

宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38

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	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	38
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	38
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	38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.11 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金	
基金简称	宝盈盈润纯债债券	
基金主代码	006242	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 16 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	680,410,018.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E
下属分级基金的交易代码	006242	020538
报告期末下属分级基金的份额总额	641,981,584.77 份	38,428,433.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
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。</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</p>

	<p>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>（4）流动性管理策略。本策略侧重对组合债券可质押情况的管理。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。</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、收益率利差分析和公司基本面分析、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、中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊	石立平
	联系电话	0755-83276688	010-63639180
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-8888-300	95595
传真		0755-83515599	010-63639132
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		518034	100033
法定代表人		严震	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、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)	2024年2月5日(基金合同生效日)-2024年6月30日
	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E
本期已实现收益	4,793,731.03	231,363.87
本期利润	7,584,525.88	443,638.01
加权平均基金份额本期利润	0.0209	0.0173
本期加权平均净值利润率	2.00%	1.65%
本期基金份额净值增长率	1.71%	1.71%
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	29,613,329.04	1,755,671.52
期末可供分配基金份额利润	0.0461	0.0457
期末基金资产净值	679,056,065.00	40,630,888.78
期末基金份额净值	1.0578	1.0573
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	27.11%	1.71%

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。

5、本基金于 2024 年 2 月 5 日起增加收取销售服务费的 E 类收费模式，其对应的基金份额简称为“宝盈盈润纯债债券 E”。

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

宝盈盈润纯债债券 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	0.46%	0.02%	0.90%	0.03%	-0.44%	-0.01%
过去三个月	1.32%	0.05%	1.77%	0.07%	-0.45%	-0.02%
过去六个月	1.71%	0.05%	3.95%	0.07%	-2.24%	-0.02%
过去一年	4.68%	0.04%	6.07%	0.06%	-1.39%	-0.02%
过去三年	16.96%	0.03%	15.96%	0.06%	1.00%	-0.03%
自基金合同生效起至今	27.11%	0.05%	23.48%	0.06%	3.63%	-0.01%

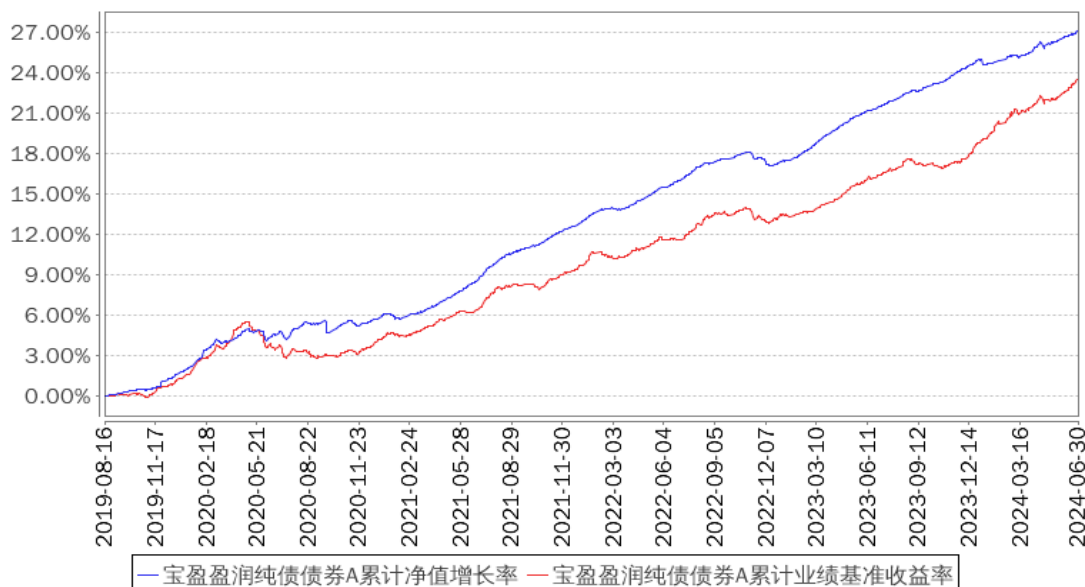
宝盈盈润纯债债券 E

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	0.45%	0.02%	0.90%	0.03%	-0.45%	-0.01%
过去三个月	1.29%	0.05%	1.77%	0.07%	-0.48%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.71%	0.04%	2.76%	0.08%	-1.05%	-0.04%

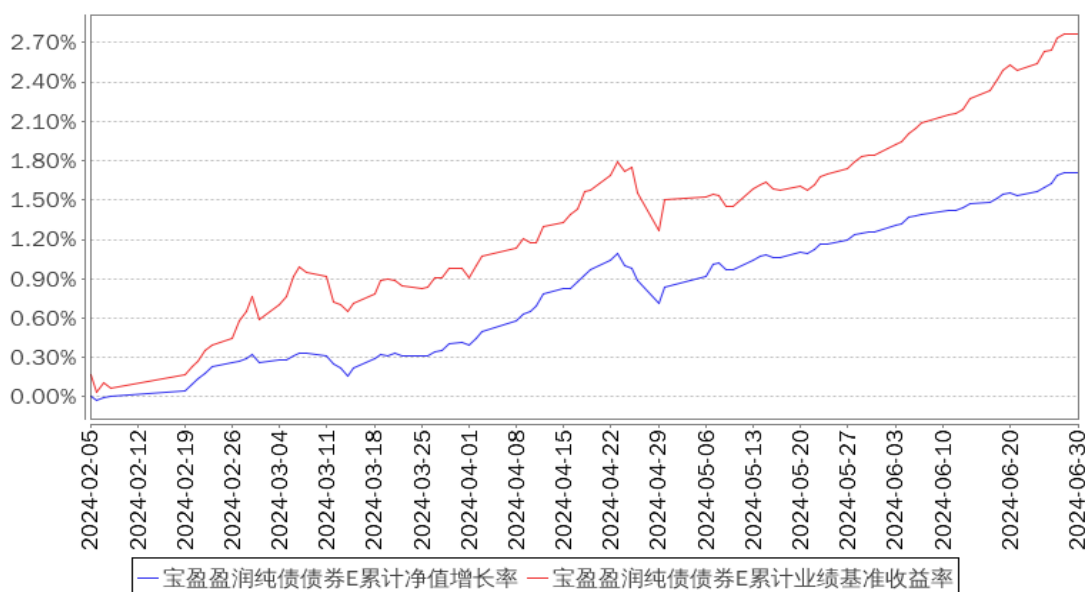
注：本基金于 2024 年 2 月 5 日起增加收取销售服务费的 E 类收费模式，其对应的基金份额简称为“宝盈盈润纯债债券 E”。

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

宝盈盈润纯债债券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



宝盈盈润纯债债券E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2024 年 2 月 5 日起增加收取销售服务费的 E 类收费模式，其对应的基金份额简称为“宝盈盈润纯债债券 E”。

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	离任		

		日期	日期	年限	
杨献忠	本基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈安盛中短债债券型证券投资基金、宝盈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理	2019 年 8 月 16 日	2024 年 4 月 2 日	10 年	杨献忠先生，中国人民大学金融学硕士。2013 年 8 月至 2016 年 11 月在中国工商银行总行金融市场部担任交易员；2016 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部，曾任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
卢贤海	本基金、宝盈盈旭纯债债券型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈聚鑫纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金基金经理	2022 年 9 月 30 日	-	8 年	卢贤海先生，清华大学核科学与技术博士。2015 年 7 月至 2017 年 9 月在招商财富资产管理有限公司从事宏观研究工作；2017 年 10 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、杨献忠为首任基金经理，其“任职日期”指按照基金合同生效日填写；其“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2、卢贤海非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、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

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投

投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，2024 上半年宏观经济总体平稳，增速有所回落，上半年 GDP 增速为 5.0%，城镇调查失业率略降平均为 5.1%，固定资产投资同比增长 3.9%，规上工业增加值同比增长 5.3%。房地产市场的销售和开发投资同比走弱，上半年商品房销售面积和投资同比约-19%和-10%。出口方面，上半年出口增速约 3.6%。通胀方面，上半年居民消费价格（CPI）同比上涨 0.1%，涨幅温和。债券市场方面，流动性保持合理充裕，5 年期 MLF 下调 1 次 25bp；10 年期国债从年初 2.56%左右下行到二季度末的 2.21%左右，超长期利率债下行幅度较大。信用市场方面，各等级信用债收益率整体下行，信用利差压缩。

报告期内，本基金增配了信用债，适度拉长组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈盈润纯债债券 A 的基金份额净值为 1.0578 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.71%；截至本报告期末宝盈盈润纯债债券 E 的基金份额净值为 1.0573 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.71%。同期业绩比较基准收益率为 3.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国通胀近期有所回落美联储降息概率上升，但美国大选及后续政策变动可能带来外需的扰动；国内经济来看，经济内生动力仍弱，复苏信号仍需观察，随着地产支持政策出台或许有望企稳。流动性方面，央行总体保持支持性的货币政策，7 月降低 7 天 OMO 利率支持经济复苏，预计后续流动性将保持合理充裕。市场方面，当前收益率水平处于历史偏低分位，在当前缺少优质低风险资产的大环境下仍有配置价值。随着土地出让大幅减少，地方财政压力较大，同时隐性债务管控仍严厉，需警惕尾部城投的信用风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序

进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在宝盈盈润纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理

依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：宝盈盈润纯债债券型证券投资基金

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	7,380,941.53	3,932,417.22
结算备付金		-	-
存出保证金		2,343.12	-
交易性金融资产	6.4.7.2	889,604,915.53	333,547,856.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		889,604,915.53	333,547,856.92
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		840,000.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,354,807.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		903,183,007.25	337,480,274.14

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		176,044,204.54	-
应付清算款		3,300,812.35	-
应付赎回款		3,771,765.69	38,240.11
应付管理人报酬		167,674.97	85,699.38
应付托管费		55,891.66	28,566.44
应付销售服务费		3,388.09	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,325.66	33,551.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	125,990.51	193,912.03
负债合计		183,496,053.47	379,969.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	680,410,018.06	324,132,626.84
未分配利润	6.4.7.11	39,276,935.72	12,967,678.02
净资产合计		719,686,953.78	337,100,304.86
负债和净资产总计		903,183,007.25	337,480,274.14

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.0578 元，A 类基金份额 641,981,584.77 份；E 类基金份额净值人民币 1.0573 元，E 类基金份额 38,428,433.29 份；宝盈盈润纯债债券型证券投资基金基金份额总额合计为 680,410,018.06 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈盈润纯债债券型证券投资基金

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		9,715,535.79	13,435,028.87
1. 利息收入		43,580.19	300,901.96
其中：存款利息收入	6.4.7.12	37,779.91	30,729.05
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		5,800.28	270,172.91

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,616,263.24	8,207,907.69
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	6,616,263.24	8,207,907.69
资产支持证券投资 收益	6.4.7.15	-	-
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	-	-
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	3,003,068.99	4,925,301.58
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	52,623.37	917.64
减：二、营业总支出		1,687,371.90	874,045.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	584,138.28	553,259.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	194,712.75	184,419.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,389.18	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		762,626.10	-
其中：卖出回购金融资产 支出		762,626.10	-
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		11,500.81	25,240.93
8. 其他费用	6.4.7.22	124,004.78	111,124.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,028,163.89	12,560,983.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,028,163.89	12,560,983.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,028,163.89	12,560,983.79

6.3 净资产变动表

会计主体：宝盈盈润纯债债券型证券投资基金

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	324,132,626.84	-	12,967,678.02	337,100,304.86
二、本期期初净资产	324,132,626.84	-	12,967,678.02	337,100,304.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	356,277,391.22	-	26,309,257.70	382,586,648.92
(一)、综合收益总额	-	-	8,028,163.89	8,028,163.89
(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)	356,277,391.22	-	18,281,093.81	374,558,485.03
其中：1. 基金申购款	739,018,172.25	-	34,707,202.22	773,725,374.47
2. 基金赎回款	-382,740,781.03	-	-16,426,108.41	-399,166,889.44
(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	680,410,018.06	-	39,276,935.72	719,686,953.78
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	448,662,956.35	-	9,953,892.92	458,616,849.27
二、本期期初净资产	448,662,956.35	-	9,953,892.92	458,616,849.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-119,644,009.69	-	9,151,436.60	-110,492,573.09
(一)、综合收益总额	-	-	12,560,983.79	12,560,983.79
(二)、本期基金份额交易产生的	-119,644,009.6	-	-3,409,547.19	-123,053,556.88

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	9			
其中：1. 基金申 购款	-	-	-	-
2. 基金赎 回款	-119,644,009.6 9	-	-3,409,547.19	-123,053,556.88
(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	329,018,946.66	-	19,105,329.52	348,124,276.18

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

宝盈盈润纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1141号《关于准予宝盈盈润纯债债券型证券投资基金注册的批复》与机构部函[2019]1295号《关于宝盈盈润纯债债券型证券投资基金延期募集备案的回函》注册,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈盈润纯债债券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252,250,284.40元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0489号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈盈润纯债债券型证券投资基金基金合同》于2019年8月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为252,327,549.38份基金份额,其中认购资金利息折合77,264.98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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于2024年2月3日发布的《关于宝盈盈润纯债债券型证券投资基金增设E类基金份额的公告》以及更新后的《宝盈盈润纯债债券型证券投资

基金基金合同》的有关规定，于 2024 年 2 月 5 日起本基金在现有基金份额的基础上增设 E 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。在投资者申购时收取申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 E 类基金份额。A 类基金份额、E 类基金份额分别设置代码，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈盈润纯债债券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、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、分离交易可转债纯债等)、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、资产支持证券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。本基金不参与股票、权证等权益类资产投资，也不投资于可转换债券(分离交易可转债纯债除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。本基金每个交易日日终，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率 \times 90%+1 年期定期存款利率(税后) \times 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》、《宝盈盈润纯债债券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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产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

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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	7,380,941.53
等于：本金	7,380,154.23
加：应计利息	787.30
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	7,380,941.53

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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,534,590.90	127,487.94	14,656,037.94	-6,040.90
	银行间市场	861,713,869.42	9,112,277.59	874,948,877.59	4,122,730.58
	合计	876,248,460.32	9,239,765.53	889,604,915.53	4,116,689.68
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	876,248,460.32	9,239,765.53	889,604,915.53	4,116,689.68	

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	533.41
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,949.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	26,949.50
应付利息	-
预提费用	98,507.60
合计	125,990.51

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈盈润纯债债券 A

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	324,132,626.84	324,132,626.84
本期申购	675,715,523.82	675,715,523.82
本期赎回（以“-”号填列）	-357,866,565.89	-357,866,565.89
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	641,981,584.77	641,981,584.77

宝盈盈润纯债债券 E

项目	本期 2024 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	63,302,648.43	63,302,648.43
本期赎回（以“-”号填列）	-24,874,215.14	-24,874,215.14
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	38,428,433.29	38,428,433.29

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

宝盈盈润纯债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,673,240.90	3,294,437.12	12,967,678.02
本期期初	9,673,240.90	3,294,437.12	12,967,678.02

本期利润	4,793,731.03	2,790,794.85	7,584,525.88
本期基金份额交易产生的变动数	15,146,357.11	1,375,919.22	16,522,276.33
其中：基金申购款	27,514,978.95	4,173,932.47	31,688,911.42
基金赎回款	-12,368,621.84	-2,798,013.25	-15,166,635.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,613,329.04	7,461,151.19	37,074,480.23

宝盈盈润纯债债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	231,363.87	212,274.14	443,638.01
本期基金份额交易产生的变动数	1,524,307.65	234,509.83	1,758,817.48
其中：基金申购款	2,592,298.90	425,991.90	3,018,290.80
基金赎回款	-1,067,991.25	-191,482.07	-1,259,473.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,755,671.52	446,783.97	2,202,455.49

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		37,426.25
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		339.91
其他		13.75
合计		37,779.91

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

无。

6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,165,542.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	450,721.07
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	6,616,263.24

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	399,094,847.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	393,222,659.30
减：应计利息总额	5,402,164.49
减：交易费用	19,302.50
买卖债券差价收入	450,721.07

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

无。

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	3,003,068.99
股票投资	-
债券投资	3,003,068.99
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	3,003,068.99

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	52,619.39
基金转换费收入	3.98
合计	52,623.37

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	15,897.18
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	124,004.78

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

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系以及其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人
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 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
当期发生的基金应支付的管理费	584,138.28	553,259.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	253,419.16	62,523.45
应支付基金管理人的净管理费	330,719.12	490,735.95

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 0.30% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	194,712.75	184,419.85

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 2024年1月1日至2024年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E	合计
宝盈基金	-	15.39	15.39
光大银行	-	-	-
合计	-	15.39	15.39
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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		
	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金 E 类份额的基金资产净值 0.1% 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 E 类份额的基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

光大银行	7,380,941.53	37,426.25	4,018,804.78	26,407.23
------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，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

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的余额为 176,044,204.54 元。正回购交易中作为抵押的债券如下：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012400340	24 厦门资产 SCP002	2024 年 7 月 1 日	100.60	100,000	10,060,123.29
012481750	24 津渤海 SCP008	2024 年 7 月 1 日	100.20	100,000	10,020,438.36
042480118	24 云建投 CP001	2024 年 7 月 1 日	101.04	72,000	7,274,626.72
092302002	23 国开清发 02	2024 年 7 月 1 日	105.65	100,000	10,565,336.07
102481075	24 萍乡创新 MTN001	2024 年 7 月 1 日	103.34	50,000	5,167,186.30
240205	24 国开 05	2024 年 7 月 1 日	103.94	32,000	3,326,000.44
230019	23 付息国债 19	2024 年 7 月 3 日	104.98	300,000	31,494,032.79
230208	23 国开 08	2024 年 7 月 3 日	102.20	200,000	20,439,090.41
240006	24 付息国债	2024 年 7 月 3 日	101.71	27,000	2,746,228.44

	06	日			
2028022	20 民生银行 二级	2024 年 7 月 4 日	102.44	179,000	18,336,122.47
2128030	21 交通银行 二级	2024 年 7 月 4 日	106.17	200,000	21,233,584.70
2028022	20 民生银行 二级	2024 年 7 月 5 日	102.44	95,000	9,731,461.64
2028041	20 工商银行 二级 01	2024 年 7 月 5 日	105.86	400,000	42,343,868.85
合计				1,855,000	192,738,100.48

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

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。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债券、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券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光大银行，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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	288,083,233.87	191,082,494.54
合计	288,083,233.87	191,082,494.54

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,740,415.61	-
合计	14,740,415.61	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构。

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	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	305,419,416.38	50,537,010.07
AAA 以下	16,794,939.23	-
未评级	264,566,910.44	91,928,352.31
合计	586,781,266.05	142,465,362.38

注：未评级部分为国债、政策性金融债，中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%（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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，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 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	7,380,941.53	-	-	-	7,380,941.53
存出保证金	2,343.12	-	-	-	2,343.12
交易性金融资产	404,954,875.53	411,854,486.89	72,795,553.11	-	889,604,915.53
应收申购款	-	-	-	5,354,807.07	5,354,807.07
应收清算款	-	-	-	840,000.00	840,000.00
资产总计	412,338,160.18	411,854,486.89	72,795,553.11	6,194,807.07	903,183,007.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,771,765.69	3,771,765.69
应付管理人报酬	-	-	-	167,674.97	167,674.97
应付托管费	-	-	-	55,891.66	55,891.66
应付清算款	-	-	-	3,300,812.35	3,300,812.35
卖出回购金融资产款	176,044,204.54	-	-	-	176,044,204.54

应付销售服务费	-	-	-	3,388.09	3,388.09
应交税费	-	-	-	26,325.66	26,325.66
其他负债	-	-	-	125,990.51	125,990.51
负债总计	176,044,204.54	-	-	7,451,848.93	183,496,053.47
利率敏感度缺口	236,293,955.64	411,854,486.89	72,795,553.11	-1,257,041.86	719,686,953.78
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	3,932,417.22	-	-	-	3,932,417.22
交易性金融资产	283,010,846.85	50,537,010.07	-	-	333,547,856.92
资产总计	286,943,264.07	50,537,010.07	-	-	337,480,274.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	38,240.11	38,240.11
应付管理人报酬	-	-	-	85,699.38	85,699.38
应付托管费	-	-	-	28,566.44	28,566.44
应交税费	-	-	-	33,551.32	33,551.32
其他负债	-	-	-	193,912.03	193,912.03
负债总计	-	-	-	379,969.28	379,969.28
利率敏感度缺口	286,943,264.07	50,537,010.07	-	-379,969.28	337,100,304.86

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
1. 市场利率下降 25 个基点	4,391,814.04	576,642.57	
2. 市场利率上升 25 个基点	-4,288,870.03	-573,974.47	

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有权益类资产。(2023 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14 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	-	-
第二层次	889,604,915.53	333,547,856.92
第三层次	-	-
合计	889,604,915.53	333,547,856.92

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。

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。

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

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	889,604,915.53	98.50
	其中：债券	889,604,915.53	98.50
	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	7,380,941.53	0.82
8	其他各项资产	6,197,150.19	0.69
9	合计	903,183,007.25	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

根据基金合同约定，本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

根据基金合同约定，本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

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

根据基金合同约定，本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	66,492,503.61	9.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	188,978,409.53	26.26
	其中：政策性金融债	97,499,925.69	13.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	247,948,530.06	34.45
6	中期票据	171,806,061.88	23.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	14,740,415.61	2.05
9	其他	199,638,994.84	27.74
10	合计	889,604,915.53	123.61

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	2028041	20 工商银行二级 01	400,000	42,343,868.85	5.88
2	230019	23 付息国债 19	300,000	31,494,032.79	4.38
3	240203	24 国开 03	300,000	30,623,081.97	4.26
4	2420013	24 北京银行 01	300,000	30,471,976.44	4.23
5	2028022	20 民生银行二级	280,000	28,682,202.74	3.99

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

根据基金合同约定，本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除 23 平安银行小微债、24 北京银行 01、20 民生银行二级、22 中国银行二级 01 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2023 年 7 月 7 日，中国人民银行银罚决字〔2023〕55 号显示，平安银行股份有限公司被罚款 3492 万元。主要违法违规类型包括：1. 违反账户管理规定；2. 其他危及支付机构稳健运行、损害客户合法权益或危害支付服务市场的违法违规行为；3. 违反反假货币业务管理规定；4. 占压财政存款或资金；5. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；6. 未按规定履行客户身份识别义务；7. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；8. 与身份不明的客户进行交易；9. 违反消费者金融信息保护管理规定；10. 违反金融营销宣传管理规定。

2023 年 12 月 4 日，根据鄂银罚决字〔2023〕8 号，平安银行股份有限公司武汉分行被中国人民银行湖北省分行警告且罚款 47 万元，违法行为类型包括擅自代理金融消费者办理业务、违反金融营销宣传管理规定、未按要求对金融消费者投诉进行正确分类、漏报投诉数据、未按要求使用格式条款等。

2024 年 5 月 17 日，国家金融监督管理总局网站发布的金罚决字〔2024〕6 号行政处罚决定书显示，平安银行存在五大违法违规事实。一、治理与内部控制方面，包括个别高管人员未经任职资格核准实际履职，同一股东实质提名董事超比例，部分岗位绩效薪酬延期支付比例低于监管要求，未按监管规定审查审批重大关联交易等。二、信贷业务方面，包括向关系人发放信用贷款，违规发放并购贷款、流动资金贷款、个人贷款，流动资金贷款、个人贷款用途不合规，授信责任认定后问责不到位等。三、同业业务方面，包括违规接受第三方金融机构信用担保，分支机构承担非标投资信用风险，通过同业投资掩盖资产损失、延缓风险暴露、提供土地储备融资，违规垫付某产品赎回资金，同业非标投资业务未计足风险加权资产，以贵金属产业基金模式融出资金违规用于股权投资等。四、理财业务方面，包括违规向理财产品提供融资、虚构风险缓释品、未计

提风险加权资产，代客理财资金用于本行自营业务，理财产品相互交易，理财产品信息披露不合规，理财投资“名股实债”类资产未计入非标债权类资产投资统计，结构性存款业务实质是“假结构”等。五、部分非现场监管统计数据与事实不符，银行承兑汇票保证金来源于贷款资金，未对投保人进行需求分析与风险承受能力测评等。依据相关法律法规，国家金融监督管理总局对平安银行做出行政处罚决定，没收违法所得并处罚款合计 6723.98 万元。

2024 年 2 月 8 日，国家金融监督管理总局北京监管局发布了行政处罚信息公开表京金罚决字（2024）3 号，北京银行存在 EAST 信贷业务数据漏报、EAST 投资业务数据漏报、EAST 理财业务数据漏报、EAST 系统数据与客户风险系统数据不一致、存款分户账流水数据漏报、总行与分行汇总期末余额数据不一致、对公存款分户账数据错报、对公信贷分户账数据错报、个人存款分户账明细记录数据错报、对监管通报问题整改不到位等主要违法违规事实。依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则。国家金融监督管理总局北京监管局对北京银行罚款合计 330 万元。

2023 年 8 月 18 日，据国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表显示，中国民生银行股份有限公司被罚款合计 4780 万元。其中，总行 4430 万元，分支机构 350 万元。主要违法违规事实包括：1、规避委托贷款监管，违规利用委托债权投资业务向企业融资；2、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款；3、对政府平台公司融资行为监控不力，导致政府债务增加；4、股权质押管理问题未整改；5、审计人员配备不足问题未整改；6、对相关案件未按照有关规定处置；7、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算；8、代销池业务模式整改不到位；9、违规开展综合财富管理代销业务整改不到位；10、个别贷款风险分类结果仍存在偏离，整改不到位；11、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回；12、部分正常资产转让问题整改不到位；13、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改；14、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位。

2023 年 12 月 1 日，中国人民银行银罚决字（2023）93 号显示，中国银行股份有限公司被罚款 3664 万元。主要违法违规类型包括：1. 违反账户管理规定；2. 违反清算管理规定；3. 违反商户管理规定；4. 违反备付金管理规定；5. 违反人民币反假有关规定；6. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；7. 未按规定履行客户身份识别义务；8. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；9. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；10. 与身份不明的客户进行交易；11. 违反金融营销宣传管理规定；12. 违反个人金融信息保护规定。

我们认为相关处罚措施对平安银行、北京银行、民生银行、中国银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对平安银行、北京银行、民生银行、中国银行的债券偿还影响很小。本基金投资 23 平安银行小微债、24 北京银行 01、20 民生银行二级、22 中国银行二级 01 的投资决策程

序符合公司投资制度的规定。

7.11.2 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。

7.11.3 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	2,343.12
2	应收清算款	840,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,354,807.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,197,150.19

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

根据基金合同约定，本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

7.11.6 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。

§ 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 (%)
宝盈盈润 纯债债券 A	40,577	15,821.32	8,874,565.91	1.38	633,107,018.86	98.62
宝盈盈润 纯债债券 E	3,059	12,562.42	-	-	38,428,433.29	100.00
合计	43,636	15,592.86	8,874,565.91	1.30	671,535,452.15	98.70

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	宝盈盈润纯债债券 A	8,987.15	0.0014
	宝盈盈润纯债债券 E	176.03	0.0005
	合计	9,163.18	0.0013

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	宝盈盈润纯债债券 A	0
	宝盈盈润纯债债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈盈润纯债债券 A	0
	宝盈盈润纯债债券 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E
基金合同生效日 (2019年8月16日) 基金份额总额	252,327,549.38	-
本报告期期初基金份额总额	324,132,626.84	-
本报告期基金总申购份额	675,715,523.82	63,302,648.43
减：本报告期基金总赎回份额	357,866,565.89	24,874,215.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	641,981,584.77	38,428,433.29
-------------	----------------	---------------

§ 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、汪元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 (%)	
中泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，财务状况良好，内控制度健全，在业内有良好的信誉。
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要。
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的信息服务；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
- (4) 本基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，并与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、本基金本报告期交易单元变更情况：

- (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 (%)
中泰证券	22,555,879.00	100.00	32,300,000.00	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	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金（宝盈盈润纯债债券 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	2024-06-29
2	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金（宝盈盈润纯债债券 E 份额）基金产	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2024-06-29

	品资料概要（更新）	网站	
3	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
4	关于增加平安证券股份有限公司为宝盈盈润纯债债券型证券投资基金（E类）代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20
5	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
6	宝盈基金管理有限公司关于增加邮储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	2024-05-28
7	宝盈基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为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	2024-05-08
8	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
9	宝盈基金管理有限公司关于宝盈盈润纯债债券型证券投资基金增加代销机构的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-25
10	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 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
11	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
12	宝盈盈润纯债债券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	2024-04-03
13	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金（宝盈盈润纯债债券 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	2024-04-03
14	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金	本基金管理人网站, 中	2024-04-03

	(宝盈盈润纯债债券 E 份额) 基金产品资料概要 (更新)	国证监会基金电子披露网站	
15	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-02
16	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 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
17	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
18	宝盈基金管理有限公司关于宝盈盈润纯债债券型证券投资基金增加代销机构的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-27
19	宝盈盈润纯债债券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	2024-02-05
20	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金基金合同	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-05
21	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金托管协议	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-05
22	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 (宝盈盈润纯债债券 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	2024-02-05
23	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 (宝盈盈润纯债债券 E 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	2024-02-05
24	关于宝盈盈润纯债债券型证券投资基金增设 E 类基金份额的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-03
25	宝盈盈润纯债恢复申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
26	宝盈盈润纯债债券型证券投资基金 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
27	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
28	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	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报,	2024-01-16

	关费率优惠活动的公告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	
--	------------	-------------------------	--

§ 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	20240101-20240131	237,167,417.80	-	237,167,417.80	-	-
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

中国证监会准予宝盈盈润纯债债券型证券投资基金注册的文件。

《宝盈盈润纯债债券型证券投资基金基金合同》。

《宝盈盈润纯债债券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: 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

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