

宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 | 宝盈科技 30 混合 |
| 基金主代码 | 000698 |
| 交易代码 | 000698 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 8 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 320,447,235.71 份 |
| 投资目标 | 本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于以科技创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40% |
| 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。 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§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） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -17,214,114.11 |
| 2. 本期利润 | 114,188,952.38 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.3554 |
| 4. 期末基金资产净值 | 893,221,545.09 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.787 |

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。

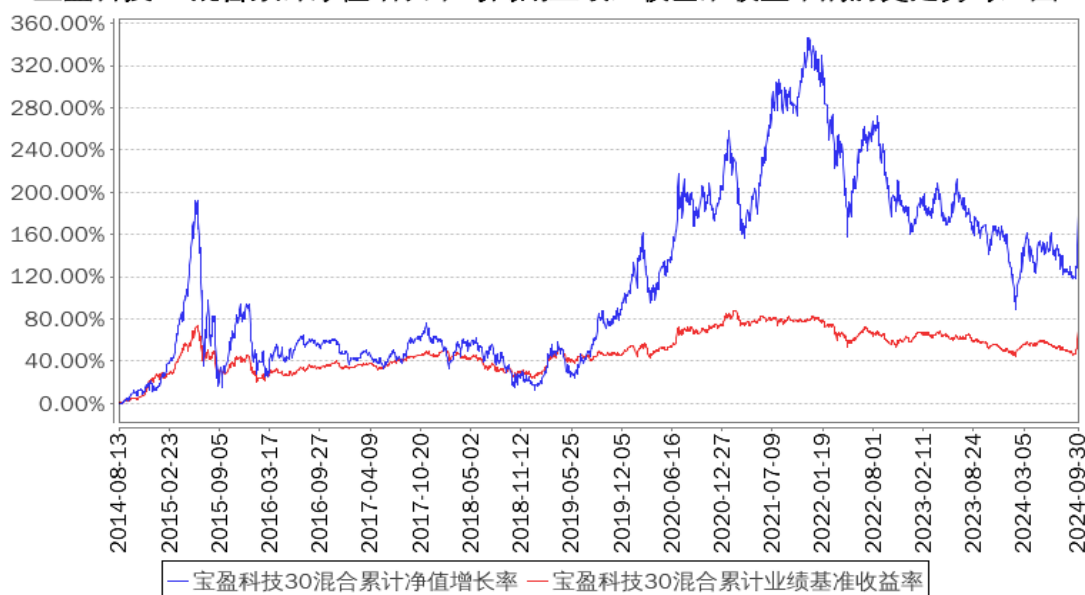
3.2 基金净值表现

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

| 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 | 14.69% | 2.29% | 10.10% | 0.98% | 4.59% | 1.31% |
| 过去六个月 | 14.17% | 2.02% | 8.74% | 0.78% | 5.43% | 1.24% |
| 过去一年 | 4.03% | 2.04% | 7.09% | 0.70% | -3.06% | 1.34% |
| 过去三年 | -27.46% | 1.89% | -4.99% | 0.66% | -22.47% | 1.23% |
| 过去五年 | 59.26% | 1.95% | 16.60% | 0.70% | 42.66% | 1.25% |
| 自基金合同 生效起至今 | 178.70% | 2.05% | 68.99% | 0.84% | 109.71% | 1.21% |

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

宝盈科技30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



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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 朱建明 | 本基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、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基金经理；投资经理；权益投资部副总经理（主持工作） | 2023年4月15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。 |

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

| 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 | 3,292,022,999.89 | 2017年01月05日 |
| | 私募资产管理计划 | 2 | 172,203,693.62 | 2014年08月18日 |

| | | | |
|------|---|------------------|---|
| 其他组合 | - | - | - |
| 合计 | 7 | 3,464,226,693.51 | - |

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

经历了三个季度连续下跌后，政府出台了强力刺激政策，具体来说，9月24日上午，国务院新闻办公室举行新闻发布会，中国人民银行行长潘功胜、国家金融监督管理总局局长李云泽、中国证券监督管理委员会主席吴清介绍金融支持经济高质量发展有关情况，会上宣布了总量政策三箭齐发，降准降息和房贷利率同步调降，同时央行首次创立两项结构性货币政策工具用来支持资本市场，一是创设证券、基金、保险公司互换便利，提高金融机构的资产流动性和股票增持能力；二是创设股票增持回购再贷款，支持上市公司回购和增持股票。紧接着9月26日政治局会议又指出“降低存量房贷利率”、“要促进房地产市场止跌回稳”、“降低存款准备金率，实施有力度的降息”，直指消费、房地产、信贷等当前宏观面三大关键环节，会议同时要求各地区各部门要认真贯彻落实党中央决策部署，干字当头、众志成城，充分激发全社会推动高质量发展的积极性主动性创造性，推动经济持续回升向好。会议也重点指出要努力提振资本市场，大力引导中长期

资金入市，打通社保、保险、理财等资金入市堵点，支持上市公司并购重组，稳步推进公募基金改革，研究出台保护中小投资者的政策措施。总而言之，高层已经充分意识到经济下行压力，意图采取强有力的措施稳住房价，提振股市，通过促进财富效应汇聚信心，防止陷入资产负债表通缩的螺旋。股票市场对此反应积极正面，出现一轮较集中的反弹，以 9 月 30 日较 23 日的变化衡量，上证指数、沪深 300 指数、科创 50 指数、创业板指数上涨幅度分别为 21.4%、25.1%、35.7%、42.1%。

我们的投资理念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，我们的持股周期较长，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，持仓仍然集中于 AI、电动车、机器人、新材料与新制造上。上个季度我们提出自己的“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，三季度我们仍然继续坚定持有北美算力供应链公司，如光模块、PCB 与服务器代工龙头，同时布局了机器人、电动车和新制造等成长细分龙头，哑铃的另一端是经过供给格局相对较好的低估值行业龙头，主要集中在化工、有色、新能源和资源上，他们的特点是行业供给相对出清，一旦经济动能向上，将迎来较大的业绩弹性。总体来说，三季度我们操作较少，静静等待政策与市场拐点的到来。

展望未来，我们认为目前是较好的政策时间窗口，一方面，海外迎来“降息+软着陆+汇率压力下降”的组合，有利于我们政策腾挪，另一方面，资本市场经历三年熊市估值较低，提振资本市场对于吸引超额储蓄、引导资源合理配置、促进消费回暖意义重大。经历一轮地方债务化解集中防风险后，适当宽松刺激也扩大了地方政府解决经济问题的弹性和主观能动性，因此，积极回应社会关切，调动各个阶层的力量促进资产价格回升与经济回暖，是政策的应有之义，随着后续一揽子增量宽松政策的陆续出台，我们对股票市场的健康发展抱有较强信心。

4.5 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 2.787 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.69%，业绩比较基准收益率为 10.10%。

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 | 828,717,043.78 | 92.59 |
| | 其中：股票 | 828,717,043.78 | 92.59 |
| 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 | 64,898,799.24 | 7.25 |
| 8 | 其他资产 | 1,382,423.59 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 894,998,266.61 | 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

| 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 | 28,484,916.00 | 3.19 |
| C | 制造业 | 760,108,042.07 | 85.10 |
| 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 | 40,019,137.19 | 4.48 |
| 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 | 104,948.52 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 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 | 828,717,043.78 | 92.78 |

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

| 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 | 300502 | 新易盛 | 666,200 | 86,586,014.00 | 9.69 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 321,863 | 81,074,071.07 | 9.08 |
| 3 | 300037 | 新宙邦 | 1,993,720 | 81,044,718.00 | 9.07 |
| 4 | 002463 | 沪电股份 | 1,922,900 | 77,223,664.00 | 8.65 |
| 5 | 601138 | 工业富联 | 2,804,700 | 70,650,393.00 | 7.91 |
| 6 | 601689 | 拓普集团 | 1,319,445 | 61,037,525.70 | 6.83 |
| 7 | 600114 | 东睦股份 | 3,704,400 | 59,974,236.00 | 6.71 |
| 8 | 300476 | 胜宏科技 | 1,258,300 | 49,954,510.00 | 5.59 |
| 9 | 688270 | 臻镭科技 | 1,646,784 | 45,517,109.76 | 5.10 |
| 10 | 688279 | 峰岬科技 | 275,483 | 37,462,933.17 | 4.19 |

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

5.10.2 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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未受到公开谴责、处罚。

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 | 155,219.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,227,203.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,382,423.59 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 319,673,601.41 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,480,484.19 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 7,706,849.89 |
| 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 | 320,447,235.71 |

§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

中国证监会批准宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

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