

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资  
基金  
2025 年第 4 季度报告

2025 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 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 2025 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 宝盈国家安全沪港深股票                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金主代码      | 001877                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2016 年 1 月 20 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 201,360,776.88 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 投资目标       | 本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 投资策略       | <p>本基金的投资策略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金融衍生品投资策略四部分组成。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服务等；</p> |

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |               |
|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
|             | <p>(3) 信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。</p> <p>本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。</p> <p>(三) 固定收益类资产投资策略</p> <p>在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。</p> <p>(四) 金融衍生品投资策略</p> <p>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。</p>                                                                             |               |
| 业绩比较基准      | $\text{沪深 300 指数收益率} \times 65\% + \text{恒生综合指数收益率} \times 15\% + \text{中债综合指数收益率} \times 20\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |               |
| 风险收益特征      | <p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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。</p> <p>本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p> |               |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |               |
| 下属分级基金的基金简称 | 宝盈国家安全沪港深股票 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 宝盈国家安全沪港深股票 C |

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 001877           | 013613          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 168,331,742.52 份 | 33,029,034.36 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（2025 年 10 月 1 日-2025 年 12 月 31 日） |               |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
|                 | 宝盈国家安全沪港深股票 A                         | 宝盈国家安全沪港深股票 C |
| 1. 本期已实现收益      | 41,611,239.07                         | 2,422,405.17  |
| 2. 本期利润         | 78,005,617.42                         | 5,956,648.89  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.4398                                | 0.5183        |
| 4. 期末基金资产净值     | 410,564,081.03                        | 78,575,200.12 |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.4390                                | 2.3790        |

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

宝盈国家安全沪港深股票 A

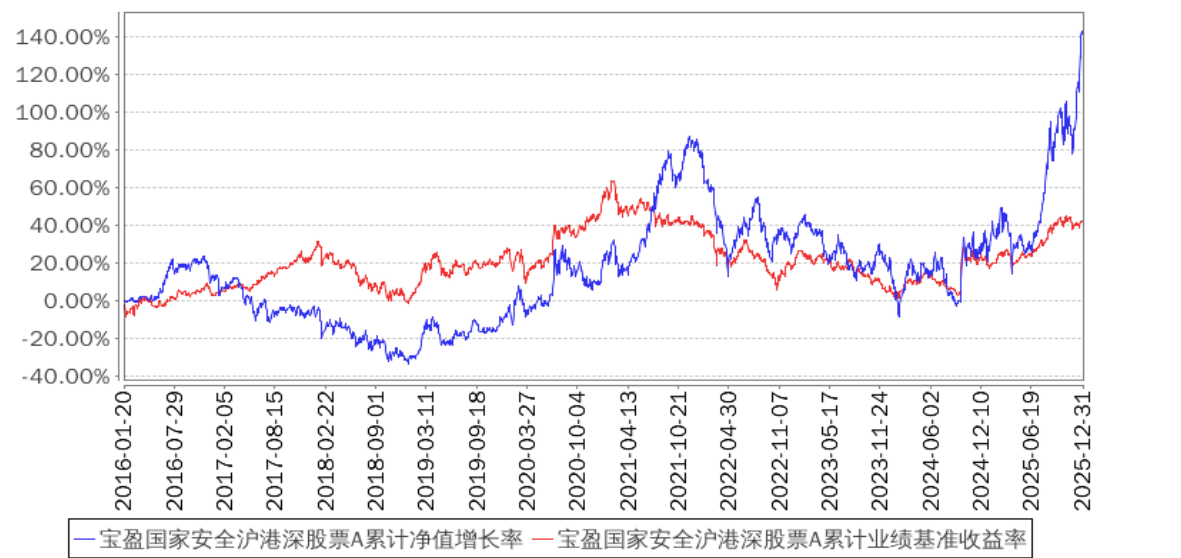
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 23.20%  | 2.39%     | -1.01%     | 0.76%         | 24.21%  | 1.63% |
| 过去六个月      | 79.38%  | 2.20%     | 12.40%     | 0.71%         | 66.98%  | 1.49% |
| 过去一年       | 92.30%  | 2.25%     | 15.82%     | 0.80%         | 76.48%  | 1.45% |
| 过去三年       | 88.91%  | 1.98%     | 19.73%     | 0.85%         | 69.18%  | 1.13% |
| 过去五年       | 116.61% | 1.81%     | -5.14%     | 0.91%         | 121.75% | 0.90% |
| 自基金合同生效起至今 | 143.90% | 1.65%     | 41.96%     | 0.91%         | 101.94% | 0.74% |

宝盈国家安全沪港深股票 C

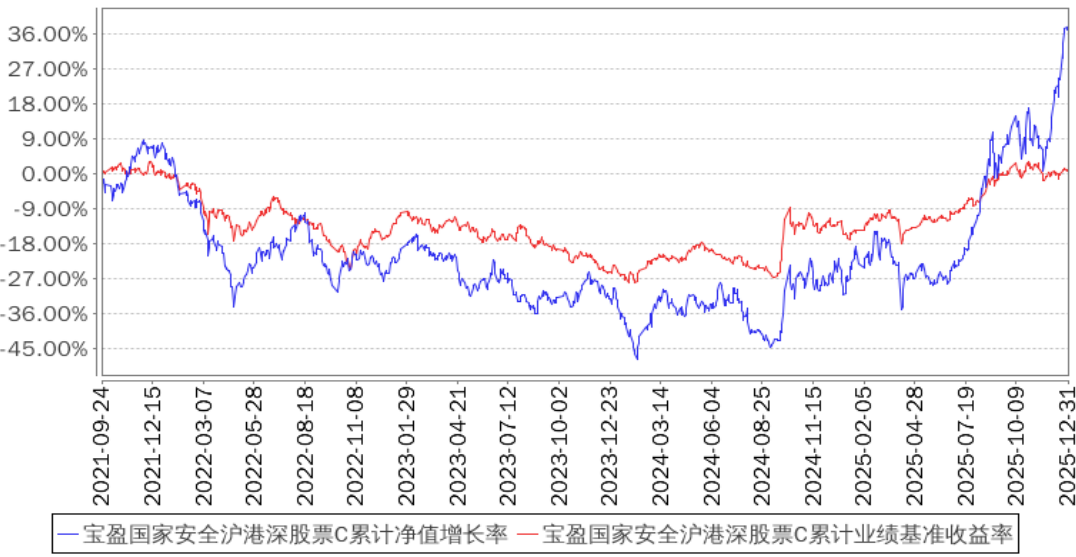
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 23.14% | 2.39%     | -1.01%     | 0.76%         | 24.15% | 1.63% |
| 过去六个月      | 78.95% | 2.20%     | 12.40%     | 0.71%         | 66.55% | 1.49% |
| 过去一年       | 91.27% | 2.25%     | 15.82%     | 0.80%         | 75.45% | 1.45% |
| 过去三年       | 85.57% | 1.98%     | 19.73%     | 0.85%         | 65.84% | 1.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.09% | 1.85%     | 0.70%      | 0.90%         | 37.39% | 0.95% |

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

宝盈国家安全沪港深股票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



宝盈国家安全沪港深股票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



注：本基金于 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈国家安全沪港深股票 C”。

§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 |        |                                                                                                                                                                 |
| 容志能 | 本基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈创新驱动股票型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置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基金经理；权益投资部副总经理（主持工作）。 | 2023 年 3 月 17 日 | -    | 10 年   | 容志能先生，浙江大学电子科学与技术专业硕士。曾在广东省电力设计研究院担任网络工程项目经理，在广发证券股份有限公司担任家电行业研究员，在中国中投证券有限公司担任通信行业研究员，在天风证券股份有限公司担任通信行业联合首席，2020 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，曾任行业研究员。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遵规守信情况的说明

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

#### （1）在投资策略方面

跟过去几个季度一样，我们始终坚持成长股的投资思路。特别是 2024 年三季度以来国家推出较多的宏观政策提振经济及市场，并进一步肯定了成长产业对于经济发展的重要作用，因此我们认为当下仍然是较好的成长股投资阶段。此外，国内宏观方面，“十五五”也呈现出较好的托底增长态势。但考虑到国际方面，我们仍面临地缘政治的一些问题，因此我们依然会看重估值的权重因子，继续稳定住我们对成长资产的投资要求。

此外，我们相信“前瞻决定胜率，深度决定赔率”的方法论，即以前瞻的角度挖掘相对底部的行业及公司，以深度研究的水平挖掘具备弹性的投资机会。

总的来说，在投资策略方面，我们将结合估值、景气度和公司质地的三方面权重，坚定通过“前瞻决定胜率，深度决定赔率”的思路，努力构建具备“相对底部和具备弹性”的投资组合，尽全力为持有人提供投资回报。

#### （2）对于成长股的选择思路

我们始终坚持基于基本面三要素（估值、景气度、公司质地）的成长股投资思路。

首先，我们是成长股的投资思路，投资的是成长的行业和公司，并且我们相信优秀公司将能在成长的行业中更好地脱颖而出，当然我们一直强调我们对于优秀公司的定义不限于核心龙头资产，而是所有治理结构完善、战略方向清晰、在细分领域具备核心竞争力、对股东相对友好的公司。

其次，我们也很看重估值的重要性，脱离估值谈成长投资，容易出现虽然成长趋势不变但高估值之下大幅回撤的可能。当然我们也明确我们对于估值的定义不限于低 PE，会结合行业发展阶段，充分采用分部估值、PS 估值等进行相对科学的综合估值。

再次，我们认同产业趋势的价值，产业趋势向上往往意味着增量的市场需求，在增量的市场需求下，有望形成更好的供给格局。

### （3）四季度细分行业选择及投资布局变化

本基金重点投资于涉及国家安全战略方面的产业，包括国防军工、能源和网络信息等领域。因此，在细分行业选择方面，结合我们关于估值、景气度的投资思路，我们从 2022 年开始重点看好网络信息、新能源、半导体制造以及卫星互联网板块。再往后看，我们依然看好基于生成式 AI 的产业浪潮带来的网络信息的投资机会，以及半导体先进封装以及国产化替代进程下的机会。除了以 AI 为主要的板块选择外，在其他的一些细分科技制造领域，如半导体、高端材料制造、消费电子终端新能源风电等细分行业，具备较多的自主创新机会，而这些细分领域在经历近几年的产品研发和验证阶段，也逐步进入产品放量阶段，有望逐步形成较好的当期投资回报。因此我们也会在这些领域自下而上选择投资标的。

总的来看，由于持仓的主要标的在经历三季度科技成长板块的大幅上涨之后，四季度均呈现了不同程度的横盘或者调整，这是合理的表现。此外，我们前期布局的部分商业航天标的，也在四季度贡献了较多的弹性收益。

往后看，发展卫星互联网、商业航天板块以及发展可控核聚变，我们认为这是保障国家信息和能源安全的必须领域，因此产业发展如火如荼，并陆续涌现较多的投资机会，因此我们也会适当地在以上领域择优选择标的。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈国家安全沪港深股票 A 的基金份额净值为 2.4390 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.20%；截至本报告期末宝盈国家安全沪港深股票 C 的基金份额净值为 2.3790 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.14%。同期业绩比较基准收益率为-1.01%。

## 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              | 429,339,967.30 | 85.33        |
|    | 其中：股票             | 429,339,967.30 | 85.33        |
| 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      | 65,939,407.41  | 13.10        |
| 8  | 其他资产              | 7,884,628.41   | 1.57         |
| 9  | 合计                | 503,164,003.12 | 100.00       |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 37,321,448.41 元，占净值比为 7.63%。

### 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              | 66,089.52      | 0.01         |
| C  | 制造业              | 368,607,540.33 | 75.36        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | 23,282,748.00  | 4.76         |
| F  | 批发和零售业           | 14,705.90      | 0.00         |
| 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  | 22,153.39      | 0.00         |
| 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    | 25,281.75      | 0.01  |
| 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            | 392,018,518.89 | 80.14 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 原材料     | —             | —            |
| 非周期性消费品 | 10,954,046.95 | 2.24         |
| 周期性消费品  | —             | —            |
| 能源      | —             | —            |
| 金融      | —             | —            |
| 医疗      | —             | —            |
| 工业      | —             | —            |
| 信息技术    | 26,367,401.46 | 5.39         |
| 电信服务    | —             | —            |
| 公用事业    | —             | —            |
| 房地产     | —             | —            |
| 合计      | 37,321,448.41 | 7.63         |

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

### 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   | 89,560  | 38,589,612.80 | 7.89         |
| 2  | 600118 | 中国卫星  | 394,300 | 37,438,785.00 | 7.65         |
| 3  | 688270 | 臻镭科技  | 276,058 | 33,698,400.06 | 6.89         |
| 4  | 300308 | 中际旭创  | 47,300  | 28,853,000.00 | 5.90         |
| 5  | 300394 | 天孚通信  | 134,500 | 27,307,535.00 | 5.58         |
| 6  | 688668 | 鼎通科技  | 204,488 | 25,356,512.00 | 5.18         |
| 7  | 300136 | 信维通信  | 404,700 | 25,091,400.00 | 5.13         |
| 8  | 300762 | 上海瀚讯  | 598,800 | 24,957,984.00 | 5.10         |
| 9  | 605598 | 上海港湾  | 335,100 | 23,282,748.00 | 4.76         |
| 10 | 01347  | 华虹半导体 | 331,372 | 22,238,125.07 | 4.55         |

### 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，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除臻镱科技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。

2025 年 12 月 27 日，根据《浙江臻镱科技股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会立案告知书的公告》显示，浙江臻镱科技股份有限公司因涉嫌信息披露违法违规，中国证监会根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规对公司立案调查。

我们将持续关注后续立案调查的进展情况，本基金投资臻镱科技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   | 134,972.38   |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 7,749,656.03 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 7,884,628.41 |

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

| 项目 | 宝盈国家安全沪港深股票 A | 宝盈国家安全沪港深股票 C |
|----|---------------|---------------|
|----|---------------|---------------|

|                           |                |               |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 196,651,024.89 | 13,174,147.07 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 22,185,601.65  | 40,420,223.38 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 50,504,884.02  | 20,565,336.09 |
| 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               | 168,331,742.52 | 33,029,034.36 |

§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基金份额         | 5,963,029.22 |
| 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         | 5,963,029.22 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.96         |

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

| 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              | 20251110-20251223       | 37,411,231.66 | -    | -    | 37,411,231.66 | 18.58   |
| 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。 |                |                         |               |      |      |               |         |

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国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票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

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

### 9.3 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

2026 年 1 月 22 日