

# 信息披露 Disclosure

(上接B064版)  
4、买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;  
5、向基金管理人、基金托管人出资或买卖基金管理人、基金托管人发行的证券或者债券;  
6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;  
7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;  
8、依照法律、法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止从事的其他行为。

(六)、基金投资组合比例限制  
1、各基金投资于国债的比例不低于20%;  
2、各基金投资于股票、债券的比例不低于该基金资产总值的90%;  
3、各基金持有单一公司的股票,不得超过该基金资产净值的10%;  
4、各基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券,不得超过该证券的10%;  
5、基金财产参与股票发行申购,单只基金所申报的金额不得超过该基金的总资产,单只基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资不符合上述3、4条或《基金合同》约定的投资比例,基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到比例。  
6、我公司运用基金财产进行证券投资时,将严格参照证监会的有关规定,只进行管理和控制;  
(七)基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五;  
(八)一只基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的百分之二;  
(九)本公司管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的,不受上述(1)、(2)、(3)项规定的比例限制。因证券市场波动、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述(2)、(3)项及基金合同或中国证监会规定的投资比例,本公司将在十个交易日内调整完毕。  
7、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。  
(七)、基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法  
1、不谋求对上市公司控股,不参与所投资上市公司经营管理;  
2、有利于基金财产的安全与增值;  
3、基金管理人依照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资者的利益。

## 六、基金的投资组合报告

本系列基金的投资组合报告所载的数据截至2017年12月31日,本报告中所列数据未经审计。

(一) 宝康消费品证券投资基金

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	767,135,687.85	70.38
	其中:股票	767,135,687.85	70.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	261,736,800.00	24.01
	其中:债券	261,736,800.00	24.01
	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	52,869,701.30	4.85
8	其他资产	8,191,690.26	0.76
	合计	1,069,933,893.41	100.00

(2) 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	344,072,046.00	31.77
D	电力、热力、燃气及生产	-	-
	和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	65,573,933.11	6.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	56,051,000.00	5.18
I	信息传输、软件和信息技术	102,070,000.00	9.43
	服务业	-	-
J	金融业	26,732,202.00	2.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	83,402,981.96	7.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理	957,323.76	0.09
	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	16,534,000.00	1.53
R	文化、体育和娱乐业	71,742,201.02	6.62
S	综合	-	-
	合计	767,135,687.85	70.84

2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本系列基金本报告期末未持有港股通投资股票。

(3) 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	002624	完美世界	1,700,000	56,882,000.00	5.25
2	002556	三七互娱	2,200,000	46,188,000.00	4.17
3	300309	吉视科技	2,000,000	42,740,000.00	3.95
4	600887	伊泰煤炭	1,200,000	38,626,000.00	3.57
5	002277	皖新传媒	3,508,844	36,667,419.80	3.39
6	002024	苏宁云商	2,880,000	34,395,200.00	3.27
7	601888	中国国航	800,000	34,312,000.00	3.21
8	002127	南极电商	2,608,294	31,794,981.96	2.94
9	600754	锦江酒店	900,000	29,061,000.00	2.68
10	600285	首航酒店	1,000,000	26,990,000.00	2.49

(4) 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	150201	15国开01	520,000	51,994,800.00	4.80
2	010107	21国债(7)	300,000	30,114,000.00	2.78
3	170401	17农发01	300,000	29,994,000.00	2.77
4	150207	15国开07	300,000	29,982,000.00	2.77
5	150406	15农发06	300,000	29,961,000.00	2.77

(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十名资产支持证券投资明细

本系列基金本报告期末未持有资产支持证券。

(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

本系列基金本报告期末未持有贵金属。

(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

本系列基金本报告期末未持有权证。

(9) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有股指期货。

2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

3) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

(10) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1) 本期国债期货投资政策

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

3) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 投资组合报告附注

1) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2) 基金投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

3) 宝康消费品证券投资基金

(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	223,922,761.37	62.76
	其中:股票	223,922,761.37	62.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,906,400.00	23.24
	其中:债券	82,906,400.00	23.24
	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	48,405,641.48	13.57
8	其他资产	1,561,020.38	0.44
9	合计	366,796,823.23	100.00

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本系列基金本报告期末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存在流通受限情况的说明

本系列基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

2) 宝康消费品证券投资基金

(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	223,922,761.37	62.76
	其中:股票	223,922,761.37	62.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,906,400.00	23.24
	其中:债券	82,906,400.00	23.24
	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	48,405,641.48	13.57
8	其他资产	1,561,020.38	0.44
9	合计	366,796,823.23	100.00

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本系列基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(2) 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	509,634.00	0.14
B	采矿业	6,197,159.40	1.76
C	制造业	97,281,367.23	27.40
D	电力、热力、燃气及生产	4,763,240.30	1.34
	和供应业	-	-
E	建筑业	7,774,912.98	2.19
F	批发和零售业	4,024,288.61	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	5,901,945.96	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	12,778,141.15	3.60
	服务业	-	-
J	金融业	64,747,582.21	18.24
K	房地产业	15,479,550.98	4.36
L	租赁和商务服务业	1,442,602.66	0.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理	1,340,787.17	0.38
	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	19,683.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,480,711.04	0.42
S	综合	191,620.00	0.05
	合计	223,922,761.37	63.08

2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本系列基金本报告期末未持有港股通投资股票。

(3) 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	601318	中国平安	196,386	13,673,112.28	3.85
2	300409	通达科技	180,000	8,182,800.00	2.30
3	600519	贵州茅台	8,616	6,009,573.84	1.69
4	600036	招商银行	182,319	5,290,897.38	1.49
5	002277	久谦远恒	150,000	5,082,000.00	1.43
6	000537	广宇发展	350,000	4,469,500.00	1.26
7	000333	美的集团	79,181	4,389,002.83	1.24
8	601166	兴业银行	219,231	3,724,734.69	1.06
9	000002	万科A	119,851	3,722,572.06	1.06
10	000651	格力电器	84,240	3,681,288.00	1.04

(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	国债债券	23,067,400.00	6.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,819,000.00	16.85
	其中:政策性金融债	59,819,000.00	16.85
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,906,400.00	23.35

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

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	010107	21国债(7)	230,000	23,067,400.00	6.50
2	170413	17农发13	200,000	19,880,000.00	5.60
3	130425	13农发25	100,000	10,007,000.00	2.82
4	170401	17农发01	100,000	9,998,000.00	2.82
5	150406	15农发06	100,000	9,987,000.00	2.81

(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

本系列基金本报告期末未持有资产支持证券。

(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

本系列基金本报告期末未持有贵金属。

(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

本系列基金本报告期末未持有权证。

(9) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有股指期货。

2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

3) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

(10) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1) 本期国债期货投资政策

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

3) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本系列基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 投资组合报告附注

1) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2) 基金投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

3) 宝康消费品证券投资基金

(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	223,922,761.37	62.76
	其中:股票	223,922,761.37	62.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,906,400.00	23.24
	其中:债券	82,906,400.00	23.24
	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	2,034,775.79	0.81
8	其他资产	5,230,849.62	2.07
9	合计	252,542,288.51	100.00

(2) 报告期末按行业分类的股票投资组合

本系列基金本报告期末未持有股票。

1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

6	买入返售金融资产	16,500,000.00	6.53
	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	2,034,775.79	0.81
8	其他货币资金	5,230,849.62	2.07
9	合计	262,542,238.51	100.00

(2) 报告期末未按行业分类的股票投资组合

1) 报告期末未按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未有股票。

2) 报告期末未按公允价值分类的债券投资组合

本基金本报告期末未有通过证券交易所交易股票。

3) 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明细

(3) 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