

(上接B04版)
4、买入其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的债券;
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得低于20%;

2、各基金投资于股票的比例不得低于该基金资产总值的80%;

3、各基金持有同一上市公司的股票,不得超过该基金资产净值的10%;

4、各基金以其管理人持有的其他基金持有的上市公司股票为限,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总资产的10%;

6、本基金将根据法律法规的规定,在基金合同约定的范围内进行调整。

7、本公司运用基金财产进行权证投资时,将严格参照证监会的有关规定,进行管理和控制。

(1)一只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;

(2)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三;

(3)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、股权质押等支付对价等基金管理人员之外的因素致使基金投资不符合上述2、3条或《基金合同》约定的投资比例的,基金管理人在10个交易日内进行调整,以达到标准。

6、本公司运用基金财产进行权证投资时,将严格参照证监会的有关规定,进行管理和控制。

(1)一只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;

(2)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三;

(3)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。

7、法律法规或监管部门对上述比例限制有规定的,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、不谋求上市公司的控制权,不参与所投资上市公司的经营管理;

2、有利于基金财产的安全与增值;

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资人的利益。

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,本报告中所列财务数据未经审计。

(一) 宝盈消费精选证券投资基金

(1) 报告期末未持有基金的情况

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	
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	52,695,701.30	4.85
8	其他资产	8,191,690.26	0.75
9	合计	1,089,933,869.41	100.00

(2) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	509,634.00	0.14
B	采掘业	6,197,594.09	1.75
C	制造业	97,281,367.23	27.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,753,240.30	1.34
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	5,901,045.95	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,778,141.15	3.60
J	金融业	64,747,582.21	18.24
K	房地产业	15,479,550.00	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业	1,340,787.17	0.38
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股票投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。			
-------------------	--	--	--

(3) 基金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	债券代码	债券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	196,386,137	13,673,112.28	3.88
2	300409	道氏技术	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	192,319	5,290,897.39	1.49
5	002777	远航能源	150,000	5,082,000.00	1.43
6	000657	广宇发展	350,000	4,469,500.00	1.26
7	000333	美的集团	79,181	4,389,028.83	1.24
8	601169	兴业银行	219,231	3,724,734.69	1.05
9	000001	万科A	119,851	3,722,572.06	1.05
10	000661	格力电器	84,240	3,681,260.00	1.04
合计			52,695,701.30	4.85	

(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	23,087,400.00	6.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,819,000.00	16.85
4	其中:政策性金融债	69,819,000.00	16.85
5	企业债券	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转换(可交换)债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,906,400.00	23.35

(5) 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	230040	道氏技术	23,087,400.00	6.50	
2	010107	21国债	230,000	23,067,400.00	6.50
3	170413	17农发	200,000	19,890,000.00	5.60
4	170401	17农发	100,000	9,998,000.00	2.82
5	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
6	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
7	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
8	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
9	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
10	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
11	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
12	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
13	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
14	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
15	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
16	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
17	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
18	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
19	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
20	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
21	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
22	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
23	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
24	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
25	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
26	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
27	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
28	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	2.81
29	150406	15农发	100,000	9,987,000.00	