

# 宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	宝盈祥裕增强回报混合
基金主代码	008336
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 27 日
报告期末基金份额总额	69,020,397.56 份
投资目标	在控制组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金采取“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，动态调整各大类资产间的分配比例，精选各类资产投资标的，力图获得超越业绩比较基准的增强回报。</p> <p>本基金的投资策略由资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、衍生品投资策略四个部分组成。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取“自上而下”的资产配置策略，将在基金合同约定的投资范围内，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。主要考虑的因素包括：</p> <p>（1）宏观经济指标：年度/季度 GDP 增速、固定资产投资总量、消费价格指数、采购经理人指数、进出口数据、工业用电量、客运量及货运量等；</p> <p>（2）政策因素：税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策，利率水平、货币净投放等货币政策；</p> <p>（3）市场指标：市场整体估值水平、市场资金的供需以</p>

	<p>及市场的参与情绪等因素。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合，精选行业和个股的策略。</p> <p>以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种。</p> <p>(1) 行业投资策略：本基金将在考虑行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场行业轮动规律的基础上决定行业的配置，同时本基金将根据宏观经济和证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整；</p> <p>(2) 个股投资策略：本基金将采用“自下而上”的方式，结合定量、定性分析，考察和筛选具有综合比较优势的个股作为投资标的。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略：本基金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，在采用行业配置策略和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处于合理价位的具备核心竞争力的上市公司股票。</p> <p>(4) 存托凭证投资策略：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>3、固定收益类资产投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>本基金的债券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。</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</p>
--	--

	<p>行业周期预判的基础上，合理地决定不同行业的配置比例。</p> <p>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。</p> <p>(2) 资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(3) 可转换债券（含可交换债券）投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、衍生品投资策略</p> <p>(1) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值和流动性管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险和流动性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>(2) 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，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合的整体风险的目的。</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×25%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	宝盈祥裕增强回报混合 A	宝盈祥裕增强回报混合 C
下属分级基金的交易代码	008336	008337
报告期末下属分级基金的份额总额	62,375,276.44 份	6,645,121.12 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	宝盈祥裕增强回报混合 A	宝盈祥裕增强回报混合 C
1. 本期已实现收益	-973,480.70	-138,022.98
2. 本期利润	-5,428,767.56	-771,462.10
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0845	-0.0898
4. 期末基金资产净值	53,332,312.31	5,615,438.56
5. 期末基金份额净值	0.8550	0.8450

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈祥裕增强回报混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.88%	0.62%	-0.71%	0.26%	-8.17%	0.36%
过去六个月	-8.78%	0.71%	-0.67%	0.25%	-8.11%	0.46%
过去一年	-10.33%	0.60%	2.41%	0.29%	-12.74%	0.31%
自基金合同生效起至今	-14.50%	0.50%	3.48%	0.33%	-17.98%	0.17%

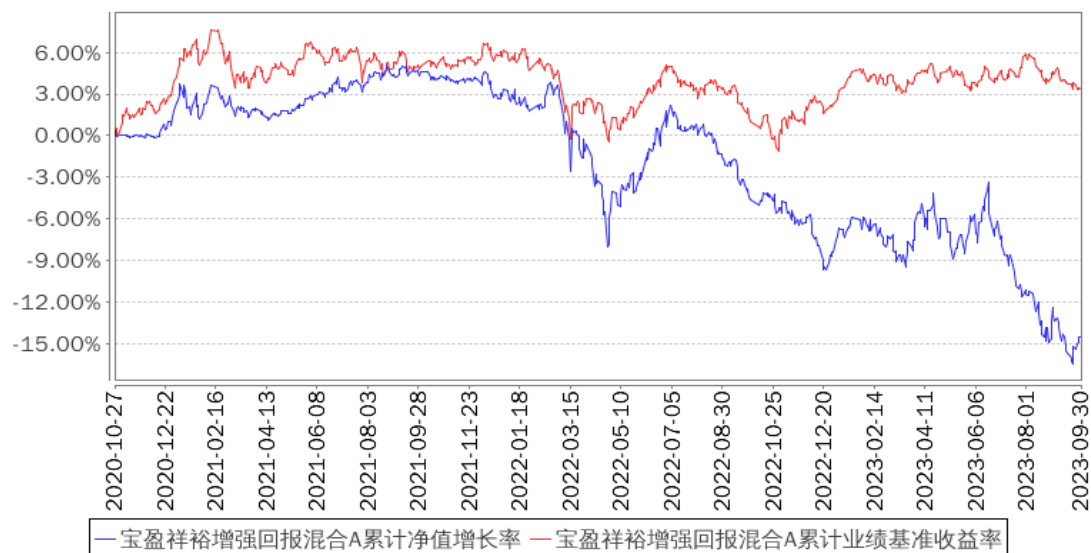
宝盈祥裕增强回报混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

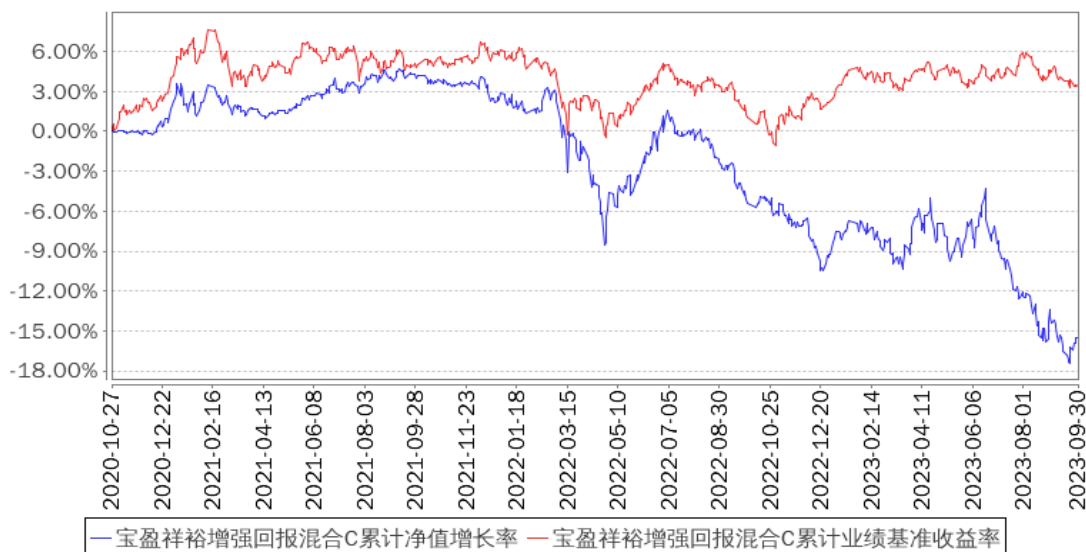
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-8.97%	0.62%	-0.71%	0.26%	-8.26%	0.36%
过去六个月	-8.96%	0.71%	-0.67%	0.25%	-8.29%	0.46%
过去一年	-10.69%	0.60%	2.41%	0.29%	-13.10%	0.31%
自基金合同 生效起至今	-15.50%	0.50%	3.48%	0.33%	-18.98%	0.17%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

宝盈祥裕增强回报混合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



宝盈祥裕增强回报混合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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、宝盈祥颐定期开放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	2020年10月27日	-	11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。
蔡丹	本基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金	2023年9月26日	-	13年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011年9

金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金基金经理	日		月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司,先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司,曾任宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
---	---	--	--

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度,海外俄乌冲突继续升级,通胀压力缓解但呈现粘性,海外央行货币政策延续收紧。国内主要指标边际改善,国民经济恢复向好。消费方面,1-8 月社会消费品零售总额累计同比增长 7.0%。投资方面,房地产投资仍面临下行压力,1-8 月房地产开发投资累计同比收缩 8.8%;基建投资增速略有下行但仍处于较高水平,1-8 月基建投资累计同比增长 8.96%;制造业投资增速



略有下滑，1-8 月制造业累计同比增长 5.9%。进出口方面，8 月出口金额同比增速-8.8%，进口金额同比增速-7.3%。通胀方面，主要工业品价格同比增速逐渐企稳、居民消费价格同比增速保持低位。金融市场整体稳定，上证指数第三季度下跌 2.86%，深圳成指下跌 8.32%；创业板指下跌 9.53%。长端美债收益率大幅上行，主因美联储加息预期；10 年期国债先下后上。

报告期内，本基金严格遵守基金合同约定，以信用债和利率债为底仓配置，保持中短久期，转债投资注重安全边际；灵活参与股票投资，注重增速和估值的匹配。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥裕增强回报混合 A 的基金份额净值为 0.8550 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.88%；截至本报告期末宝盈祥裕增强回报混合 C 的基金份额净值为 0.8450 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.97%。同期业绩比较基准收益率为-0.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,356,074.60	35.58
	其中：股票	23,356,074.60	35.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,696,809.71	61.99
	其中：债券	40,696,809.71	61.99
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,579,578.17	2.41
8	其他资产	16,026.68	0.02
9	合计	65,648,489.16	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 594,486.60 元，占净值比为 1.01%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,165,885.00	18.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	448,910.00	0.76
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	8,141,900.00	13.81
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	1,156,005.00	1.96
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	1,597,048.00	2.71
R	文化、体育和娱乐业	251,840.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	22,761,588.00	38.61

## 5.2.2 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	262,901.00	0.45
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
信息科技	-	-
电信服务	331,585.60	0.56
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	594,486.60	1.01

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002558	巨人网络	173,100	2,239,914.00	3.80
2	300002	神州泰岳	200,000	2,012,000.00	3.41
3	002555	三七互娱	91,000	1,974,700.00	3.35
4	600600	青岛啤酒	20,000	1,749,200.00	2.97
5	301239	普瑞眼科	13,600	1,597,048.00	2.71
6	688120	华海清科	7,340	1,405,610.00	2.38
7	002436	兴森科技	115,000	1,404,150.00	2.38
8	601728	中国电信	125,200	724,908.00	1.23
9	002230	科大讯飞	13,300	673,778.00	1.14
10	002422	科伦药业	22,500	655,875.00	1.11

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,528,105.48	5.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,804,295.08	35.29
	其中：政策性金融债	20,804,295.08	35.29
4	企业债券	10,116,553.70	17.16
5	企业短期融资券	1,005,342.62	1.71
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,148,273.71	3.64
8	同业存单	-	-
9	其他	3,094,239.12	5.25
10	合计	40,696,809.71	69.04

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210203	21 国开 03	200,000	20,804,295.08	35.29
2	188130	21 安信 G1	50,000	5,070,513.70	8.60
3	188399	21 银河 G5	50,000	5,046,040.00	8.56
4	019703	23 国债 10	35,000	3,528,105.48	5.99
5	1928002	19 民生银行二级 01	30,000	3,094,239.12	5.25

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内除三七互娱的发行主体外没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除 21 安信 G1 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2023 年 6 月 14 日，据中国证券监督管理委员会山东监管局行政监管措施决定书（2023）25 号，经查，安信证券股份有限公司淄博华光路证券营业部存在以下问题：一是 2018 年 6 月-2019 年 11 月，在开展安信综合金融服务推广活动中，营业部为部分客户缴纳一定期限内的手机号码套餐费用，由电信运营商向客户提供手机设备，上述情形违反了《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》（证监会令第 145 号）第九条第一款的规定。二是存在营销人员经办客户账户业务并对客户进行新开客户账户回访的情形，违反了《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告（2010）11 号）第四条第一项和《证券经纪人管理暂行规定》（证监会公告（2020）20 号）第十六条的规定。根据《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》（证监会令第 145 号）第十八条、《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告（2010）11 号）第八条的规定，对营业部采取责令改正的监督管理措施。

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

我们认为相关处罚措施对安信证券股份有限公司的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对安信证券股份有限公司的债券偿还影响很小。公司将持续关注三七互娱立案调查的后续影响。本基金投资 21 安信 G1、三七互娱的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,000.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,026.68

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

1	123107	温氏转债	2,148,273.71	3.64
---	--------	------	--------------	------

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈祥裕增强回报混合 A	宝盈祥裕增强回报混合 C
报告期期初基金份额总额	65,651,750.54	9,066,381.96
报告期期间基金总申购份额	22,870.23	93,439.54
减：报告期期间基金总赎回份额	3,299,344.33	2,514,700.38
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	62,375,276.44	6,645,121.12

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

### §9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金变更注册的文件。

《宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## 9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日