

宝盈盈润纯债债券型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈盈润纯债债券
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
报告期末基金份额总额	623,445,784.47 份
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>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</p>

	与收益相匹配的品种进行投资。	
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。	
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	
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	593,503,984.97 份	29,941,799.50 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E
1. 本期已实现收益	5,875,171.30	336,274.45
2. 本期利润	-184,067.06	15,171.97
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0003	0.0004
4. 期末基金资产净值	627,420,140.03	31,629,854.88
5. 期末基金份额净值	1.0571	1.0564

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。

4、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	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	-0.07%	0.06%	1.16%	0.11%	-1.23%	-0.05%
过去六个月	1.25%	0.06%	2.95%	0.09%	-1.70%	-0.03%
过去一年	3.26%	0.05%	6.55%	0.08%	-3.29%	-0.03%
过去三年	14.39%	0.04%	15.32%	0.06%	-0.93%	-0.02%
过去五年	26.56%	0.05%	24.79%	0.07%	1.77%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	27.02%	0.05%	24.91%	0.07%	2.11%	-0.02%

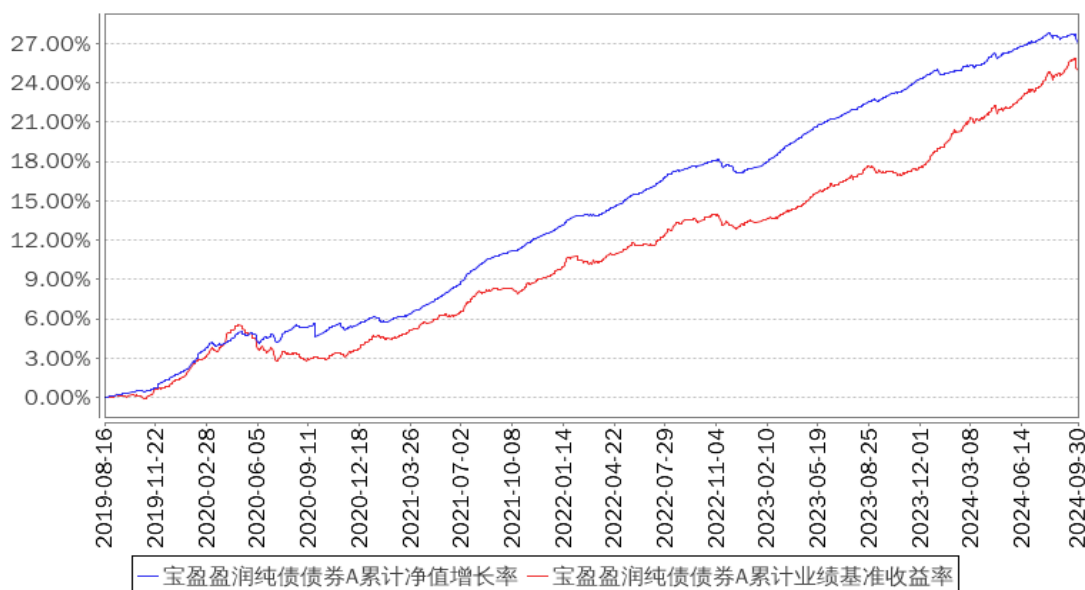
宝盈盈润纯债债券 E

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	-0.09%	0.06%	1.16%	0.11%	-1.25%	-0.05%
过去六个月	1.21%	0.06%	2.95%	0.09%	-1.74%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	1.63%	0.05%	3.95%	0.09%	-2.32%	-0.04%

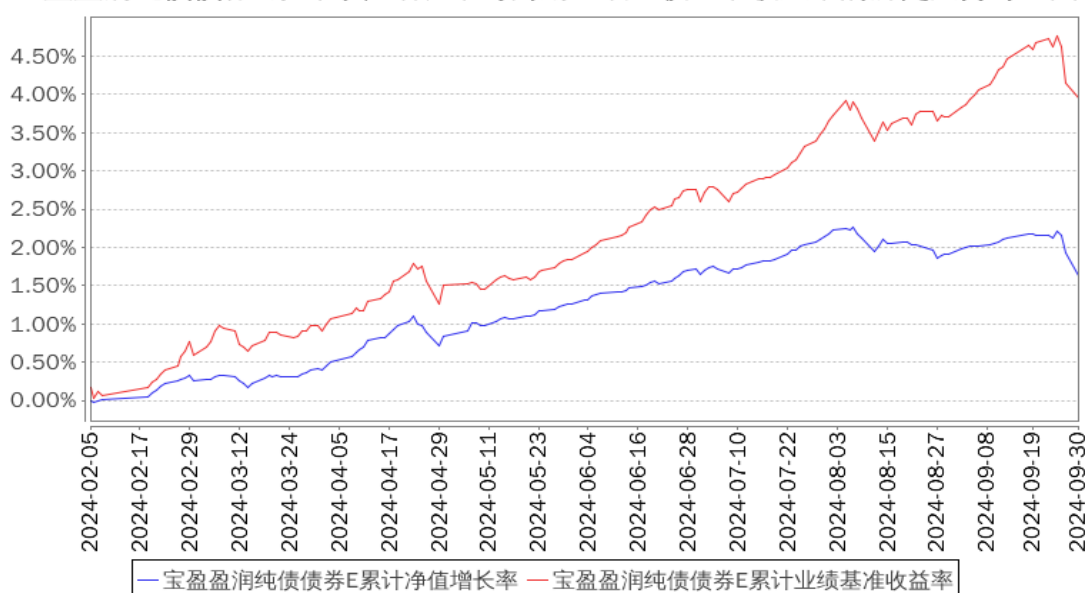
注：本基金于 2024 年 2 月 5 日起增加收取销售服务费的 E 类收费模式，其对应的基金份额简称为“宝盈盈润纯债债券 E”。

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	证券从	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
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		9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。

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

报告期内，美联储开启降息周期，海外货币政策正式转松。国内经济仍较疲弱，房地产销售和投资同比跌幅较大，稳增长促消费政策不断出台，加大经济托底力度，权益市场情绪好转。国

内货币政策保持了支持性，公开市场操作利率下调 20bp，降准 0.5 个百分点，并推动下调存量房贷利率等政策支持。债券市场方面，收益率整体下行幅度较大，1 年期国债于季度末收于 1.37% 左右，较上季度末下行 17bp；10 年期国债于季度末收于 2.15% 左右，较上季度下行 5bp。

报告期内，本基金进行了部分利率债交易，小幅拉长组合久期。

4.5 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 1.0571 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.07%；截至本报告期末宝盈盈润纯债债券 E 的基金份额净值为 1.0564 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.09%。同期业绩比较基准收益率为 1.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	854,093,170.43	99.32
	其中：债券	854,093,170.43	99.32
	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	4,166,360.94	0.48
8	其他资产	1,701,120.86	0.20
9	合计	859,960,652.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	23,667,161.49	3.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	148,847,282.51	22.59
	其中：政策性金融债	77,462,098.41	11.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	202,360,404.25	30.70
6	中期票据	268,662,875.95	40.77
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	44,456,760.76	6.75
9	其他	166,098,685.47	25.20
10	合计	854,093,170.43	129.59

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	2028041	20工商银行二级01	400,000	40,797,775.34	6.19
2	240205	24国开05	300,000	31,511,581.97	4.78
3	2420013	24北京银行01	300,000	30,570,974.79	4.64
4	112410148	24兴业银行CD148	300,000	29,639,839.23	4.50
5	2028022	20民生银行二级	280,000	28,577,528.77	4.34

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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 24 北京银行 01、22 中国银行二级 01、23 平安银行小微债的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

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 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。

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。

我们认为相关处罚措施对北京银行、中国银行、平安银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对北京银行、中国银行、平安银行的债券偿还影响很小。本基金投资 24 北京银行 01、22 中国银行二级 01、23 平安银行小微债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.10.2 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

本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,554.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,699,566.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,701,120.86

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 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	宝盈盈润纯债债券 A	宝盈盈润纯债债券 E
报告期期初基金份额总额	641,981,584.77	38,428,433.29
报告期期间基金总申购份额	200,583,123.82	31,214,983.80
减：报告期期间基金总赎回份额	249,060,723.62	39,701,617.59
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	593,503,984.97	29,941,799.50

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈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。

9.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

9.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日