

(上接B301版)	
序号	名称
1	存放保证金
2	应收证券清算款
3	应收利息
4	应收申购款
5	应收中行款项
6	应付费用
7	预提费用
8	预提
9	合计

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期内未持有处于转股期的可转换债券。5) 报告期末前十名股票

中不存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金净值比例(%) 说明

1 000999 华润三九 84,967,965.00 4.36 重大资产重组

2 300027 华谊兄弟 70,233,000.00 3.60 重大资产重组

2.宝康灵活配置证券投资基金

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 609,599,165.95 66.74

2 固定收益投资 609,599,165.95 66.74

3 货币市场基金 225,995,414.60 24.70

4 其他资产 225,995,414.60 24.70

5 金融衍生品投资 - -

6 其他 - -

7 买入返售金融资产 - -

8 其他 - -

9 合计 913,461,150.20 100.00

Q) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 2,605,818.00 0.29

2 采矿业 44,624,766.75 4.91

3 制造业 320,482.25 26.23

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 13,029,769.25 1.43

5 建筑业 17,978,073.89 1.98

6 批发、零售业 11,055,814.74 1.22

7 交通运输、仓储和邮政业 10,589,576.28 1.16

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息、计算机、软件和信息技术服务业 20,068,624.70 2.21

10 金融业 149,335,720.17 16.43

11 地产业 27,260,161.89 3.00

12 租赁和商务服务业 6,961,859.02 0.77

13 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

14 水利、环境和公共设施管理业 59,809,463.53 6.58

15 国际服务、旅游和其他服务业 - -

16 公用事业 - -

17 卫生、社会保障和社会福利业 - -

18 文化、体育和娱乐业 1,713,275.28 0.19

19 信息传输、计算机服务和软件业 5,963,546.40 0.66

20 合计 609,599,165.95 67.02

G) 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 000070 贵州茅台 1,511,006 56,934,706.08 6.26

2 300090 东方财富 671,478 20,735,240.64 2.29

3 600036 金证股份 1,200,000 19,781,588 2.20

4 600036 金证股份 1,467,143 17,018,858.80 1.87

5 002503 万里马 1,271,330 14,523,014.70 1.60

6 300263 佳发节能 834,409 13,709,339.87 1.51

7 601318 中国平煤 348,976 12,130,405.76 1.33

8 002358 长源电力 902,207 11,918,154.47 1.31

9 601166 中国银行 79,370 11,718,074.90 1.29

10 300017 信邦电子 314,743 10,883,812.94 1.20

H) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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 120070 信用债 6,472,414.60 6.21

2 信用债 39,710,000.00 4.37

3 金融债 169,404,000.00 18.62

4 其他债券 169,404,000.00 18.62

5 企业债券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 225,593,414.60 24.80

I) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 130201 信用债 700,000 69,615,000.00 7.65

2 080215 信用债 500,000 50,005,000.00 5.50

3 120238 信用债 300,000 29,388,000.00 3.29

4 130102 信用债 300,000 29,730,000.00 3.27

5 130218 信用债 200,000 19,886,000.00 2.19

J) 报告期末按资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券。

K) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号 投资代码 报告期初按公允价值占基金资产净值比例(%)

1 000070 信用债 1,511,006 56,934,706.08 6.26

2 300090 东方财富 671,478 20,735,240.64 2.29

3 600036 金证股份 1,200,000 19,781,588 2.20

4 600036 金证股份 1,467,143 17,018,858.80 1.87

5 002503 万里马 1,271,330 14,523,014.70 1.60

6 300263 佳发节能 834,409 13,709,339.87 1.51

7 601318 中国平煤 348,976 12,130,405.76 1.33

8 002358 长源电力 902,207 11,918,154.47 1.31

9 601166 中国银行 79,370 11,718,074.90 1.29

10 300017 信邦电子 314,743 10,883,812.94 1.20

L) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券。

M) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号 报告期初按公允价值占基金资产净值比例(%)

1 000070 信用债 1,511,006 56,934,706.08 6.26

2 300090 东方财富 671,478 20,735,240.64 2.29

3 600036 金证股份 1,200,000 19,781,588 2.20

4 600036 金证股份 1,467,143 17,018,858.80 1.87

5 002503 万里马 1,271,330 14,523,014.70 1.60

6 300263 佳发节能 834,409 13,709,339.87 1.51

7 601318 中国平煤 348,976 12,130,405.76 1.33

8 002358 长源电力 902,207 11,918,154.47 1.31

9 601166 中国银行 79,370 11,718,074.90 1.29

10 300017 信邦电子 314,743 10,883,812.94 1.20

N) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券。

O) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号 报告期初按公允价值占基金资产净值比例(%)

1 000070 信用债 1,511,006 56,934,706.08 6.26

2 300090 东方财富 671,478 20,735,240.64 2.29

3 600036 金证股份 1,200,000 19,781,588 2.20

4 600036 金证股份 1,467,143 17,018,858.80 1.87

5 002503 万里马 1,271,330 14,523,014.70 1.60

6 300263 佳发节能 834,409 13,709,339.87 1.51

7 601318 中国平煤 348,976 12,130,405.76 1.33

8 002358 长源电力 902,207 11,918,154.47 1.31

9 601166 中国银行 79,370 11,718,074.90 1.29

10 300017 信邦电子 314,743 10,883,812.94 1.20

P) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券。

Q) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号 报告期初按公允价值占基金资产净值比例(%)

1 000070 信用债 1,511,006 56,934,706.08 6.26

2 300090 东方财富 671,478 20,735,240.64 2.29

3 600036 金证股份 1,200,000 19,781,588 2.20

4 600036 金证股份 1,467,143 17,018,858.80 1.87

5 002503 万里马 1,271,330 14,523,014.70 1.60

6 300263 佳发节能 834,409 13,709,339.87 1.51

7 601318 中国平煤 348,976 12,130,405.76 1.33

8 002358 长源电力 902,207 11,918,154.47 1.31

9 601166 中国银行 79,370 11,718,074.90 1.29

10 300017 信邦电子 314,743 10,883,812.94 1.20

R) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券。</div