

宝盈国证证券龙头指数型发起式
证券投资基金
2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 月 22 日

§1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈国证证券龙头指数发起式
基金主代码	015859
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 12 日
报告期末基金份额总额	167,017,235.30 份
投资目标	本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制策略进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。
业绩比较基准	国证证券龙头指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	宝盈国证证券龙头指数发起 宝盈国证证券龙头指数发起

	式 A	式 C
下属分级基金的交易代码	015859	015860
报告期末下属分级基金的份额总额	45,891,421.81 份	121,125,813.49 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）	
	宝盈国证证券龙头指数发起式 A	宝盈国证证券龙头指数发起式 C
1. 本期已实现收益	2,880,114.83	7,861,835.58
2. 本期利润	-389,428.18	-4,419,452.56
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0083	-0.0326
4. 期末基金资产净值	58,213,264.55	152,716,529.34
5. 期末基金份额净值	1.2685	1.2608

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈国证证券龙头指数发起式 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	3.21%	2.45%	3.92%	2.73%	-0.71%	-0.28%
过去六个月	47.24%	2.32%	45.26%	2.46%	1.98%	-0.14%
过去一年	30.10%	1.90%	28.09%	1.99%	2.01%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	26.85%	1.59%	18.97%	1.65%	7.88%	-0.06%

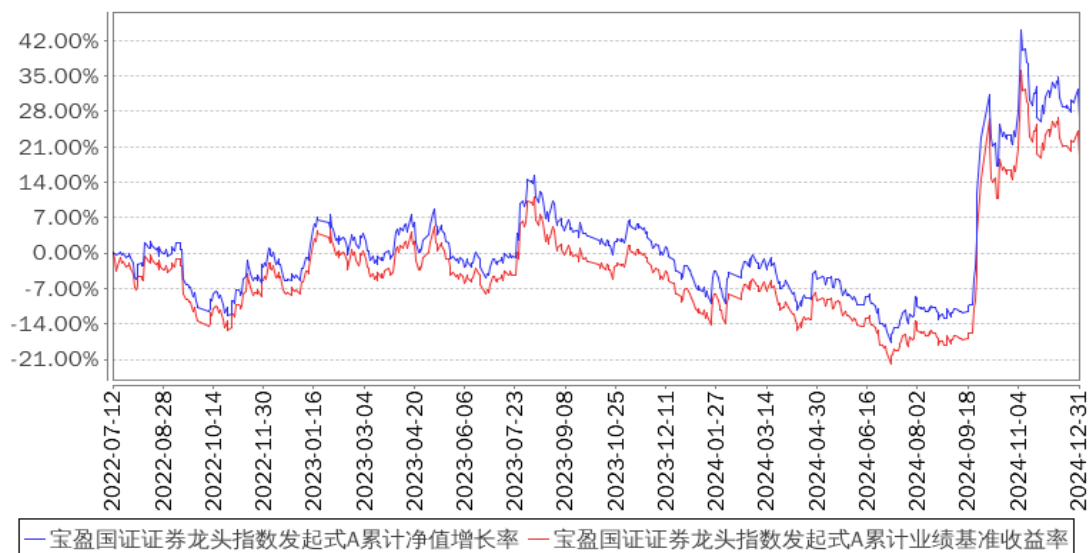
宝盈国证证券龙头指数发起式 C

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

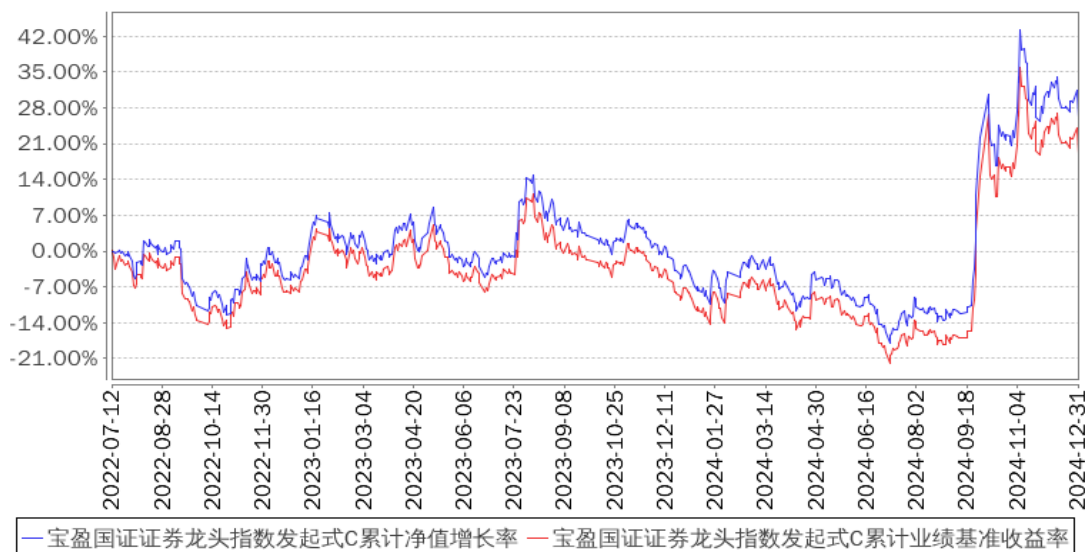
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	3.14%	2.45%	3.92%	2.73%	-0.78%	-0.28%
过去六个月	47.07%	2.32%	45.26%	2.46%	1.81%	-0.14%
过去一年	29.79%	1.90%	28.09%	1.99%	1.70%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	26.08%	1.59%	18.97%	1.65%	7.11%	-0.06%

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

宝盈国证证券龙头指数发起式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



宝盈国证证券龙头指数发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		说明
		任职日期	离任日期	
蔡丹	本基金、宝盈中证 A100 指数增强型证券投资基金、宝盈宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈华证龙头红利 50 指数型发起式证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金经理；量化投资部总经理	2022 年 7 月 12 日	-	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年以来，中国证监会采取了一系列政策措施，旨在提升上市公司的质量标准，同时对证券行业的运作模式进行规范。这些政策的核心在于确保上市公司的透明度和合规性，以及提升证券行业的整体服务水平和监管效率。这些措施也强调了对投资者权益的保护，特别是在财务诚信、股份减持、分红等方面。

2024 年前三季度，上市券商归母净利润合计 1018 亿元，同比下降 6.1%，主要受到上半年业绩低迷的影响。年化 ROE 为 5.5%，较 2023 年同期下滑 0.7%，整体 ROE 水平小幅下降，显示行业整体盈利能力有所承压。从收入结构来看，券商业务仍保持多元化发展格局，自营、经纪、资管、信用和投行业务继续居营收贡献前五位。

财报数据显示，证券行业集中度显著提升。归母净利润角度，2024 年前三季度，头部前 5 家上市券商贡献了整体 52.1% 的归母净利润，较 2023 年同期提升 8.1%；调整后营业收入角度，头部前 5 家券商贡献了整体 41.6% 的调整后营收，呈现“强者恒强”的局面。

本季度，国证证券龙头指数上涨 4.00%，截止本季末指数的最新 PB 为 1.53 倍，位于历史以

来 37.38%的分位数水平，估值仍处于历史均值水平之下。报告期内本基金以复制指数的被动策略为主，用量化方法来跟踪和控制偏离度，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

9 月以来政策端通过一系列组合拳稳定市场预期，12 月 9 日政治局会议明确货币政策“适度宽松”。在 9.24 组合拳后，市场交投活跃，本季度两市日均成交 1.82 万亿，是上个季度的 2.7 倍，10 月 8 日当天两市成交达到 3.45 万亿，创历史新高。展望下一季度，“提振资本市场”和“稳住股市楼市”的优化政策预计持续推出，将对资本市场形成支撑。对于证券行业自身而言，我们认为，优化资本市场环境、规范各类参与主体行为仍是未来一段时期的监管主线，但宏观政策大概率是积极的，证券行业有望借资本市场复苏东风实现业绩改善和估值修复。从行业内部来看，行业集中度提升叠加供给侧改革深化，龙头券商在资源整合、业务创新及政策支持等多方面受益，龙头券商盈利能力与市场竞争力有望进一步增强。

我们将严格按照基金合同的规定，在严格控制与基准指数偏离的基础上，依托我们的定量跟踪体系，来做好本基金的管理工作，尽力为投资者提供更便捷的、更有效的投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈国证证券龙头指数发起式 A 的基金份额净值为 1.2685 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.21%；截至本报告期末宝盈国证证券龙头指数发起式 C 的基金份额净值为 1.2608 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.14%。同期业绩比较基准收益率为 3.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且报告期内成立未满三年，不存在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要求。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	198,544,340.72	91.69
	其中：股票	198,544,340.72	91.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,050,535.89	1.87
	其中：债券	4,050,535.89	1.87
	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	10,242,482.45	4.73
8	其他资产	3,698,224.28	1.71
9	合计	216,535,583.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	198,409,152.20	94.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	198,409,152.20	94.06

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	99,972.30	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,444.48	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	13,022.00	0.01

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,604.60	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,145.14	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	135,188.52	0.06

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	1,135,040	29,306,732.80	13.89
2	600030	中信证券	739,100	21,559,547.00	10.22
3	600999	招商证券	965,700	18,502,812.00	8.77
4	601688	华泰证券	965,800	16,988,422.00	8.05
5	600958	东方证券	1,433,800	15,140,928.00	7.18
6	000776	广发证券	873,900	14,165,919.00	6.72
7	600837	海通证券	1,162,400	12,925,888.00	6.13
8	601377	兴业证券	1,951,140	12,214,136.40	5.79
9	601788	光大证券	427,500	7,742,025.00	3.67
10	601211	国泰君安	362,100	6,753,165.00	3.20

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603072	天和磁材	1,984	24,403.20	0.01
2	301622	英思特	306	13,745.52	0.01
3	001391	国货航	1,915	13,022.00	0.01
4	688615	合合信息	70	11,604.60	0.01
5	688721	龙图光罩	189	10,744.65	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,050,535.89	1.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,050,535.89	1.92

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	40,000	4,050,535.89	1.92

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险和流动性风险，改善组合的风险收益特性。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除海通证券、中信证券、招商证券、兴业证券、东方证券的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2024 年 4 月 30 日，据证中国证监会(2024)45 号显示，因海通证券在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，中国证监会根据《证券法》第一百八十六条及第一百九十七条第二款的规定没收海通证券违法所得 789,445.21 元，并对海通证券处以 6,975,000 元罚款。

2024 年 9 月 4 日，据深证函(2024)556 号，海通证券存在 1. 未充分关注并审慎核查发行人业务推广相关内部控制薄弱环节及部分推广活动验收存在瑕疵的情形；2. 资金流水核查取证不充分；3. 对终端客户走访、视频访谈程序不到位的情形，深圳证券交易所依据《审核规则》第七十二条、第七十四条的规定决定对海通证券采取书面警示的自律监管措施。

2024 年 4 月 30 日，据证中国证监会(2024)45 号显示，因中信证券在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，中国证监会根据《证券法》第一百八十六条及第一百九十七条第二款的规定没收中信证券违法所得 1,910,680.83 元，并对中信证券处以 23,250,000 元罚款。

2024 年 8 月 5 日，根据行政监管措施决定书(2024)26 号显示，中信证券因保荐的贵州安达科技能源股份有限公司上市当年即亏损，根据《证券发行上市保荐业务管理办法》(证监会令第

207 号)第七十条第一款第(二)项规定,中国证券监督管理委员会贵州监管局决定对中信证券采取出具警示函的措施。

2024 年 8 月 13 日,根据行政监管措施决定书(2024)166 号显示,招商证券存在在从事投资银行类业务过程中,部分投行项目持续督导工作存在督导上市公司规范运作力度不足,对于其他证券服务机构专业意见的审慎运用及独立核查不够,底稿不完善等问题。上述情形违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》(证监会令第 137 号)第三十一条、第三十七条第三款,《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》(证监会令第 54 号)第三十一条第二款、第三十三条第二款。根据《证券发行上市保荐业务管理办法》第六十二条、《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》第三十九条第一款的规定。深圳证监局决定对招商证券采取出具警示函的监管措施。

2024 年 8 月 2 日,根据行政监管措施决定书(2024)63 号显示,兴业证券存在对员工及配偶、利害关系人投资行为监控不到位,个别员工违规利用未公开信息交易股票的问题,违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》(证监会令第 166 号,以下简称《合规管理办法》)第三条、第六条第四项和第五项以及《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》(证监会令第 195 号,以下简称《从业人员监管办法》)第四十五条的规定,根据《合规管理办法》第三十二条第一款及《从业人员监管办法》第五十一条第一款的规定。福建证监局决定对兴业证券采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 7 月 11 日,根据沪证监决(2024)292 号显示,东方证券存在公司未妥善保存重要信息系统业务日志,不满足故障分析、调查取证等工作需要的问题,违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》(证监会令第 218 号)第十八条第二款的规定。中国证券监督管理委员会上海监管局决定采取出具警示函的行政监督措施。

我们认为当前处罚措施对海通证券、中信证券、招商证券、兴业证券、东方证券的正常经营影响相对可控。本基金投资海通证券、中信证券、招商证券、兴业证券、东方证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	3,698,224.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,698,224.28

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603072	天和磁材	24,403.20	0.01	新股流通受限
2	301622	英思特	13,745.52	0.01	新股流通受限
3	001391	国货航	13,022.00	0.01	新股流通受限
4	688615	合合信息	11,604.60	0.01	新股流通受限
5	688721	龙图光罩	10,744.65	0.01	新股流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈国证证券龙头指数发起式 A	宝盈国证证券龙头指数发起式 C
报告期期初基金份额总额	26,235,000.56	82,240,532.36
报告期期间基金总申购份额	63,041,327.50	327,489,980.64
减：报告期期间基金总赎回份额	43,384,906.25	288,604,699.51
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	45,891,421.81	121,125,813.49

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本	10,000,000.00
--------------	---------------

基金份额	
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.99

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	5.99	10,000,000.00	5.99	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	5.99	10,000,000.00	5.99	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金注册的文件。

《宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金基金合同》。

《宝盈国证证券龙头指数型发起式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。

10.2 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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

10.3 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

2025 年 1 月 22 日