

# 宝盈人工智能主题股票型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 7 月 20 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 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 宝盈人工智能股票                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金主代码      | 005962                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金合同生效日    | 2018 年 8 月 15 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 228,884,485.49 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资目标       | 本基金主要投资于人工智能主题优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资策略       | <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，并在本基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内（A 股）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>1、人工智能主题的界定</p> <p>人工智能（Artificial Intelligence）是研究、开发用于模拟、延伸和扩展人的智能的理论、方法、技术及应用系统的一门技术科学。其技术体系分为基础层、技术层和应用层，具体内容包括：</p> <p>1）基础层：核心处理器芯片、底层算法、大数据等；</p> <p>2）技术层：语音识别、图像识别、生物识别、学习能力、逻辑能力等；</p> <p>3）应用层：自动驾驶、智能安防、无人系统、服务机器人等。</p> |

随着关键技术的突破和产业政策的扶持，人工智能技术与应用的发展出现了向上的拐点。本基金界定的人工智能主题包括以下两类上市公司：

（1）直接提供人工智能基础资源、技术以及应用支持的公司，具体包括信息采集技术及设备商、人工智能认知技术提供商、人工智能硬件提供商及相应供应链、人工智能应用支持商以及其他相关领域的上市公司；

（2）利用人工智能技术提升产品与服务智能化水平的智能制造（高档数控机床、工业机器人、智能传感与控制系统等）、智能物流（无人化仓储、智能装备与配送等）、智能家居（安防系统、照明控制、智能家居等）和智能医疗（辅助诊断系统、临床应用系统等）领域的上市公司。

未来如果由于经济发展、技术进步或政策调整造成人工智能主题的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，可以对上述界定进行调整和修订。

## 2、子行业配置策略

行业配置方面，本基金着重分析人工智能主题涵盖的各子行业技术成熟度、行业所处生命周期、行业内外竞争空间、行业盈利前景、行业成长空间及行业估值水平等多层面的因素，在此基础上判断行业的可持续发展能力，从而确定本基金的行业配置。

## 3、个股精选策略

本基金主要采取“自下而上”的选股策略，基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量，使用定性与定量相结合的方法精选个股。

## 4、港股通标的股票投资策略

本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

本基金将对港股通标的股票进行系统性分析，在采用子行业配置策略和个股精选策略的基础上，结合香港股票市场情况，重点投资于港股通标的股票范围内受惠于我国人工智能产业发展，且处于合理价位的具备核心竞争力的上市公司股票。

## 5、存托凭证投资策略

本基金将结合宏观经济状况和发行人所处行业的景气度，关注发行人基本面情况、公司竞争优势、公司治理结构、有关信息披露情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，选择投资价值高的存托凭证进行投资，谨慎决定存托凭证的标的选择和配置比例。

## （三）债券投资策略

在进行债券投资时，本基金将会分析利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略和可转换债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                 |  |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--|
|                 | <p>理，获得超额收益。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>（五）中小企业私募债券投资策略</p> <p>中小企业私募债券具有二级市场流动性差、信用风险高、票面利率高的特点。本基金将综合运用个券信用分析、收益率预期、收益率利差、收益率曲线变动、相对价值评估等策略，结合中小企业私募债券对基金资产流动性影响的分析，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>（六）衍生品投资策略</p> <p>1、权证投资策略</p> <p>本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> |                 |  |
| 业绩比较基准          | 中证人工智能主题指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×25%+中证综合债券指数收益率×15%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                 |  |
| 风险收益特征          | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                 |  |
| 基金管理人           | 宝盈基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                 |  |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                 |  |
| 下属分级基金的基金简称     | 宝盈人工智能股票 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 宝盈人工智能股票 C      |  |
| 下属分级基金的交易代码     | 005962                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 005963          |  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 138,892,492.87 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 89,991,992.62 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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |               |
|------------|-------------------------------------|---------------|
|            | 宝盈人工智能股票 A                          | 宝盈人工智能股票 C    |
| 1. 本期已实现收益 | 133,827,515.73                      | 72,887,366.92 |

|                 |                   |                   |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 2. 本期利润         | 393, 210, 674. 65 | 217, 101, 600. 91 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 2. 7238           | 2. 4825           |
| 4. 期末基金资产净值     | 950, 537, 326. 36 | 578, 251, 248. 64 |
| 5. 期末基金份额净值     | 6. 8437           | 6. 4256           |

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

宝盈人工智能股票 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      | 65. 33%  | 2. 58%    | 27. 84%    | 1. 78%        | 37. 49%  | 0. 80% |
| 过去六个月      | 58. 29%  | 2. 34%    | 21. 82%    | 1. 63%        | 36. 47%  | 0. 71% |
| 过去一年       | 141. 36% | 2. 23%    | 64. 61%    | 1. 58%        | 76. 75%  | 0. 65% |
| 过去三年       | 182. 74% | 1. 97%    | 88. 10%    | 1. 56%        | 94. 64%  | 0. 41% |
| 过去五年       | 108. 68% | 1. 90%    | 60. 19%    | 1. 47%        | 48. 49%  | 0. 43% |
| 过去七年       | 484. 28% | 1. 92%    | 115. 96%   | 1. 44%        | 368. 32% | 0. 48% |
| 自基金合同生效起至今 | 584. 37% | 1. 89%    | 126. 34%   | 1. 45%        | 458. 03% | 0. 44% |

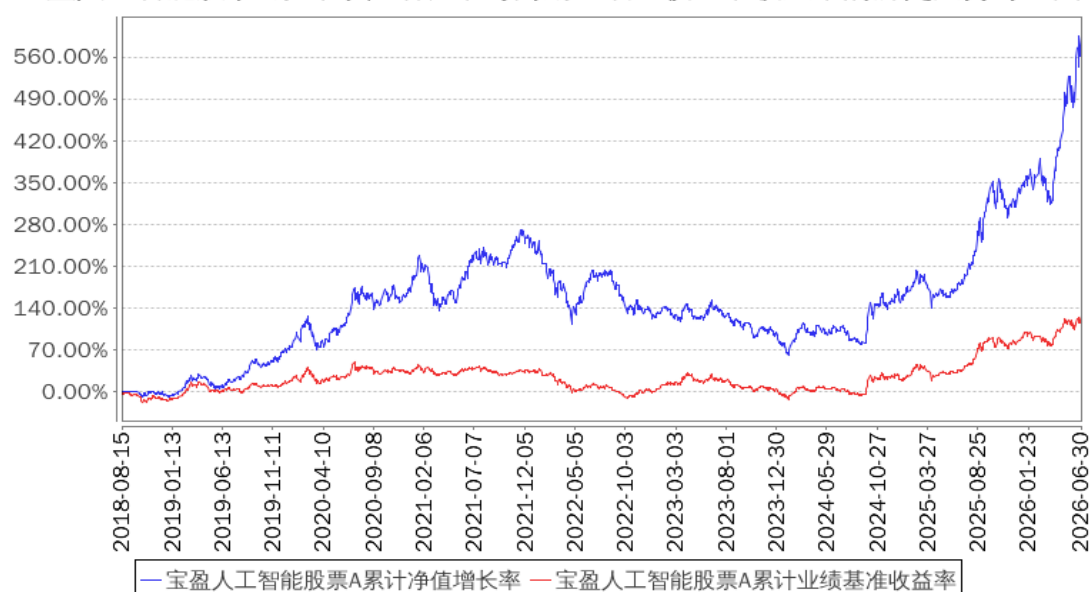
宝盈人工智能股票 C

| 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 | 65. 00%  | 2. 58%    | 27. 84%    | 1. 78%        | 37. 16% | 0. 80% |
| 过去六个月 | 57. 66%  | 2. 34%    | 21. 82%    | 1. 63%        | 35. 84% | 0. 71% |
| 过去一年  | 139. 44% | 2. 23%    | 64. 61%    | 1. 58%        | 74. 83% | 0. 65% |

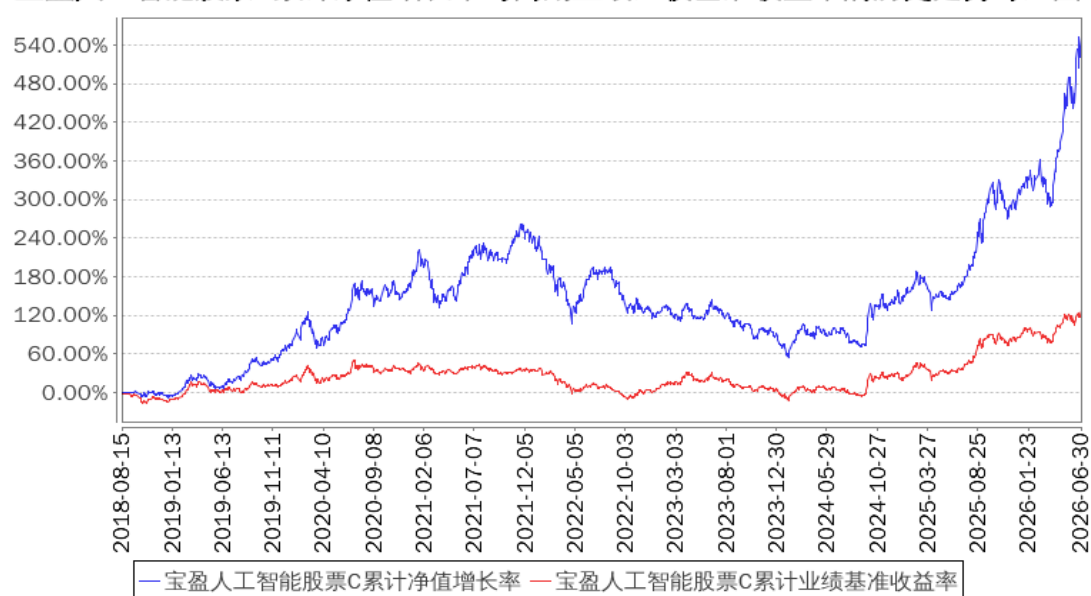
|                |         |       |         |       |         |       |
|----------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年           | 176.01% | 1.97% | 88.10%  | 1.56% | 87.91%  | 0.41% |
| 过去五年           | 100.52% | 1.90% | 60.19%  | 1.47% | 40.33%  | 0.43% |
| 过去七年           | 452.50% | 1.92% | 115.96% | 1.44% | 336.54% | 0.48% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 542.56% | 1.89% | 126.34% | 1.45% | 416.22% | 0.44% |

### 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

宝盈人工智能股票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



宝盈人工智能股票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



## §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 |        |                                                                                                       |
| 叶秀贤 | 本基金、宝盈基础产业混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 | 2025 年 11 月 22 日 | -    | 13 年   | 叶秀贤, 天津大学管理科学与工程专业硕士。曾任申银万国证券研究所研究销售、广发证券股份有限公司研究销售、电子分析师。2023 年 9 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

2026 年二季度，随着中东地缘冲突得到一定缓和，全球资本市场风险偏好显著修复。同时，国内外大模型头部企业 ARR 持续超预期，市场对 AI 叙事认同度不断提升，科技成长股特别是 AI 基础设施产业链相关标的股价明显修复，本基金净值自 4 月以来企稳回升。

从中长期角度进行后续展望，我们认为科技板块投资机会仍会持续，人工智能是科技板块最大的主线，随着模型持续迭代，AI 有望在应用层面进一步落地。本基金主要投资于人工智能相关的行业及公司，我们认为人工智能在各行业的应用落地将带动模型、数据、应用及基础设施等相关环节新一轮发展，我们会进一步优化人工智能各环节的配置。

综上，对于基金的后续运作，基金经理希望基于审慎和努力的原则，在规避流动性风险背景下沿着“赔率优先，兼顾胜率”的思路，努力构建具备“估值合理+符合人工智能产业发展趋势+较好的市场地位”的投资组合，尽力为持有人创造较好的投资收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈人工智能股票 A 的基金份额净值为 6.8437 元，本报告期基金份额净值增长率为 65.33%；截至本报告期末宝盈人工智能股票 C 的基金份额净值为 6.4256 元，本报告期基金份额净值增长率为 65.00%。同期业绩比较基准收益率为 27.84%。

#### 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              | 1,402,373,285.99 | 85.88        |
|    | 其中：股票             | 1,402,373,285.99 | 85.88        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 750,023.01       | 0.05         |
|    | 其中：债券             | 750,023.01       | 0.05         |
|    | 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      | 142,694,088.37   | 8.74         |

|   |      |                  |        |
|---|------|------------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 87,111,346.14    | 5.33   |
| 9 | 合计   | 1,632,928,743.51 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 97,998,793.37 元，占基金资产净值比例 6.41%。

## 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              | 36,149.82        | 0.00         |
| C  | 制造业              | 1,220,144,122.56 | 79.81        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 645,088.77       | 0.04         |
| E  | 建筑业              | —                | —            |
| F  | 批发和零售业           | —                | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,951.49         | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 83,547,179.98    | 5.46         |
| 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               | 1,304,374,492.62 | 85.32        |

### 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 | 48,959,499.06 | 3.20         |
| 周期性消费品  | —             | —            |
| 能源      | —             | —            |
| 金融      | —             | —            |
| 医疗      | —             | —            |
| 工业      | —             | —            |
| 信息科技    | —             | —            |

|      |               |      |
|------|---------------|------|
| 电信服务 | 49,039,294.31 | 3.21 |
| 公用事业 | -             | -    |
| 房地产  | -             | -    |
| 合计   | 97,998,793.37 | 6.41 |

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  | 002080 | 中材科技   | 1,474,000 | 132,660,000.00 | 8.68         |
| 2  | 603228 | XD 景旺电 | 1,475,500 | 106,840,955.00 | 6.99         |
| 3  | 688008 | 澜起科技   | 289,471   | 89,707,062.90  | 5.87         |
| 4  | 300502 | 新易盛    | 138,040   | 83,790,280.00  | 5.48         |
| 5  | 688361 | 中科飞测   | 190,919   | 82,095,170.00  | 5.37         |
| 6  | 600176 | XD 中国巨 | 1,036,872 | 75,567,231.36  | 4.94         |
| 7  | 300308 | 中际旭创   | 58,800    | 74,676,000.00  | 4.88         |
| 8  | 688300 | 联瑞新材   | 291,123   | 71,150,461.20  | 4.65         |
| 9  | 300394 | 天孚通信   | 234,360   | 70,936,084.80  | 4.64         |
| 10 | 301526 | 国际复材   | 1,277,100 | 59,602,257.00  | 3.90         |

### 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      | -          | -            |
| 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） | 750,023.01 | 0.05         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 750,023.01 | 0.05         |

### 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  | 118072 | 鼎通转债 | 7,500 | 750,023.01 | 0.05         |

### 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约定的备选股票库

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   | 992,812.76    |
| 2  | 应收证券清算款 | 43,147,119.55 |
| 3  | 应收股利    | 434,298.09    |
| 4  | 应收利息    | —             |
| 5  | 应收申购款   | 42,537,115.74 |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 其他      | —             |
| 8  | 合计      | 87,111,346.14 |

### 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                        | 宝盈人工智能股票 A     | 宝盈人工智能股票 C    |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 157,443,464.63 | 90,919,209.94 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 42,783,971.47  | 51,899,274.21 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 61,334,943.23  | 52,826,491.53 |
| 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               | 138,892,492.87 | 89,991,992.62 |

## §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人工智能主题股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈人工智能主题股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈人工智能主题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

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 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

2026 年 7 月 21 日