

宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 42 |
| 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 | 42 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 42 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 43 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 43 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 44 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 44 |
| 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 | 44 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 44 |
| § 10 重大事件揭示 | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 44 |
| 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 | 45 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 45 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 45 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 45 |
| 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 | 45 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 45 |
| 10.8 其他重大事件 | 48 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| 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 | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| § 12 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 备查文件目录 | 50 |
| 12.2 存放地点 | 50 |
| 12.3 查阅方式 | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 宝盈泛沿海混合 |
| 基金主代码 | 213002 |
| 交易代码 | 213002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005 年 3 月 8 日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 945,431,787.65 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过投资于泛沿海地区有增长潜力的上市公司，有效分享中国经济快速增长的成果，在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金采取“自上而下”进行资产配置和行业及类属资产配置，“自下而上”精选个股的积极投资策略。</p> <p>在整体资产配置层面，本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区域经济发展政策调整情况、市场资金环境等因素，决定股票、债券及现金的配置比例。</p> <p>在区域资产配置及行业权重层面，本基金根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重。</p> <p>在个股选择层面，本基金以 PEG、每股经营现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据，通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。</p> <p>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>本基金的债券投资采取主动投资策略，运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>上证 A 股指数×80%+上证国债指数×20%</p> <p>当市场出现合适的全市场统一指数时，本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。</p> |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 宝盈基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张磊 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | zhangl@byfunds.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-8888-300 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83515599 | 010-66105798 |
| 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 55 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 55 号 |
| 邮政编码 | | 518034 | 100140 |
| 法定代表人 | | 严震 | 廖林 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.byfunds.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司 | 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(2024年1月1日-2024年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -7,222,258.76 |
| 本期利润 | -12,860,503.27 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0135 |
| 本期加权平均净值利润率 | -3.09% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.10% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -163,472,084.17 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1729 |
| 期末基金资产净值 | 425,714,476.20 |
| 期末基金份额净值 | 0.4503 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 167.21% |

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

- 2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 4、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

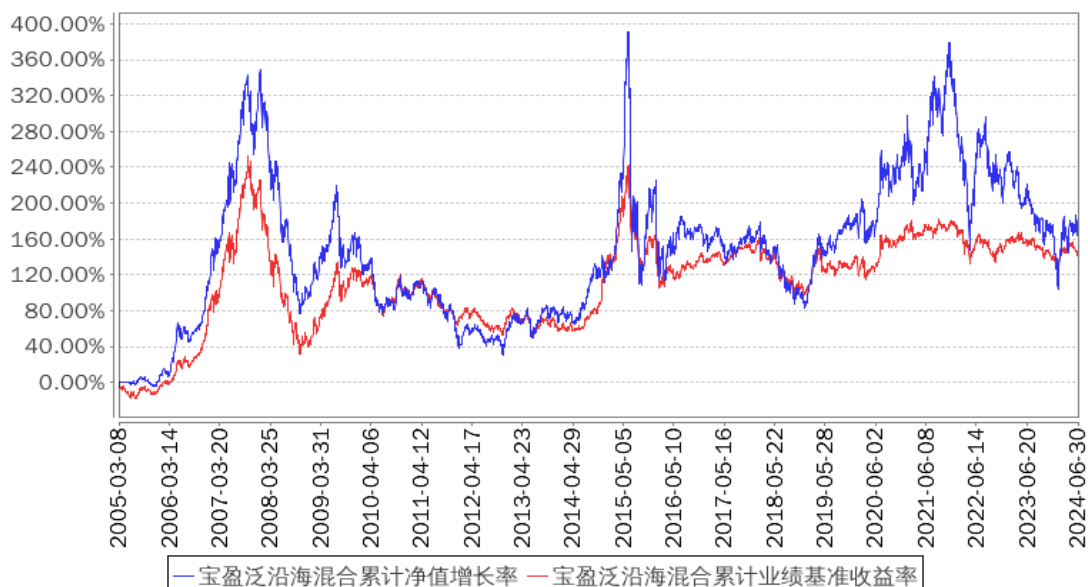
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | -0.68% | 1.56% | -2.97% | 0.44% | 2.29% | 1.12% |
| 过去三个月 | -0.04% | 1.69% | -1.54% | 0.58% | 1.50% | 1.11% |
| 过去六个月 | -3.10% | 2.18% | 0.65% | 0.76% | -3.75% | 1.42% |
| 过去一年 | -14.93% | 1.82% | -4.73% | 0.67% | -10.20% | 1.15% |
| 过去三年 | -31.83% | 1.88% | -11.32% | 0.74% | -20.51% | 1.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 167.21% | 1.71% | 143.28% | 1.20% | 23.93% | 0.51% |

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

宝盈泛沿海混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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、宝盈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有、宝盈华证龙头红利 50 指数发起式、宝盈中债 0-5 年政策性金融债指数、宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）、宝盈盈悦纯债债券、宝盈价值成长混合六十五只基金，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 | 说明 |
|----|----|-----------------------------|------------------|----|
| | | | | |

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|-----|--|----------------|------|------|--|
| 朱建明 | 本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、宝盈成长精选混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金经理；投资经理；权益投资部副总经理（主持工作） | 2020 年 2 月 4 日 | - | 14 年 | 朱建明先生，中国人民银行研究生部金融学硕士。2010 年 7 月至 2011 年 3 月任职于瀚信资产管理有限公司，担任研究员；自 2011 年 5 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究部研究员、专户投资部投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2024 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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|-----|----------|---------|------------------|-----------------|
| 朱建明 | 公募基金 | 5 | 2,942,871,194.17 | 2017 年 1 月 5 日 |
| | 私募资产管理计划 | 3 | 156,845,556.99 | 2014 年 8 月 18 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 8 | 3,085,142,555.26 | - |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年资本市场经历大幅波动，一季度上证最低下探至 2635 点，随后反弹修复，二季度波动率虽有下降但维持弱势震荡，年初至今全部 A 股录得超过 4% 的下跌，但结构分化较大，一方面沪深 300 等权重股录得近 5% 上涨，另一方面中小市值股票领跌，成长行业中仅有与海外需求直接相关且放量迅速的算力和果链方向龙头个股获得涨幅，相对强势的行业集中在红利资产，如公用事业、银行、煤炭等，这些行业的共同特点是具备高现金流属性或留存收益较高，显示市场对于宏观经济的预期悲观。从宏观经济数据最终表现来看，一季度 GDP 同比增速 5.3%，二季度 GDP 同比增速 4.7%，季调环比 0.7%，经济恢复的动能仍然较弱，从最新的数据来看，工业生产、制造业投资和出口是支撑经济数据的三大重要抓手，在新质生产力的拉动下，制造业投资增速“逆势向前”，虽然有各种贸易摩擦的干扰，但今年出口的持续强势大幅缓解了内需增长的压力，也是政策强调定力的有效支撑，内需的疲弱与政策引而不发共同构成了资本市场“弱预期、弱现实”的严峻环境。

虽然短期面临较大考验，但我们始终认为投资本质是追求企业长期价值动态增长的过程，坚持研究中长期确定性成长获取长期超额收益，风格上专注于研究中长期空间较大的成长产业方向，投资策略上分散布局，同时根据细分产业景气度变化、产业格局的演绎，结合上市公司业绩与估值，阶段性重点超配两三个细分方向，基于以上理念，本产品持股周期较长，较少进行波段交易。因此，我们把长期方向仍然聚焦在与全球产业浪潮共振的高景气方向，如人工智能算力、电动车、新材料新制造上，操作上，我们一季度加仓了北美算力供应链公司，如光模块、PCB 与服务器代工龙头，保持了电子、电动车与新材料的持仓，同时基于行业供需格局改善和较大的估值安全边际，时隔两年我们又重新买入了新能源电池龙头。二季度我们提出了独特的“哑铃策略”，一端是具备全球产业竞争力的科技制造，另一端是供给出清后构筑了独特壁垒的“格局资产”。具体来说，在新一轮科技浪潮与产业革命下，虽有各种贸易壁垒和供应链扰动，但中国产业链始终是不可或缺的一环，也是政府着力培育新质生产力的产业高地，哑铃的另一端是经过几年激烈竞争后供给相对出清的低估值行业龙头，主要集中在化工、有色、新能源和资源上，二季度我们加大了相关领域的配置，也取得了一定的正面效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.4503 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.10%，业绩

比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，虽然市场对于经济预期仍在悲观方向，但随着二十届三中全会的召开和决定发布，我们认为政策重心已明确转向至稳内需、促改革上。二十届三中全会着眼于绘制未来十年全面建设社会主义现代化的蓝图，重心是为科技创新和科技成果转化营造良好环境，着力打通束缚新质生产力发展的堵点卡点，围绕市场机制、要素配置、产业体系、制度规则四个方面进一步全面深化改革：第一，完善市场机制下准入与公平竞争，改革财税体制，发挥各地区比较优势，因地制宜发展新质生产力；第二，创新生产要素配置向发展新质生产力顺畅流动，推动要素市场改革；第三，健全产业体系建设推动新质生产力的产业化落地，推动战略性新兴产业发展、传统产业优化升级、实体经济和数字经济深度融合、发展生产性服务业、健全现代化基础设施建设、提升产业链供应链安全；第四，统筹国企民企关系、高水平对外开放、依法治国。相信随着这些改革措施真抓实干，全要素生产率将进一步提升，经济的潜在增速也将预期回升。另一方面，内需不足已经是制约经济发展和居民收入提升的核心矛盾，适度加大中央财政支持的力度，进一步释放内需潜力，对于扭转悲观预期、抗击通缩、改善民生、增进人民福祉意义重大，应当成为政策的不二之选。

目前中国正处于去杠杆去金融化的转型期，我们对这个转型期的时代特征抱有深刻认识，资本市场可能承受的压力也有充分的思想准备，我们相信中国高端制造与科技创新突破重围，凤凰涅槃后一定能诞生具备全球竞争的龙头公司。我们将继续坚守产业价值投资的理念，聚焦于技术迭代与产业驱动下的大级别长周期机会，继续深入产业一线研究，优选技术领先、团队卓越、战略前瞻、商业模式持续的产业龙头优秀公司，给投资者创造稳健的长期回报。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 41,702,202.58 | 42,311,300.83 |
| 结算备付金 | | 459,525.67 | 779,330.24 |
| 存出保证金 | | 92,796.44 | 86,276.26 |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 384,126,882.07 | 403,794,143.72 |
| 其中：股票投资 | | 384,126,882.07 | 403,794,143.72 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 335,077.54 | 227,379.08 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 426,716,484.30 | 447,198,430.13 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023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 | | 16,397.40 | 5,309,581.23 |
| 应付赎回款 | | 212,405.04 | 365,730.61 |
| 应付管理人报酬 | | 427,753.62 | 440,689.26 |
| 应付托管费 | | 71,292.30 | 73,448.22 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 1.39 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 274,159.74 | 647,377.10 |
| 负债合计 | | 1,002,008.10 | 6,836,827.81 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 545,330,241.40 | 546,562,952.80 |
| 未分配利润 | 6.4.7.11 | -119,615,765.20 | -106,201,350.48 |
| 净资产合计 | | 425,714,476.20 | 440,361,602.32 |
| 负债和净资产总计 | | 426,716,484.30 | 447,198,430.13 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金份额净值为人民币 0.4503 元，基金份额总额 945,431,787.65 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -9,860,085.26 | 7,638,875.88 |
| 1. 利息收入 | | 84,691.48 | 84,319.76 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.12 | 84,691.48 | 84,319.76 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -4,337,600.79 | -27,293,109.00 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.13 | -7,947,553.14 | -29,430,530.01 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - | 401,414.95 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.15 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.18 | 3,609,952.35 | 1,736,006.06 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | -5,638,244.51 | 34,818,446.65 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 31,068.56 | 29,218.47 |
| 减：二、营业总支出 | | 3,000,418.01 | 4,626,528.41 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,477,951.64 | 3,871,500.99 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 412,991.96 | 645,250.12 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |

| | | | |
|---------------------|----------|----------------|--------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.21 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 1.15 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.22 | 109,474.41 | 109,776.15 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -12,860,503.27 | 3,012,347.47 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -12,860,503.27 | 3,012,347.47 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -12,860,503.27 | 3,012,347.47 |

6.3 净资产变动表

会计主体：宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 546,562,952.80 | - | -106,201,350.48 | 440,361,602.32 |
| 二、本期期初净资产 | 546,562,952.80 | - | -106,201,350.48 | 440,361,602.32 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -1,232,711.40 | - | -13,414,414.72 | -14,647,126.12 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -12,860,503.27 | -12,860,503.27 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -1,232,711.40 | - | -553,911.45 | -1,786,622.85 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,516,191.40 | - | -8,709,958.61 | 25,806,232.79 |
| 2. 基金赎回款 | -35,748,902.80 | - | 8,156,047.16 | -27,592,855.64 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|-----------------|----------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） | | | | |
| 四、本期期末净资产 | 545,330,241.40 | - | -119,615,765.20 | 425,714,476.20 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 | 555,678,116.25 | - | -47,910,373.63 | 507,767,742.62 |
| 二、本期期初净资产 | 555,678,116.25 | - | -47,910,373.63 | 507,767,742.62 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -7,066,060.72 | - | 2,722,882.31 | -4,343,178.41 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 3,012,347.47 | 3,012,347.47 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -7,066,060.72 | - | -289,465.16 | -7,355,525.88 |
| 其中：1. 基金申购款 | 26,063,685.76 | - | -1,617,295.85 | 24,446,389.91 |
| 2. 基金赎回款 | -33,129,746.48 | - | 1,327,830.69 | -31,801,915.79 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 548,612,055.53 | - | -45,187,491.32 | 503,424,564.21 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨凯

张献锦

何瑜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金(原宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金,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”)证监基金字[2004]218号《关于同意宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金募集的批复》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《宝盈泛沿海区域增长股票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401,940,889.81元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第18号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金合同》于2005年3月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为402,050,224.74份基金份额,其中认购资金利息折合109,334.93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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更新招募说明书》和《关于宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2007年6月11日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:1.733642060(保留到小数点后9位),并于2007年6月12日进行了变更登记。

根据2014年8月8日正式实施的证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,本基金管理人于2015年8月5日发布《关于宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》,将本基金类型变更为混合型证券投资基金,“宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金”基金名称变更为“宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈泛沿海区域增长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国内依法公开发行、上市的股票(含存托凭证)、债券、货币市场工具及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金财产中股票(含存托凭证)投资比例为60%-95%,债券资产比例为0%-35%,现金或持有期限为1年以内政府债券的投资比例不低于5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金非现金资产中,不低于80%的资金将投资于在泛沿海区域注册的上市公司发行的证券。同时,本基金将根据区域经济发展情况、证券市场的阶段性变化,以不超过非现金资产20%的部分投资于泛沿海区域以外地区注册的、具有持续增长潜力的上市公司证券。本基金的业绩比较基准为:上证A股指数 \times 80%+上证国债指数 \times 20%。当市场出现合适的全市场统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全市场统一指数。

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》、《宝盈泛沿海区域增长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 2024 年上半年度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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务

操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 41,702,202.58 |
| 等于：本金 | 41,698,806.15 |
| 加：应计利息 | 3,396.43 |

| | |
|----------------|---------------|
| 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 | 41,702,202.58 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------|------------------------|------|----------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 366,600,541.12 | - | 384,126,882.07 | 17,526,340.95 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 366,600,541.12 | - | 384,126,882.07 | 17,526,340.95 |

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 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 197.47 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 175,454.67 |
| 其中：交易所市场 | 175,454.67 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 98,507.60 |
| 合计 | 274,159.74 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 947,569,758.08 | 546,562,952.80 |
| 本期申购 | 59,840,443.03 | 34,516,191.40 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -61,978,413.46 | -35,748,902.80 |
| 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 | 945,431,787.65 | 545,330,241.40 |

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

| 目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 上年度末 | -156,644,600.29 | 50,443,249.81 | -106,201,350.48 |
| 本期期初 | -156,644,600.29 | 50,443,249.81 | -106,201,350.48 |
| 本期利润 | -7,222,258.76 | -5,638,244.51 | -12,860,503.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 394,774.88 | -948,686.33 | -553,911.45 |
| 其中：基金申购款 | -10,391,343.82 | 1,681,385.21 | -8,709,958.61 |
| 金赎回款 | 10,786,118.70 | -2,630,071.54 | 8,156,047.16 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -163,472,084.17 | 43,856,318.97 | -119,615,765.20 |

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 79,832.56 |
| 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 | 4,070.47 |
| 其他 | 788.45 |
| 合计 | 84,691.48 |

6.4.7.13 股票投资收益

6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -7,947,553.14 |
| 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 | -7,947,553.14 |

6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 306,158,535.64 |
| 减：卖出股票成本总额 | 313,352,251.04 |
| 减：交易费用 | 753,837.74 |
| 买卖股票差价收入 | -7,947,553.14 |

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 3,609,952.35 |
| 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 | 3,609,952.35 |

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -5,638,244.51 |
| 股票投资 | -5,638,244.51 |
| 债券投资 | - |
| 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 | -5,638,244.51 |

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 27,959.58 |
| 基金转换费收入 | 3,108.98 |
| 合计 | 31,068.56 |

6.4.7.21 信用减值损失

无。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 1,366.81 |
| 债券账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 109,474.41 |

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------|-----------------------|
| 宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 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 | 上年度可比期间 |
|------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,477,951.64 | 3,871,500.99 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 904,158.60 | 1,411,321.31 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,573,793.04 | 2,460,179.68 |

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，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 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据本基金的基金管理人于 2023 年 8 月 25 日发布的《宝盈基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，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 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 412,991.96 | 645,250.12 |

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

根据本基金的基金管理人于 2023 年 8 月 25 日发布的《宝盈基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，支付基金托管人中国工商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

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 |
| 中国工商银行 | 41,702,202.58 | 79,832.56 | 52,011,948.98 | 78,465.25 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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（2024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 | 成功认购 | 受限期 | 流通受限 | 认购价格 | 期末估值 | 数量（单 | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

| | 名称 | 日期 | | 类型 | | 单价 | 位： 股) | | | |
|--------|------|------------|----------|-----------|-------|-------|----------|----------|-----------|---|
| 001359 | 平安电工 | 2024年3月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.39 | 20.60 | 184 | 3,199.76 | 3,790.40 | - |
| 001387 | 雪祺电气 | 2024年1月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38 | 15.25 | 133 | 2,045.54 | 2,028.25 | - |
| 001387 | 雪祺电气 | 2024年6月3日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限-送股 | - | 15.25 | 40 | - | 610.00 | - |
| 001389 | 广合科技 | 2024年3月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.43 | 34.56 | 222 | 3,869.46 | 7,672.32 | - |
| 301392 | 汇成真空 | 2024年5月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.20 | 41.66 | 219 | 2,671.80 | 9,123.54 | - |
| 301502 | 华阳智能 | 2024年1月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.01 | 37.83 | 138 | 3,865.38 | 5,220.54 | - |
| 301536 | 星辰科技 | 2024年3月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.16 | 32.27 | 481 | 7,772.96 | 15,521.87 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024年3月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.82 | 91.24 | 107 | 5,972.74 | 9,762.68 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024年5月22日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限-送股 | - | 91.24 | 43 | - | 3,923.32 | - |
| 301539 | 宏鑫科技 | 2024年4月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.64 | 19.82 | 361 | 3,841.04 | 7,155.02 | - |
| 301565 | 中 | 2024 | 6个月 | 新股 | 11.88 | 18.98 | 711 | 8,446.68 | 13,494.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|----------|-----------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | 仑新材 | 年6月13日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301566 | 达利凯普 | 2023年12月22日 | 6个月 | 新股流通受限 | 8.90 | 16.97 | 576 | 5,126.40 | 9,774.72 | - |
| 301587 | 中瑞股份 | 2024年3月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.73 | 25.26 | 306 | 6,649.38 | 7,729.56 | - |
| 301588 | 美新科技 | 2024年3月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.50 | 21.25 | 257 | 3,726.50 | 5,461.25 | - |
| 301589 | 诺瓦星云 | 2024年2月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 126.89 | 188.01 | 474 | 60,145.86 | 89,116.74 | - |
| 301589 | 诺瓦星云 | 2024年5月30日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限-送股 | - | 188.01 | 379 | - | 71,255.79 | - |
| 301591 | 肯特股份 | 2024年2月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.43 | 36.98 | 219 | 4,255.17 | 8,098.62 | - |
| 603082 | 北自科技 | 2024年1月23日 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.28 | 29.49 | 107 | 2,276.96 | 3,155.43 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024年6月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.65 | 18.65 | 129 | 2,405.85 | 2,405.85 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024年6月28日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 18.65 | 18.65 | 1,158 | 21,596.70 | 21,596.70 | - |
| 603312 | 西典新能 | 2024年1月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 29.02 | 25.36 | 130 | 3,772.60 | 3,296.80 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| 603325 | 博隆技术 | 2024年1月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 72.46 | 68.06 | 66 | 4,782.36 | 4,491.96 | - |
| 603341 | 龙旗科技 | 2024年2月23日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.00 | 37.49 | 204 | 5,304.00 | 7,647.96 | - |
| 603344 | 星德胜 | 2024年3月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.18 | 22.66 | 182 | 3,490.76 | 4,124.12 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024年6月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.56 | 20.56 | 106 | 2,179.36 | 2,179.36 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024年6月26日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 20.56 | 20.56 | 945 | 19,429.20 | 19,429.20 | - |
| 603375 | 盛景微 | 2024年1月17日 | 6个月 | 新股流通受限 | 38.18 | 38.90 | 72 | 2,748.96 | 2,800.80 | - |
| 603381 | 永臻股份 | 2024年6月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.35 | 25.13 | 178 | 4,156.30 | 4,473.14 | - |
| 688530 | 欧莱新材 | 2024年4月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.60 | 16.10 | 344 | 3,302.40 | 5,538.40 | - |
| 688584 | 上海合晶 | 2024年2月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.66 | 15.89 | 591 | 13,392.06 | 9,390.99 | - |
| 688691 | 灿芯股份 | 2024年4月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.86 | 42.51 | 247 | 4,905.42 | 10,499.97 | - |
| 688692 | 达梦数据 | 2024年6月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 86.96 | 174.93 | 164 | 14,261.44 | 28,688.52 | - |
| 688695 | 中创股份 | 2024年3月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.43 | 31.55 | 186 | 4,171.98 | 5,868.30 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|-----|----------------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 688709 | 成都 华 微 | 2024 年1月 31日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 15.69 | 18.79 | 749 | 11,751.81 | 14,073.71 | - |
|--------|--------------|--------------------|-----|----------------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|

注：1、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中需要限售的部分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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的运作涉及的金融工具主要包括国内依法公开上市的股票(含存托凭证)、债券、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议

通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 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）。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------------|----------|----------|------------------------|-----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 41,702,202.58 | - | - | - | 41,702,202.58 |
| 结算备付金 | 459,525.67 | - | - | - | 459,525.67 |
| 存出保证金 | 92,796.44 | - | - | - | 92,796.44 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 384,126,882.07 | 384,126,882.07 |
| 应收申购款 | - | - | - | 335,077.54 | 335,077.54 |
| 资产总计 | 42,254,524.69 | - | - | 384,461,959.61 | 426,716,484.30 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 212,405.04 | 212,405.04 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 427,753.62 | 427,753.62 |
| 应付托管费 | - | - | - | 71,292.30 | 71,292.30 |
| 应付清算款 | - | - | - | 16,397.40 | 16,397.40 |
| 其他负债 | - | - | - | 274,159.74 | 274,159.74 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,002,008.10 | 1,002,008.10 |
| 利率敏感度缺口 | 42,254,524.69 | - | - | -383,459,951.51 | 425,714,476.20 |
| 上年度末 2023年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 42,311,300.83 | - | - | - | 42,311,300.83 |
| 结算备付金 | 779,330.24 | - | - | - | 779,330.24 |
| 存出保证金 | 86,276.26 | - | - | - | 86,276.26 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 403,794,143.72 | 403,794,143.72 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|-----------------|----------------|
| 应收申购款 | - | - | - | 227,379.08 | 227,379.08 |
| 资产总计 | 43,176,907.33 | - | - | -404,021,522.80 | 447,198,430.13 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 365,730.61 | 365,730.61 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 440,689.26 | 440,689.26 |
| 应付托管费 | - | - | - | 73,448.22 | 73,448.22 |
| 应付清算款 | - | - | - | 5,309,581.23 | 5,309,581.23 |
| 应交税费 | - | - | - | 1.39 | 1.39 |
| 其他负债 | - | - | - | 647,377.10 | 647,377.10 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,836,827.81 | 6,836,827.81 |
| 利率敏感度缺口 | 43,176,907.33 | - | - | -397,184,694.99 | 440,361,602.32 |

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取“自上而下”进行资产配置和行业及类属资产配置，“自下而上”精选个股的积极投资策略。通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；根据区域经济特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金财产配置在各行业的权重；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。股票(含存托凭证)投资比例的变动范围为 60%—95%，其中投资于泛沿海区域注册的相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；债券投资比例的变动范围为 0—35%；现金或持有期限

为 1 年以内政府债券的投资比例不低于 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 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 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 | 384,126,882.07 | 90.23 | 403,794,143.72 | 91.70 |
| 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 | 384,126,882.07 | 90.23 | 403,794,143.72 | 91.70 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除上证 A 股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（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） | |
| 分析 | 1. 上证 A 股指数收益率上升 5% | 30,694,860.45 | 22,760,272.05 |
| | 2. 上证 A 股指数收益率下降 5% | -30,694,860.45 | -22,760,272.05 |

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 383,707,481.46 | 402,709,048.79 |
| 第二层次 | 45,611.11 | - |
| 第三层次 | 373,789.50 | 1,085,094.93 |
| 合计 | 384,126,882.07 | 403,794,143.72 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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 2024 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(2023 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

本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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 | 384,126,882.07 | 90.02 |
| | 其中：股票 | 384,126,882.07 | 90.02 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 42,161,728.25 | 9.88 |
| 8 | 其他各项资产 | 427,873.98 | 0.10 |
| 9 | 合计 | 426,716,484.30 | 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 | 7,497,020.00 | 1.76 |
| C | 制造业 | 347,208,892.70 | 81.56 |
| 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 | 5,233,312.00 | 1.23 |
| 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 | 14,864,104.37 | 3.49 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 9,323,553.00 | 2.19 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 384,126,882.07 | 90.23 |

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 | 601138 | 工业富联 | 1,541,700 | 42,242,580.00 | 9.92 |
| 2 | 300502 | 新易盛 | 384,100 | 40,541,755.00 | 9.52 |
| 3 | 002463 | 沪电股份 | 1,100,880 | 40,182,120.00 | 9.44 |
| 4 | 600114 | 东睦股份 | 2,536,800 | 36,504,552.00 | 8.57 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 197,100 | 35,483,913.00 | 8.34 |
| 6 | 300037 | 新宙邦 | 1,094,022 | 31,245,268.32 | 7.34 |
| 7 | 601689 | 拓普集团 | 518,600 | 27,802,146.00 | 6.53 |
| 8 | 688270 | 臻镭科技 | 879,945 | 22,966,564.50 | 5.39 |
| 9 | 603067 | 振华股份 | 1,702,100 | 19,846,486.00 | 4.66 |
| 10 | 688279 | 峰岬科技 | 129,055 | 14,312,199.50 | 3.36 |
| 11 | 002896 | 中大力德 | 498,400 | 13,905,360.00 | 3.27 |
| 12 | 001979 | 招商蛇口 | 1,060,700 | 9,323,553.00 | 2.19 |
| 13 | 301413 | 安培龙 | 207,114 | 8,564,163.90 | 2.01 |
| 14 | 002913 | 奥士康 | 304,200 | 8,155,602.00 | 1.92 |
| 15 | 002155 | 湖南黄金 | 414,200 | 7,497,020.00 | 1.76 |
| 16 | 601877 | 正泰电器 | 300,200 | 5,721,812.00 | 1.34 |
| 17 | 603970 | 中农立华 | 306,400 | 5,233,312.00 | 1.23 |
| 18 | 002532 | 天山铝业 | 610,600 | 4,951,966.00 | 1.16 |
| 19 | 000893 | 亚钾国际 | 298,100 | 4,817,296.00 | 1.13 |
| 20 | 002001 | 新和成 | 102,000 | 1,958,400.00 | 0.46 |
| 21 | 688692 | 达梦数据 | 1,640 | 359,873.40 | 0.08 |
| 22 | 301589 | 诺瓦星云 | 1,704 | 325,892.03 | 0.08 |
| 23 | 301565 | 中仑新材 | 7,103 | 174,381.42 | 0.04 |
| 24 | 301536 | 星辰科技 | 4,809 | 167,218.27 | 0.04 |
| 25 | 301538 | 骏鼎达 | 1,493 | 151,048.04 | 0.04 |
| 26 | 688709 | 成都华微 | 7,487 | 144,251.87 | 0.03 |
| 27 | 688691 | 灿芯股份 | 2,461 | 128,948.97 | 0.03 |
| 28 | 301392 | 汇成真空 | 2,189 | 128,899.54 | 0.03 |
| 29 | 301566 | 达利凯普 | 5,755 | 97,662.35 | 0.02 |
| 30 | 001389 | 广合科技 | 2,219 | 97,078.01 | 0.02 |
| 31 | 688584 | 上海合晶 | 5,904 | 96,789.84 | 0.02 |
| 32 | 301539 | 宏鑫科技 | 3,607 | 92,654.66 | 0.02 |
| 33 | 301587 | 中瑞股份 | 3,056 | 89,267.06 | 0.02 |
| 34 | 301591 | 肯特股份 | 2,184 | 88,113.42 | 0.02 |
| 35 | 603341 | 龙旗科技 | 2,032 | 78,903.40 | 0.02 |
| 36 | 688530 | 欧莱新材 | 3,437 | 69,099.55 | 0.02 |
| 37 | 688695 | 中创股份 | 1,856 | 63,082.50 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 38 | 301578 | 辰奕智能 | 1,528 | 60,462.96 | 0.01 |
| 39 | 301588 | 美新科技 | 2,568 | 59,238.22 | 0.01 |
| 40 | 301502 | 华阳智能 | 1,375 | 53,673.83 | 0.01 |
| 41 | 603381 | 永臻股份 | 1,778 | 49,273.14 | 0.01 |
| 42 | 603325 | 博隆技术 | 660 | 45,347.28 | 0.01 |
| 43 | 603344 | 星德胜 | 1,813 | 42,892.99 | 0.01 |
| 44 | 001359 | 平安电工 | 1,833 | 40,513.63 | 0.01 |
| 45 | 603312 | 西典新能 | 1,296 | 33,263.00 | 0.01 |
| 46 | 603082 | 北自科技 | 1,070 | 32,276.55 | 0.01 |
| 47 | 603375 | 盛景微 | 714 | 28,339.56 | 0.01 |
| 48 | 001387 | 雪祺电气 | 1,729 | 26,756.25 | 0.01 |
| 49 | 603285 | 键邦股份 | 1,287 | 24,002.55 | 0.01 |
| 50 | 603350 | 安乃达 | 1,051 | 21,608.56 | 0.01 |

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 | 300750 | 宁德时代 | 34,082,523.00 | 7.74 |
| 2 | 002050 | 三花智控 | 23,042,369.10 | 5.23 |
| 3 | 603067 | 振华股份 | 20,491,034.00 | 4.65 |
| 4 | 300476 | 胜宏科技 | 19,170,618.49 | 4.35 |
| 5 | 002896 | 中大力德 | 18,251,713.97 | 4.14 |
| 6 | 300502 | 新易盛 | 16,161,003.84 | 3.67 |
| 7 | 002463 | 沪电股份 | 15,094,036.00 | 3.43 |
| 8 | 300037 | 新宙邦 | 12,693,512.87 | 2.88 |
| 9 | 601877 | 正泰电器 | 11,449,266.00 | 2.60 |
| 10 | 300445 | 康斯特 | 10,999,527.00 | 2.50 |
| 11 | 001979 | 招商蛇口 | 10,737,549.00 | 2.44 |
| 12 | 301413 | 安培龙 | 10,685,900.04 | 2.43 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能 | 9,143,873.00 | 2.08 |
| 14 | 002913 | 奥士康 | 8,506,579.00 | 1.93 |
| 15 | 601595 | 上海电影 | 7,809,433.00 | 1.77 |
| 16 | 600132 | 重庆啤酒 | 7,512,658.00 | 1.71 |
| 17 | 002155 | 湖南黄金 | 7,335,884.00 | 1.67 |
| 18 | 601138 | 工业富联 | 7,093,708.00 | 1.61 |
| 19 | 300232 | 洲明科技 | 6,095,611.60 | 1.38 |
| 20 | 603970 | 中农立华 | 5,640,566.52 | 1.28 |

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 | 001309 | 德明利 | 35,965,902.00 | 8.17 |
| 2 | 002463 | 沪电股份 | 29,248,385.50 | 6.64 |
| 3 | 688110 | 东芯股份 | 27,138,499.20 | 6.16 |
| 4 | 002050 | 三花智控 | 22,467,101.90 | 5.10 |
| 5 | 601595 | 上海电影 | 20,660,279.56 | 4.69 |
| 6 | 300476 | 胜宏科技 | 20,413,131.55 | 4.64 |
| 7 | 601138 | 工业富联 | 12,907,336.00 | 2.93 |
| 8 | 300445 | 康斯特 | 12,141,136.80 | 2.76 |
| 9 | 301312 | 智立方 | 12,126,535.00 | 2.75 |
| 10 | 301307 | 美利信 | 11,973,139.03 | 2.72 |
| 11 | 688041 | 海光信息 | 11,240,593.05 | 2.55 |
| 12 | 300502 | 新易盛 | 10,781,223.38 | 2.45 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能 | 8,927,939.00 | 2.03 |
| 14 | 600132 | 重庆啤酒 | 7,880,919.00 | 1.79 |
| 15 | 688279 | 峰昭科技 | 7,768,716.70 | 1.76 |
| 16 | 601801 | 皖新传媒 | 7,686,567.96 | 1.75 |
| 17 | 600114 | 东睦股份 | 5,886,455.00 | 1.34 |
| 18 | 300232 | 洲明科技 | 5,050,327.00 | 1.15 |
| 19 | 600418 | 江淮汽车 | 4,309,204.00 | 0.98 |
| 20 | 601877 | 正泰电器 | 4,278,267.00 | 0.97 |

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 | 299,323,233.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 306,158,535.64 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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 | 92,796.44 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 335,077.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 427,873.98 |

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

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

| 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 (%) |
| 40,698 | 23,230.42 | - | - | 945,431,787.65 | 100.00 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1.77 | 0.0000 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2005 年 3 月 8 日) 基 金份额总额 | 402,050,224.74 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 947,569,758.08 |
| 本报告期基金总申购份额 | 59,840,443.03 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 61,978,413.46 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 945,431,787.65 |

§ 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：

根据 2024 年第 1 次股东会决议，聘任王伦刚、伍利娜为宝盈基金管理有限公司董事，张苏彤、廖振中不再担任宝盈基金管理有限公司董事。聘任颜志华、邹明睿为宝盈基金管理有限公司监事，魏玲玲、汪兀不再担任宝盈基金管理有限公司监事。

根据第七届董事会第一次会议决议，聘任汪浪为宝盈基金管理有限公司总经理助理。

根据宝盈基金管理有限公司第七届董事会第二次会议决议，同意彭玖雯不再担任宝盈基金管理有限公司财务负责人，公司按照法规要求聘任新的财务负责人之前，由总经理杨凯暂时履行财务负责人职责。

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

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 (%) | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 浙商证券 | 1 | 260,352,681.22 | 43.11 | 243,664.39 | 43.35 | - |
| 国联证券 | 1 | 145,685,091.71 | 24.12 | 136,352.00 | 24.26 | - |
| 东吴证券 | 1 | 144,524,258.28 | 23.93 | 135,260.48 | 24.07 | - |
| 申万宏源证券 | 2 | 32,179,151.56 | 5.33 | 30,113.66 | 5.36 | - |
| 海通证券 | 2 | 16,126,116.82 | 2.67 | 11,868.74 | 2.11 | - |
| 广发证券 | 1 | 5,104,452.25 | 0.85 | 4,777.34 | 0.85 | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东亚前海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高盛中国证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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、席位变更情况

(1) 本基金本报告期内无新租交易单元。

(2) 本基金本报告期内退租中泰证券深圳交易单元一个。

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(%) |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 富证券 | | | | | | |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东亚前海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高盛中国证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------------------|-----------------------|------------|
| 1 | 宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新） | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露 | 2024-06-28 |

| | | | |
|----|--|---|------------|
| | | 网站 | |
| 2 | 宝盈基金管理有限公司关于新增云湾基金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 | 2024-06-28 |
| 3 | 宝盈基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告 | 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 | 2024-05-31 |
| 4 | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员(财务负责人)变更的公告 | 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 | 2024-04-30 |
| 5 | 宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金 2024 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 | 2024-04-22 |
| 6 | 宝盈基金管理有限公司旗下 62 只基金 2024 年第一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 | 2024-04-22 |
| 7 | 宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金 2023 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 | 2024-03-29 |
| 8 | 关于宝盈基金管理有限公司增加微众银行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 | 2024-03-15 |
| 9 | 宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 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 | 2024-03-01 |
| 10 | 宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金 2023 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 | 2024-01-19 |
| 11 | 宝盈基金管理有限公司旗下 60 只基金 2023 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 | 2024-01-19 |
| 12 | 宝盈基金管理有限公司关于新增大智慧基金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 | 2024-01-16 |

§ 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

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金设立的文件。

根据《关于宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金名称变更为宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金。

《宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 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

2024 年 8 月 30 日