,135,319.58	-4,135,319.58
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-4,135,319.58	-4,135,319.58
(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)	213,060,998.57	-	-5,518,786.63	207,542,211.94

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：

<u>杨凯</u>	<u>张献锦</u>	<u>何瑜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宝盈祥乐一年持有期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[2020]3098号《关于准予宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币212,899,804.42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(2021)第0724号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年7月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,060,998.57份基金份额,其中认购资金利息折合161,194.15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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期。对于每份基金份额,最短持有期起始日指基金合同生效日日(对认购份额而言)、该基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)或该基金份额转换入确认日(对转换转入份额而言);最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起一年后的年度对日。如无此年度对日或该对日为非工作日,则顺延至下一工作日。

根据《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈祥乐一年持有期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，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥乐一年持有期混合 A；投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥乐一年持有期混合 C。宝盈祥乐一年持有期混合 A 和宝盈祥乐一年持有期混合 C 分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、次级债、央行票据、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、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、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金股票(包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票和存托凭证)投资占基金资产的比例为 0% - 40%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%。

#### 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》、《宝盈祥乐一年持有期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 日的财务状况以及自 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	9,708,645.75
等于：本金	9,707,168.11
加：应计利息	1,477.64
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	9,708,645.75

#### 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	17,776,276.17	-	18,766,420.15	990,143.98	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,077,628.53	186,050.38	13,239,950.38	-23,728.53
	银行间市场	8,084,977.80	51,679.12	8,142,479.12	5,822.20
	合计	21,162,606.33	237,729.50	21,382,429.50	-17,906.33
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	38,938,882.50	237,729.50	40,148,849.65	972,237.65	

#### 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	53,519.25
其中：交易所市场	52,874.25
银行间市场	645.00
应付利息	-
预提费用	98,260.15
合计	151,779.40

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 宝盈祥乐一年持有期混合 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	105,327,335.52	105,327,335.52
本期申购	24,321.72	24,321.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-58,001,135.72	-58,001,135.72
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	47,350,521.52	47,350,521.52

## 宝盈祥乐一年持有期混合 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	6,122,898.47	6,122,898.47
本期申购	54,183.86	54,183.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,138,816.43	-1,138,816.43
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	5,038,265.90	5,038,265.90

## 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

## 宝盈祥乐一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,805,400.78	-2,505,239.89	-5,310,640.67
本期利润	1,115,130.48	1,826,824.69	2,941,955.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,086,680.22	31,662.19	1,118,342.41
其中：基金申购款	-601.23	-249.88	-851.11
基金赎回款	1,087,281.45	31,912.07	1,119,193.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-603,590.08	-646,753.01	-1,250,343.09

## 宝盈祥乐一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-206,150.17	-144,499.16	-350,649.33

本期利润	67,446.25	64,596.28	132,042.53
本期基金份额交易产生的变动数	26,348.72	11,649.04	37,997.76
其中：基金申购款	-1,671.06	-398.16	-2,069.22
基金赎回款	28,019.78	12,047.20	40,066.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-112,355.20	-68,253.84	-180,609.04

#### 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		24,913.97
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		2,511.04
其他		742.06
合计		28,167.07

#### 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		875,078.49
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		875,078.49

##### 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		122,239,324.57
减：卖出股票成本总额		121,029,818.58
减：交易费用		334,427.50
买卖股票差价收入		875,078.49

##### 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	512,809.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-220,663.24
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	292,146.27

## 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	86,345,542.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	84,984,572.40
减：应计利息总额	1,579,987.96
减：交易费用	1,645.00
买卖债券差价收入	-220,663.24

## 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	477,199.90
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	477,199.90

## 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	1,891,420.97
股票投资	1,447,044.90
债券投资	444,376.07
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,891,420.97

#### 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	-
证券组合费	129.74
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	107,989.89

#### 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	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	294,358.32	804,309.71
其中：支付销售机构的客户维护费	109,103.14	219,472.66

注：支付基金管理人宝盈基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

###### 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
当期发生的基金应支付的托管费	73,589.53	201,077.43

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

###### 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		
	宝盈祥乐一年持有期混 合 A	宝盈祥乐一年持有期混 合 C	合计
宝盈基金	-	0.94	0.94
中国邮政储蓄银行	-	9,973.23	9,973.23
合计	-	9,974.17	9,974.17
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		
	宝盈祥乐一年持有期混 合 A	宝盈祥乐一年持有期混 合 C	合计
宝盈基金	-	17.08	17.08
中国邮政储蓄银行	-	16,097.24	16,097.24
合计	-	16,114.32	16,114.32

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 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金，再由宝盈基金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×0.5%/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

本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6

	日	月 30 日
	宝盈祥乐一年持有期混合 A	宝盈祥乐一年持有期混合 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 21 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	20,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	20,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
	宝盈祥乐一年持有期混合 A	宝盈祥乐一年持有期混合 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 21 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	20,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	20,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.0800%	-

#### 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
中国邮政储蓄银行	9,708,645.75	24,913.97	7,927,662.90	20,050.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金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邮储银行，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	3,047,578.77	6,544,565.07
合计	3,047,578.77	6,544,565.07

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	18,334,850.73	55,741,069.32
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	18,334,850.73	55,741,069.32

**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上市公司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	9,708,645.75	-	-	-	9,708,645.75
结算备付金	54,387.06	-	-	-	54,387.06

存出保证金	57,633.50	-	-	-	57,633.50
交易性金融资产	7,143,279.75	14,239,149.75	-	18,766,420.15	40,148,849.65
应收股利	-	-	-	127,359.32	127,359.32
应收清算款	-	-	-	1,484,069.68	1,484,069.68
资产总计	16,963,946.06	14,239,149.75	-	20,377,849.15	51,580,944.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	426,175.52	426,175.52
应付管理人报酬	-	-	-	34,247.63	34,247.63
应付托管费	-	-	-	8,561.92	8,561.92
应付销售服务费	-	-	-	2,025.01	2,025.01
应交税费	-	-	-	320.19	320.19
其他负债	-	-	-	151,779.40	151,779.40
负债总计	-	-	-	623,109.67	623,109.67
利率敏感度缺口	16,963,946.06	14,239,149.75	-	19,754,739.48	50,957,835.29
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	8,073,110.13	-	-	-	8,073,110.13
结算备付金	251,234.73	-	-	-	251,234.73
存出保证金	110,865.45	-	-	-	110,865.45
交易性金融资产	6,544,565.07	45,519,658.36	10,221,410.96	35,025,420.01	97,311,054.40
应收申购款	-	-	-	20.00	20.00
应收清算款	-	-	-	1,053,121.82	1,053,121.82
资产总计	14,979,775.38	45,519,658.36	10,221,410.96	36,078,561.83	106,799,406.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	257,712.52	257,712.52
应付管理人报酬	-	-	-	72,888.47	72,888.47
应付托管费	-	-	-	18,222.13	18,222.13
应付清算款	-	-	-	368,817.09	368,817.09
应付销售服务费	-	-	-	2,514.31	2,514.31
应交税费	-	-	-	1,749.47	1,749.47
其他负债	-	-	-	288,558.55	288,558.55
负债总计	-	-	-	1,010,462.54	1,010,462.54
利率敏感度缺口	14,979,775.38	45,519,658.36	10,221,410.96	35,068,099.29	105,788,943.99

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 )
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	62, 552. 29	454, 893. 05
	2. 市场利率上升 25 个基点	-60, 396. 68	-448, 217. 04

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	2, 289, 539. 70	-	2, 289, 539. 70
资产合计	-	2, 289, 539. 70	-	2, 289, 539. 70
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	2, 289, 539. 70	-	2, 289, 539. 70
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	4, 831, 366. 92	-	4, 831, 366. 92
资产合计	-	4, 831, 366. 92	-	4, 831, 366. 92

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,831,366.92	-	4,831,366.92

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	114,476.99	241,568.35
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-114,476.99	-241,568.35

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中股票资产（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票和存托凭证）占基金资产的比例为 0% - 40%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	18,766,420.15	36.83	35,025,420.01	33.11
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	18,766,420.15	36.83	35,025,420.01	33.11

## 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）
分析	1. 中证全债指数收益率上升 5%	416,658.40	1,869,221.84
	2. 中证全债指数收益率下降 5%	-416,658.40	-1,869,221.84

## 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	18,766,420.15	35,025,420.01
第二层次	21,382,429.50	62,285,634.39
第三层次	-	-
合计	40,148,849.65	97,311,054.40

##### 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	18,766,420.15	36.38
	其中：股票	18,766,420.15	36.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,382,429.50	41.45

	其中：债券	21,382,429.50	41.45
	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	9,763,032.81	18.93
8	其他各项资产	1,669,062.50	3.24
9	合计	51,580,944.96	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,289,539.70 元，占净值比为 4.49%。

## 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	11,572,432.45	22.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	808,002.00	1.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,462,706.00	4.83
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,633,740.00	3.21
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	16,476,880.45	32.33

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-

非周期性消费品	473,584.25	0.93
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	1,417,743.08	2.78
医疗	-	-
工业	571.63	0.00
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	397,640.74	0.78
房地产	-	-
合计	2,289,539.70	4.49

注：以上分类采用全球行业分类标准 GICS。

### 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	300938	信测标准	37,300	1,633,740.00	3.21
2	301035	润丰股份	20,000	1,571,400.00	3.08
3	603173	福斯达	52,125	1,535,081.25	3.01
4	600755	厦门国贸	189,500	1,466,730.00	2.88
5	02328	中国财险	176,546	1,417,743.08	2.78
6	688398	赛特新材	38,308	1,308,218.20	2.57
7	603878	武进不锈	133,280	1,126,216.00	2.21
8	301263	泰恩康	47,700	995,976.00	1.95
9	601677	明泰铝业	64,500	895,260.00	1.76
10	000690	宝新能源	115,100	808,002.00	1.59
11	002334	英威腾	62,300	793,702.00	1.56
12	002327	富安娜	89,100	750,222.00	1.47
13	300138	晨光生物	31,000	554,900.00	1.09
14	300037	新宙邦	10,500	544,845.00	1.07
15	002850	科达利	4,100	542,225.00	1.06
16	002709	天赐材料	13,100	539,589.00	1.06
17	603876	鼎胜新材	26,800	514,292.00	1.01
18	03690	美团-W	4,200	473,584.25	0.93
19	301004	嘉益股份	10,600	411,280.00	0.81
20	00902	华能国际电力股份	88,000	397,557.78	0.78
21	603279	景津装备	10,500	329,280.00	0.65
22	603187	海容冷链	7,800	155,922.00	0.31
23	02285	泉峰控股	20	571.63	0.00
24	01071	华电国际电力股份	22	82.96	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	00902	华能国际电力股份	1,906,067.06	1.80
1	600011	华能国际	841,621.00	0.80
2	688357	建龙微纳	2,641,256.19	2.50
3	00839	中教控股	2,624,529.86	2.48
4	300938	信测标准	2,476,443.00	2.34
5	600755	厦门国贸	2,449,342.00	2.32
6	03690	美团-W	2,271,525.23	2.15
7	603283	赛腾股份	2,242,674.00	2.12
8	601339	百隆东方	2,191,957.00	2.07
9	301283	聚胶股份	2,160,685.32	2.04
10	603867	新化股份	2,160,561.53	2.04
11	002979	雷赛智能	2,110,105.00	1.99
12	01024	快手-W	2,042,868.46	1.93
13	000690	宝新能源	2,022,601.00	1.91
14	301129	瑞纳智能	2,018,094.00	1.91
15	02285	泉峰控股	1,996,898.09	1.89
16	01071	华电国际电力股份	1,624,694.32	1.54
16	600027	华电国际	364,626.00	0.34
17	300138	晨光生物	1,924,362.00	1.82
18	301263	泰恩康	1,922,588.00	1.82
19	301035	润丰股份	1,878,458.00	1.78
20	02328	中国财险	1,843,047.92	1.74

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。

3、对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算本期累计买入金额参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 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	601058	赛轮轮胎	3,770,954.00	3.56
2	03690	美团-W	3,719,873.15	3.52
3	605098	行动教育	2,842,867.00	2.69
4	00700	腾讯控股	2,772,498.74	2.62

5	603878	武进不锈	2,485,202.00	2.35
6	301263	泰恩康	2,449,392.64	2.32
7	002254	泰和新材	2,436,101.00	2.30
8	688357	建龙微纳	2,419,349.78	2.29
9	603867	新化股份	2,384,305.00	2.25
10	00839	中教控股	2,294,906.08	2.17
11	603283	赛腾股份	2,237,037.00	2.11
12	00902	华能国际电力股份	1,439,997.78	1.36
12	600011	华能国际	787,973.00	0.74
13	601339	百隆东方	2,155,507.00	2.04
14	02285	泉峰控股	2,146,447.06	2.03
15	002979	雷赛智能	2,057,314.00	1.94
16	01071	华电国际电力股份	1,580,953.30	1.49
16	600027	华电国际	375,354.00	0.35
17	01024	快手-W	1,942,475.30	1.84
18	301283	聚胶股份	1,931,368.00	1.83
19	301129	瑞纳智能	1,906,624.00	1.80
20	600989	宝丰能源	1,749,002.00	1.65

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。

3、对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算本期累计卖出金额参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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	103,323,773.82
卖出股票收入（成交）总额	122,239,324.57

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,047,578.77	5.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,192,371.61	20.00
5	企业短期融资券	-	-



6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	8,142,479.12	15.98
10	合计	21,382,429.50	41.96

## 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	188804	21 中银 01	40,000	4,100,498.63	8.05
2	1928006	19 工商银行二级 01	40,000	4,095,700.98	8.04
3	138910	23 中证 G2	40,000	4,049,338.08	7.95
4	2028013	20 农业银行二级 01	40,000	4,046,778.14	7.94
5	019679	22 国债 14	25,000	2,544,947.26	4.99

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 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	57,633.50
2	应收清算款	1,484,069.68
3	应收股利	127,359.32
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	1,669,062.50

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
宝盈祥乐一年持有	1,504	31,483.06	-	-	47,350,521.52	100.00

期混合 A						
宝盈祥乐一年持有期混合 C	917	5,494.29	-	-	5,038,265.90	100.00
合计	2,421	21,639.32	-	-	52,388,787.42	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	宝盈祥乐一年持有期混合 A	9.95	0.0000
	宝盈祥乐一年持有期混合 C	40.11	0.0008
	合计	50.06	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	宝盈祥乐一年持有期混合 A	0
	宝盈祥乐一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈祥乐一年持有期混合 A	0
	宝盈祥乐一年持有期混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈祥乐一年持有期混合 A	宝盈祥乐一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 7 月 21 日) 基金份额总额	198,353,302.17	14,707,696.40
本报告期期初基金份额总额	105,327,335.52	6,122,898.47
本报告期基金总申购	24,321.72	54,183.86

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	58,001,135.72	1,138,816.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,350,521.52	5,038,265.90

## § 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

本报告期内，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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
海通证券	2	225,302,050.51	100.00	165,154.29	100.00	-

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
- (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
- (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：

- (1) 本报告期内未新租交易单元。
- (2) 本报告期内未退租交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	70,070,131.75	100.00	-	-	-	-

### 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	宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-06-07
2	宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金(宝盈祥乐一年持有期混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-06-07
3	宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金(宝盈祥乐一年持有期混合 C 份	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2023-06-07

	额) 基金产品资料概要 (更新)	网站	
4	宝盈祥乐一年持有期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
5	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
6	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
7	宝盈基金管理有限公司关于增加海通证券股份有限公司旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-04-13
8	宝盈祥乐一年持有期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
9	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
10	宝盈基金管理有限公司关于增加新华信通为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023-03-14
11	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
12	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司销售旗下部分基金的公告	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	2023-02-20
13	宝盈祥乐一年持有期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
14	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230302	25,010,250.00	-	25,010,250.00	-	-
	2	20230303-20230308	20,000,000.00	-	20,000,000.00	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，在极端情况下可能存在流动性等风险，敬请投资人留意。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

本基金备查文件包括：

- (一) 中国证监会准予宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 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：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

### 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