

宝盈祥瑞定期开放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	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈祥颐定期开放混合	
基金主代码	006398	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 20 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	230,842,850.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈祥颐定期开放混合 A	宝盈祥颐定期开放混合 C
下属分级基金的交易代码	006398	006399
报告期末下属分级基金的份额总额	213,455,859.31 份	17,386,990.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金采取稳健的投资策略，在控制下行风险的前提下，确定大类资产配置比例，通过债券、货币市场工具等固定收益类资产投资获取稳定收益，适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金的投资策略由大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略和存托凭证投资策略五个部分组成。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等收益/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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张磊
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com
		许俊
		010-66596688
		fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	400-8888-300	95566
传真	0755-83515599	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码	518034	100818
法定代表人	严震	葛海蛟

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	基金管理人办公场所、基金托管人住所

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)	
	宝盈祥颐定期开放混合 A	宝盈祥颐定期开放混合 C
本期已实现收益	4,862,783.68	349,693.06
本期利润	3,516,680.30	241,960.30
加权平均基金份额本期利润	0.0163	0.0137
本期加权平均净值利润率	1.52%	1.31%
本期基金份额净值增长率	1.57%	1.36%
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	706,927.28
	期末可供分配基金份额利润	0.0407

期末基金资产净值	229,994,000.37	18,341,873.28
期末基金份额净值	1.0775	1.0549
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	7.75%	5.49%

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

宝盈祥颐定期开放混合 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	-0.69%	0.24%	-0.31%	0.14%	-0.38%	0.10%
过去三个月	0.11%	0.26%	0.73%	0.21%	-0.62%	0.05%
过去六个月	1.57%	0.34%	3.38%	0.26%	-1.81%	0.08%
过去一年	-1.35%	0.33%	1.55%	0.25%	-2.90%	0.08%
过去三年	-8.76%	0.36%	-0.32%	0.31%	-8.44%	0.05%
自基金合同生效起至今	7.75%	0.30%	17.76%	0.34%	-10.01%	-0.04%

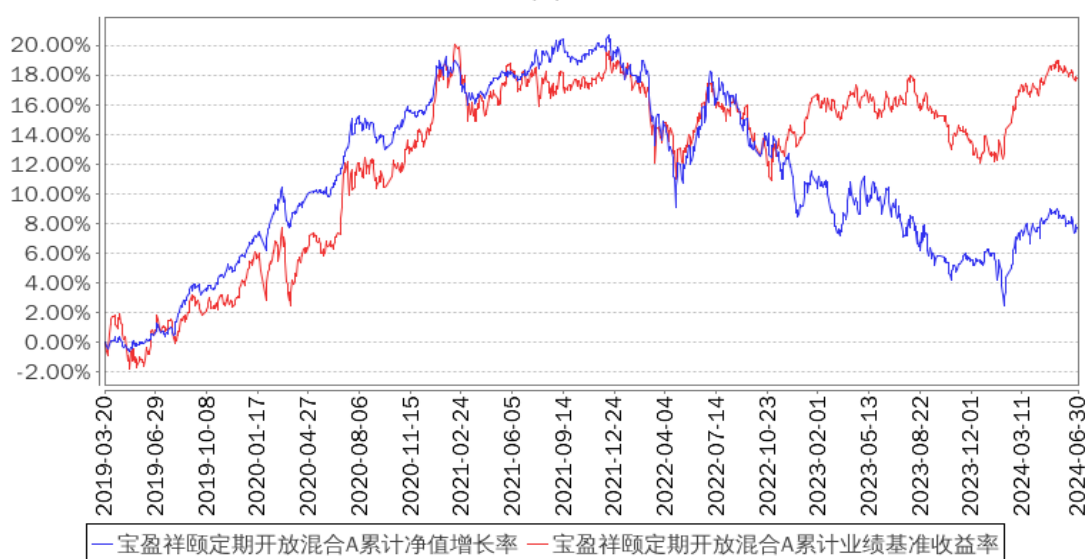
宝盈祥颐定期开放混合 C

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	-0.72%	0.24%	-0.31%	0.14%	-0.41%	0.10%
过去三个月	0.01%	0.26%	0.73%	0.21%	-0.72%	0.05%

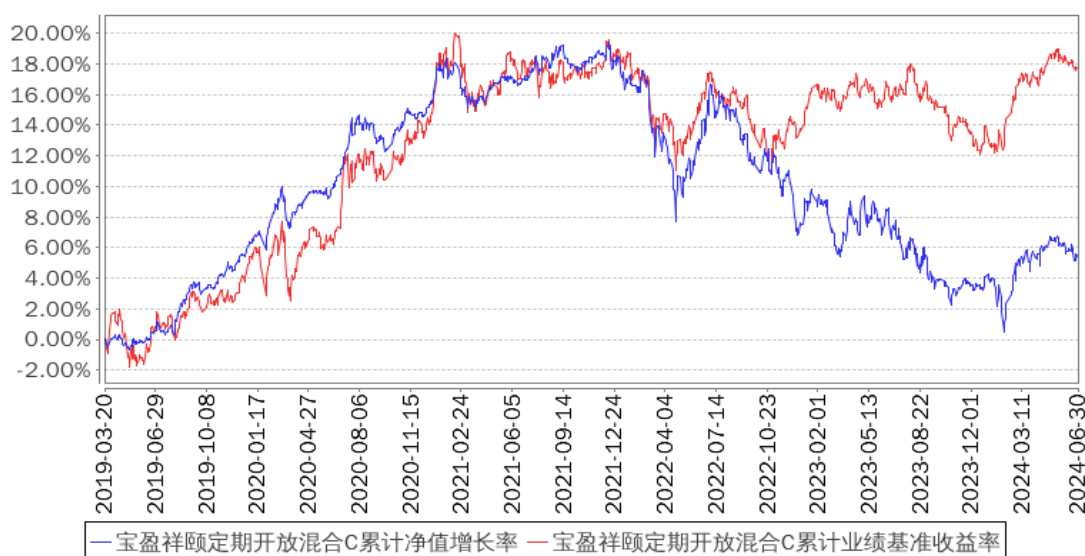
过去六个月	1.36%	0.34%	3.38%	0.26%	-2.02%	0.08%
过去一年	-1.75%	0.33%	1.55%	0.25%	-3.30%	0.08%
过去三年	-9.85%	0.36%	-0.32%	0.31%	-9.53%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.49%	0.30%	17.76%	0.34%	-12.27%	-0.04%

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

宝盈祥颐定期开放混合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



宝盈祥颐定期开放混合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



§ 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	
吕姝仪	本基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金、宝盈祥泽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、宝盈祥乐一年持有期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、宝盈祥琪混合型证券投资基金基金经理	2021 年 5 月 14 日	-	11 年	吕姝仪女士，中国人民大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2013 年 9 月在中山证券有限责任公司任投资经理助理，2013 年 10 月至 2015 年 9 月在民生加银基金管理有限公司任债券交易员，2015 年 9 月至 2017 年 12 月在东兴证券股份有限公司基金业务部任基金经理。2017 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
邓栋	本基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；固定收益部总经理	2019 年 3 月 30 日	-	14 年	邓栋先生，清华大学土木工程硕士。2008 年 3 月加入毕马威华振会计师事务所，担任审计师；自 2010 年 1 月至 2017 年 8 月在招商基金管理有限公司任职，先后担任固定收益投资部研究员、基金经理、固定收益投资部副总监；2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
蔡丹	本基金、宝盈中证 100 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、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、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	2023 年 9 月 26 日	-	13 年	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。

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

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，全球地缘政治风险升高，海外央行货币政策预期宽松，美联储引导美国经济安全着陆仍存在不确定性，外部环境更趋复杂严峻。国内经济运行总体平稳、稳中有进，高质量发展扎实推进，但仍面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战。宏观政策效应持续释放、外需回暖、新质生产力加速发展等因素形成了新的支撑。总体来看需求端还是偏弱，呈现生产偏强、需求偏弱的态势。

权益方面，A股年初下跌后弱势震荡，沪深300指数上涨0.89%，创业板指下跌10.99%。本产品的股票资产也有一定幅度的下跌。

债券方面，10年期国债收益率震荡下行，下行幅度35bp左右。1年期国债收益率下行幅度60bp左右，曲线变陡。本产品债券仓位稳中有降，债券组合的久期保持中高，杠杆水平中枢降低，获取了稳健的收益。

今年上半年 A 股波动放大，整体表现较弱：1 月下旬市场连续下跌，导致部分雪球产品敲入、私募产品的回撤及赎回、两融业务及股权质押的风险等进一步暴露，从而进一步影响市场流动性，在负反馈机制下市场出现了持续快速的下跌，大小盘风格极致分化，中小市值股票持续大幅回调。春节前监管层密集出台并发布加强融券业务监管、支持汇金增持、提升上市公司质量等相关举措，缓解了流动性风险，节后市场开始了一波明显的、快速的反弹，小盘、成长板块反弹力度更大。国内经济增长在一季度好于预期，上证指数 4 月到 5 月中旬有一波反弹，但 4-5 月的经济数据显示修复过程仍有波折，房地产市场没有见到明显的起色，部分金融数据呈现阶段性偏弱状态，叠加人民币汇率压力及海外地缘政治因素压制风险偏好，投资者信心修面临挑战，5 月下旬以来指数持续回调，6 月下旬上证综指跌破 3000 点，6 月底收于 2967.4 点，半年下跌 0.25%。

从宏观经济数据来看，2024 上半年我国 GDP 同比增长 5%，其中一季度增长 5.3%，二季度增长 4.7%。上半年，固定资产投资同比增长 3.9%，房地产开发投资下降 10.1%。从 6 月数据来看，经济整体仍呈现出外需好于内需，生产强于消费特征，6 月出口同比增速再创年内新高，但社会零售消费进一步走缓，房地产相关指标也仍有改善空间，显示宏观政策仍有待进一步发力。

从成交额来看，今年上半年日均成交额在 8561.82 亿，略高于上个半年的 8103.11 亿，但整体仍处于 2021 年下半年以来震荡回落走势中。10 年期美债利率从去年底的 3.88% 震荡攀升至 4.36%，二季度欧央行率先降息，导致美元指数被动升值，美元相对人民币升值 0.59% 至 7.2659，位于 2015 年以来 97.1% 的分位数，处于相对高位。从北向资金来看，去年下半年净流出 1396.1 亿后，今年上半年转为净流入 385.78 亿元。

从市场走势来看，今年上半年指数走势分化较大，大盘好于小盘，价值好于成长：中证 1000 下跌 16.84%，中证 500 下跌 8.96%，中证 800 下跌 1.76%，沪深 300 上涨 0.89%，上证 50 上涨 2.95%，中证红利上涨 7.75%。分行业来看，银行、煤炭、石油石化、家电和电力及公用事业涨幅排前，而综合、消费者服务、计算机、商贸零售、传媒和医药跌幅靠前。从价值成长风格来看，今年上半年价值风格远好于成长，国证价值上涨 9.93%，国证成长下跌 8.82%。

报告期内，本基金严格遵守基金合同约定，将绝大多数资产配置在固收类资产上，在股票组合构建上，本基金股票仓位采用定量方式来运作，我们基于自建的定量研究框架，采用定量方法来筛选高成长股票组合。今年上半年大小市值股票分化较为明显，中小市值股票跌幅较大，成长明显弱于价值。2024 年上半年本基金 A 份额期间最大回撤 3.58%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈祥颐定期开放混合 A 的基金份额净值为 1.0775 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.57%；截至本报告期末宝盈祥颐定期开放混合 C 的基金份额净值为 1.0549 元，本报

告期基金份额净值增长率为 1.36%。同期业绩比较基准收益率为 3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，政策积极发力，需要继续关注新质生产力相关的政策、财政货币政策及影响。资金面难言迅速收紧，市场对政策预期不高，债市调整空间较小。权益市场需要关注海外货币政策的边际变化、财政政策的力度等。

本基金债券部分将根据市场情况，优化持仓，继续以高评级债券为底仓。本基金将继续寻找优质公司的债权和股权的投资机会，力争为组合提供稳健的收益。

海外方面，美国大选进程受到全球投资者较高关注。6 月美国 CPI 进一步走弱，叠加鲍威尔的偏“鸽派”发言，市场对 9 月份的美联储降息预期升至 90%。特朗普遭枪击后支持率持续上升，近期降息交易和特朗普交易持续，呈现板块轮动行情，大科技承压资金净卖出，小盘和价值股受到追捧，市场波动放大。

国内来看，基本面处在弱修复进程中，上半年达成 5% 的 GDP 同比增速，但 6 月 3 大经济数据均边际下行，其中工业、投资高于预期，消费大幅回落，明显低于预期，宏观政策仍有待进一步发力。

7 月 18 日三中全会公报发布，三中全会短期强调稳增长，中长期强调制度建设，稳定投资者预期，展现出在经济、政治、法制、开放、民生等方向上的全方位、系统性改革部署。三中全会“分析了当前形势和任务，强调坚定不移实现全年经济社会发展目标”，提出“落实好宏观政策，积极扩大国内需求”，后续我们可以关注相关政策的落地情况。

展望后市，我们认为 2 月份以来的修复行情虽面临波折但并未结束，当前 A 股市场整体估值仍处于历史偏阶段性底部时期，当前指数风险溢价所隐含的 M1 同比下行预期或较为充分，伴随下半年稳增长政策加码结合中长期改革红利，以及美联储降息周期开启后美元下行，A 股整体估值修复空间有望打开。当前 A 股整体估值处于历史较低水平，估值风险已充分释放：截止 2024 年 7 月 19 日中证 800 指数的 PE 为 13.04 倍，位于历史以来 32.29% 分位数水平，最新股息率为 2.87%，整体估值中性偏低，处于中高赔率区间。中期来看，基本面震荡筑底，资金面有宽松预期，市场情绪震荡消化，政策积极乐观，市场底部有望在震荡行情中逐步稳固。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：宝盈祥颐定期开放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	397,556.75	176,661.59
结算备付金		5,773,726.55	3,346,487.13
存出保证金		20,399.05	59,241.71
交易性金融资产	6.4.7.2	287,161,549.13	416,092,383.27
其中：股票投资		41,368,367.64	54,516,912.98
基金投资		-	-
债券投资		245,793,181.49	361,575,470.29
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		835,090.42	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		294,188,321.90	419,674,773.70
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		45,381,806.12	133,243,941.87
应付清算款		-	4,910.47
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		204,101.71	241,211.36
应付托管费		40,820.36	48,242.27
应付销售服务费		6,030.88	7,431.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,625.37	15,581.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	218,063.81	441,112.47
负债合计		45,852,448.25	134,002,430.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	230,842,850.22	269,690,111.22
未分配利润	6.4.7.11	17,493,023.43	15,982,231.97
净资产合计		248,335,873.65	285,672,343.19
负债和净资产总计		294,188,321.90	419,674,773.70

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.0775 元，A 类基金份额 213,455,859.31 份；C 类基金份额净值人民币 1.0549 元，C 类基金份额 17,386,990.91 份；宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金份额总额合计为 230,842,850.22 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈祥颐定期开放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	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
一、营业总收入		6,467,480.88	3,572,566.83
1. 利息收入		41,158.84	30,689.77
其中：存款利息收入	6.4.7.12	41,158.84	30,689.77
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）		7,880,158.18	3,706,956.01
其中：股票投资收益	6.4.7.13	447,411.18	-1,090,279.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	6,934,043.27	4,291,574.19
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	498,703.73	505,661.47
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	-1,453,836.14	-165,078.95
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	-	-
减：二、营业总支出		2,708,840.28	3,542,412.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,241,451.02	1,877,736.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	248,290.23	375,547.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	36,786.56	55,111.17
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,054,896.50	1,111,835.45
其中：卖出回购金融资产支出		1,054,896.50	1,111,835.45
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		4,754.68	6,174.11
8. 其他费用	6.4.7.22	122,661.29	116,008.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,758,640.60	30,154.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,758,640.60	30,154.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,758,640.60	30,154.23

6.3 净资产变动表

会计主体：宝盈祥颐定期开放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	269,690,111.22	-	15,982,231.97	285,672,343.19
二、本期期初净资产	269,690,111.22	-	15,982,231.97	285,672,343.19

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-38,847,261.00	-	1,510,791.46	-37,336,469.54
(一)、综合收益总额	-	-	3,758,640.60	3,758,640.60
(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)	-38,847,261.00	-	-2,247,849.14	-41,095,110.14
其中：1. 基金申购款	54.62	-	2.85	57.47
2. 基金赎回款	-38,847,315.62	-	-2,247,851.99	-41,095,167.61
(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	230,842,850.22	-	17,493,023.43	248,335,873.65
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	345,461,937.24	-	31,358,136.78	376,820,074.02
二、本期期初净资产	345,461,937.24	-	31,358,136.78	376,820,074.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	30,154.23	30,154.23
(一)、综合收益总额	-	-	30,154.23	30,154.23
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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	345,461,937.24	-	31,388,291.01	376,850,228.25

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

宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金(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]第 1381 号《关于准予宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金注册的批复》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《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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 475,345,205.91 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 0169 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 475,557,489.60 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,283.69 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为定期开放式基金。封闭期为自基金合同生效日起(含)或者每一个开放期结束之日次日起(含)6 个月的期间。本基金自封闭期结束之日后第一个工作日起(含)进入五至二十个工作日的开放期,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。本基金封闭期内不办理申购、赎回及转换等业务,也不上市交易。

根据《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为宝盈祥颐定期

开放混合 A；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为宝盈祥颐定期开放混合 C。宝盈祥颐定期开放混合 A 和宝盈祥颐定期开放混合 C 分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有较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、可转换债券(含分离交易可转债纯债)、可交换债券等)、股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、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、货币市场工具、资产支持证券、权证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。基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 0% - 45%，开放期内，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；封闭期内，本基金不受前述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

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》、《宝盈祥颐定期开放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 2024 年 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

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期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	397,556.75
等于：本金	397,397.33
加：应计利息	159.42
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	397,556.75

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	45,544,685.68	-	41,368,367.64	-4,176,318.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市	73,217,882.50	978,884.40	74,745,184.40	548,417.50

	场				
	银行间市场	166,257,001.87	2,416,647.09	171,047,997.09	2,374,348.13
	合计	239,474,884.37	3,395,531.49	245,793,181.49	2,922,765.63
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		285,019,570.05	3,395,531.49	287,161,549.13	-1,253,552.41

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	119,556.21
其中：交易所市场	110,391.38
银行间市场	9,164.83
应付利息	-
预提费用	98,507.60
合计	218,063.81

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈祥瑞定期开放混合 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	248,552,030.63	248,552,030.63
本期申购	34.42	34.42
本期赎回（以“-”号填列）	-35,096,205.74	-35,096,205.74
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	213,455,859.31	213,455,859.31

宝盈祥瑞定期开放混合 C

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	21,138,080.59	21,138,080.59
本期申购	20.20	20.20

本期赎回（以“-”号填列）	-3,751,109.88	-3,751,109.88
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	17,386,990.91	17,386,990.91

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

宝盈祥瑞定期开放混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,973,282.25	5,148,615.16	15,121,897.41
本期期初	9,973,282.25	5,148,615.16	15,121,897.41
本期利润	4,862,783.68	-1,346,103.38	3,516,680.30
本期基金份额交易产生的变动数	-1,362,918.55	-737,518.10	-2,100,436.65
其中：基金申购款	1.33	0.72	2.05
基金赎回款	-1,362,919.88	-737,518.82	-2,100,438.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,473,147.38	3,064,993.68	16,538,141.06

宝盈祥瑞定期开放混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	427,833.21	432,501.35	860,334.56
本期期初	427,833.21	432,501.35	860,334.56
本期利润	349,693.06	-107,732.76	241,960.30
本期基金份额交易产生的变动数	-70,598.99	-76,813.50	-147,412.49
其中：基金申购款	0.38	0.42	0.80
基金赎回款	-70,599.37	-76,813.92	-147,413.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	706,927.28	247,955.09	954,882.37

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	4,485.95
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	36,386.35
其他	286.54
合计	41,158.84

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	447,411.18
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	447,411.18

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	133,080,134.62
减：卖出股票成本总额	132,309,633.21
减：交易费用	323,090.23
买卖股票差价收入	447,411.18

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	4,913,676.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,020,367.27
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	6,934,043.27

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	419,545,975.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	411,889,602.92

本总额	
减：应计利息总额	5,626,666.22
减：交易费用	9,338.96
买卖债券差价收入	2,020,367.27

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	498,703.73
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	498,703.73

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	-1,453,836.14
股票投资	-4,301,609.67
债券投资	2,847,773.53
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	-1,453,836.14

6.4.7.20 其他收入

无。

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	14,553.69
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	122,661.29

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	1,241,451.02	1,877,736.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	619,062.58	936,874.82
应支付基金管理人的净管理费	622,388.44	940,861.53

注：支付基金管理人宝盈基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×1.00%/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	248,290.23	375,547.25

注：支付基金托管人中国银行的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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		
	宝盈祥瑞定期开放混合	宝盈祥瑞定期开放混合	合计
	A	C	
宝盈基金	-	62.87	62.87
中国银行	-	35,172.73	35,172.73
合计	-	35,235.60	35,235.60
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		
	宝盈祥瑞定期开放混合	宝盈祥瑞定期开放混合	合计
	A	C	
宝盈基金	-	65.05	65.05
中国银行	-	53,112.86	53,112.86
合计	-	53,177.91	53,177.91

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日本基金 C 类份额的基金资产净值 0.4% 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 C 类份额的基金资产净值×0.4%/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
中国银行	397,556.75	4,485.95	3,785,908.17	13,778.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 41,014,724.67 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
2120062	21 宁波银行 二级 02	2024 年 7 月 2 日	106.65	100,000	10,664,551.91
2121062	21 北京农商 二级	2024 年 7 月 2 日	105.37	100,000	10,536,782.51
2128042	21 兴业银行 二级 02	2024 年 7 月 2 日	105.66	32,000	3,381,211.28
2128028	21 邮储银行 二级 01	2024 年 7 月 3 日	105.77	100,000	10,577,348.63
2228004	22 工商银行 二级 01	2024 年 7 月 3 日	104.36	100,000	10,435,861.20
合计				432,000	45,595,755.53

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,367,081.45 元，截至 2024 年 7 月 1 日到期，该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等收益/风险特征的基金。本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票(含存托凭证)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、权证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	509,006.58	36,564,699.01

合计	509,006.58	36,564,699.01
----	------------	---------------

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

无。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	197,139,276.07	292,777,611.35
AAA 以下	38,899,467.33	940,000.00
未评级	9,245,431.51	31,293,159.93
合计	245,284,174.91	325,010,771.28

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于约定开放日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于开放期内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》且于基金开放期内按照《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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，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%。

于开放期内，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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，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	397,556.75	-	-	-	397,556.75
结算备付金	5,773,726.55	-	-	-	5,773,726.55
存出保证金	20,399.05	-	-	-	20,399.05
交易性金融资产	11,539,195.21	234,253,986.28	-	41,368,367.64	287,161,549.13
应收清算款	-	-	-	835,090.42	835,090.42
资产总计	17,730,877.56	234,253,986.28	-	42,203,458.06	294,188,321.90
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	204,101.71	204,101.71
应付托管费	-	-	-	40,820.36	40,820.36
卖出回购金融资产款	45,381,806.12	-	-	-	45,381,806.12
应付销售服务费	-	-	-	6,030.88	6,030.88
应交税费	-	-	-	1,625.37	1,625.37
其他负债	-	-	-	218,063.81	218,063.81
负债总计	45,381,806.12	-	-	470,642.13	45,852,448.25
利率敏感度缺口	-27,650,928.56	234,253,986.28	-	41,732,815.93	248,335,873.65
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	176,661.59	-	-	-	176,661.59
结算备付金	3,346,487.13	-	-	-	3,346,487.13
存出保证金	59,241.71	-	-	-	59,241.71
交易性金融资产	125,481,453.24	236,094,017.05	-	54,516,912.98	416,092,383.27
资产总计	129,063,843.67	236,094,017.05	-	54,516,912.98	419,674,773.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	241,211.36	241,211.36
应付托管费	-	-	-	48,242.27	48,242.27
应付清算款	-	-	-	4,910.47	4,910.47
卖出回购金融资产款	133,243,941.87	-	-	-	133,243,941.87
应付销售服务费	-	-	-	7,431.06	7,431.06
应交税费	-	-	-	15,581.01	15,581.01
其他负债	-	-	-	441,112.47	441,112.47
负债总计	133,243,941.87	-	-	758,488.64	134,002,430.51
利率敏感度缺口	-4,180,098.20	236,094,017.05	-	53,758,424.34	285,672,343.19

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）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	1,455,694.76	1,355,539.67
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,392,474.05	-1,301,628.09

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，通过对宏观经济形势与市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极大类资产配置策略；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。

本基金投资组合中股票(含存托凭证)投资比例为基金资产的 0%-45%；开放期内，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；在封闭期内，本基金不受前述 5%的限制。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	41,368,367.64	16.66	54,516,912.98	19.08
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	41,368,367.64	16.66	54,516,912.98	19.08

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，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 16.66% (2023 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 19.08%)，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	48,464,419.97	54,383,673.39
第二层次	238,697,129.16	361,575,470.29
第三层次	-	133,239.59

合计	287,161,549.13	416,092,383.27
----	----------------	----------------

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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票、债券和基金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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	41,368,367.64	14.06
	其中：股票	41,368,367.64	14.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	245,793,181.49	83.55
	其中：债券	245,793,181.49	83.55
	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	6,171,283.30	2.10

8	其他各项资产	855,489.47	0.29
9	合计	294,188,321.90	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	789,600.00	0.32
C	制造业	37,402,846.16	15.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,970.48	0.01
E	建筑业	800,230.00	0.32
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	2,360,721.00	0.95
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	-	-
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	41,368,367.64	16.66

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	300552	万集科技	29,900	1,117,662.00	0.45
2	600183	生益科技	45,900	966,654.00	0.39
3	601766	中国中车	127,700	959,027.00	0.39
4	300115	长盈精密	79,900	958,001.00	0.39
5	000528	柳工	84,700	947,793.00	0.38
6	002139	拓邦股份	88,500	939,870.00	0.38

7	600066	宇通客车	36,300	936,540.00	0.38
8	603236	移远通信	19,600	915,908.00	0.37
9	300100	双林股份	83,900	903,603.00	0.36
10	000725	京东方 A	215,200	880,168.00	0.35
11	002008	大族激光	42,300	879,840.00	0.35
12	600038	中直股份	21,400	879,754.00	0.35
13	300207	欣旺达	57,600	873,792.00	0.35
14	688208	道通科技	35,600	859,384.00	0.35
15	600420	国药现代	78,700	840,516.00	0.34
16	688015	交控科技	46,400	833,808.00	0.34
17	002019	亿帆医药	67,400	833,064.00	0.34
18	600320	振华重工	242,100	827,982.00	0.33
19	605166	聚合顺	78,600	824,514.00	0.33
20	002020	京新药业	78,100	817,707.00	0.33
21	000800	一汽解放	104,200	815,886.00	0.33
22	002975	博杰股份	27,200	812,736.00	0.33
23	600761	安徽合力	37,400	809,336.00	0.33
24	600459	贵研铂业	59,900	809,249.00	0.33
25	000488	晨鸣纸业	232,600	804,796.00	0.32
26	603258	电魂网络	49,700	802,655.00	0.32
27	002519	银河电子	163,300	801,803.00	0.32
28	688136	科兴制药	47,800	801,128.00	0.32
29	600170	上海建工	372,200	800,230.00	0.32
30	601717	郑煤机	54,000	799,200.00	0.32
31	002073	软控股份	107,900	797,381.00	0.32
32	002083	孚日股份	187,600	793,548.00	0.32
33	300323	华灿光电	182,000	791,700.00	0.32
34	600480	凌云股份	80,500	791,315.00	0.32
35	603727	博迈科	60,000	789,600.00	0.32
36	002558	巨人网络	83,400	787,296.00	0.32
37	002461	珠江啤酒	106,000	786,520.00	0.32
38	002403	爱仕达	118,100	781,822.00	0.31
39	601399	国机重装	302,800	781,224.00	0.31
40	300005	探路者	155,600	779,556.00	0.31
41	603408	建霖家居	58,800	775,572.00	0.31
42	002387	维信诺	127,300	773,984.00	0.31
43	688369	致远互联	49,000	770,770.00	0.31
44	002228	合兴包装	322,400	754,416.00	0.30
45	002255	海陆重工	150,700	736,923.00	0.30
46	002250	联化科技	150,800	723,840.00	0.29
47	000404	长虹华意	135,300	721,149.00	0.29
48	603113	金能科技	131,500	719,305.00	0.29
49	000921	海信家电	22,200	715,728.00	0.29

50	300094	国联水产	229,200	582,168.00	0.23
51	603906	龙蟠科技	18,400	143,336.00	0.06
52	001376	百通能源	804	14,970.48	0.01
53	688249	晶合集成	248	3,638.16	0.00

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	603160	汇顶科技	2,159,262.00	0.76
2	601717	郑煤机	1,862,751.00	0.65
3	002845	同兴达	1,275,028.00	0.45
4	300228	富瑞特装	1,175,003.00	0.41
5	688020	方邦股份	1,170,091.13	0.41
6	000852	石化机械	1,164,073.70	0.41
7	002170	芭田股份	1,154,867.00	0.40
8	600737	中粮糖业	1,145,077.00	0.40
9	002755	奥赛康	1,142,456.00	0.40
10	000035	中国天楹	1,140,855.00	0.40
11	600153	建发股份	1,135,458.00	0.40
12	000404	长虹华意	1,130,775.00	0.40
13	688208	道通科技	1,062,950.89	0.37
14	002555	三七互娱	1,057,049.00	0.37
15	300702	天宇股份	1,036,663.00	0.36
16	300552	万集科技	1,024,131.00	0.36
17	688369	致远互联	1,017,907.62	0.36
18	603408	建霖家居	1,014,975.00	0.36
19	002558	巨人网络	1,014,658.00	0.36
20	600066	宇通客车	1,011,723.00	0.35

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	600582	天地科技	2,189,667.00	0.77
2	601717	郑煤机	2,124,928.00	0.74
3	002588	史丹利	2,099,425.00	0.73
4	603160	汇顶科技	1,886,595.00	0.66
5	603739	蔚蓝生物	1,367,359.00	0.48
6	000680	山推股份	1,341,484.00	0.47

7	002533	金杯电工	1,318,766.00	0.46
8	600066	宇通客车	1,305,568.00	0.46
9	600312	平高电气	1,294,811.00	0.45
10	002422	科伦药业	1,263,498.00	0.44
11	603225	新凤鸣	1,255,135.00	0.44
12	000338	潍柴动力	1,248,975.00	0.44
13	000521	长虹美菱	1,222,105.00	0.43
14	300709	精研科技	1,215,622.00	0.43
15	300017	网宿科技	1,207,101.00	0.42
16	000852	石化机械	1,192,247.00	0.42
17	300702	天宇股份	1,181,730.00	0.41
18	601500	通用股份	1,173,813.80	0.41
19	002498	汉缆股份	1,166,960.00	0.41
20	600710	苏美达	1,165,254.00	0.41

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	123,462,697.54
卖出股票收入（成交）总额	133,080,134.62

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	224,560,777.38	90.43
	其中：政策性金融债	5,704,728.50	2.30
4	企业债券	14,136,351.78	5.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,096,052.33	2.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	245,793,181.49	98.98

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	2220054	22 湖北银行二级	120,000	12,743,746.19	5.13
2	092280014	22 上海银行二级资本债 01	100,000	10,749,353.01	4.33
3	092280024	22 杭联农商行二级资本债 02	100,000	10,700,344.26	4.31
4	232380033	23 成都银行二级资本债 01	100,000	10,697,459.02	4.31
5	2120062	21 宁波银行二级 02	100,000	10,664,551.91	4.29

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除 21 中证 10 的发行主体外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。

2024 年 3 月 13 日，据证监立案字 03720240049 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，中国证监会于 20240313 对中信证券进行立案调查。

我们认为相关处罚措施对中信证券的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对中信证券的

债券偿还影响很小。本基金投资 21 中证 10 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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	20,399.05
2	应收清算款	835,090.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	855,489.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	3,859,637.95	1.55
2	132026	G 三峡 EB2	3,236,414.38	1.30

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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 (%)
宝盈祥颐定期开放混合 A	1,861	114,699.55	-	-	213,455,859.31	100.00
宝盈祥颐	286	60,793.67	-	-	17,386,990.91	100.00

定期开放混合 C						
合计	2,147	107,518.79	-	-	230,842,850.22	100.00

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	宝盈祥颐定期开放混合 A	209.45	0.0001
	宝盈祥颐定期开放混合 C	8.76	0.0001
	合计	218.21	0.0001

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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	宝盈祥颐定期开放混合 A	0
	宝盈祥颐定期开放混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈祥颐定期开放混合 A	0
	宝盈祥颐定期开放混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈祥颐定期开放混合 A	宝盈祥颐定期开放混合 C
基金合同生效日 (2019年3月20日) 基金份额总额	374,346,500.23	101,210,989.37
本报告期期初基金份额总额	248,552,030.63	21,138,080.59
本报告期基金总申购份额	34.42	20.20
减：本报告期基金总	35,096,205.74	3,751,109.88

赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	213,455,859.31	17,386,990.91

§ 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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 (%)	
天风证券	2	136,639,555.74	53.26	127,882.22	53.26	-
中信证券	2	77,494,845.81	30.21	72,526.61	30.21	-
华创证券	2	42,408,430.61	16.53	39,689.21	16.53	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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、本基金本报告期交易单元变更情况：

本基金本报告期无新增租用和退租交易单元。

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(%)
天风证券	28,311,263.81	13.33	717,190,000.00	14.74	-	-
中信证券	143,857,321.72	67.72	2,288,380,000.00	47.04	-	-
华创证券	40,260,471.23	18.95	1,859,447,000.00	38.22	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-

券						
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 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
2	宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金(宝盈祥颐定期开放混合 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	2024-06-27
3	宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金(宝盈祥颐定期开放混合 C 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	2024-06-27
4	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
5	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
6	宝盈祥颐定期开放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
7	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
8	宝盈祥颐定期开放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
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	宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基	本基金管理人网站, 中	2024-01-19

	金 2023 年第 4 季度报告	国证监会基金电子披露网站	
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
13	宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金第九个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	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	2024-01-06

§ 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祥颐定期开放混合型证券投资基金注册的文件。

《宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈祥颐定期开放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

上述备查文件文本分别存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所。

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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 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办公场所和基金托管人住所，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