华宝兴业宝康系列证券投资基金

2008年第三季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年10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2008年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

宝康系列开放式证券投资基金目前由风险收益特征不同、投资策略和目标不同的宝康消费品证券投资基金、宝康灵活配置证券投资基金和宝康债券投资基金等三只基金构成,每只基金彼此独立,通过低费率而且高效率的相互转换构成一个有机的基金体系。

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2003年7月15日

2.1 宝康消费品证券投资基金产品概况

基金简称:	宝康消费品
交易代码:	240001
报告期末基金份额总额:	2,311,833,133.33份
投资目标:	分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长;为基金份额持有人谋求长期稳定回报。
投资策略:	本基金看好消费品的发展前景,长期持有消费品组合,并注重资产在其各相关行业的配置,适当进行时机选择。
业绩比较基准:	上证180指数和深证100指数的复合指数×80%+中信全债指数×20%。 复合指数=(上证180流通市值/成分指数总流通市值)×上证180指数+(深圳100流通市值/成分指数总流通市值)×深证100指数 成分指数总流通市值=上证180流通市值+深圳100流通市值

2.2 宝康灵活配置证券投资基金产品概况

基金简称:	宝康灵活配置
交易代码:	240002
报告期末基金份额总额:	1,850,423,129.34份
投资目标:	规避系统风险,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期报酬。
投资策略:	本基金采用资产灵活配置策略,以债券投资为基础,并把握股市重大投资机会,获取超额回报,同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
业绩比较基准:	65%中信全债指数+35%上证180指数和深圳100指数的复合指数。 复合指数=(上证180流通市值/成分指数总流通市值)×上证180指数+(深圳100流通市值/成分指数总流通市值)×深证100指数 成分指数总流通市值=上证180流通市值+深圳100流通市值

2.3 宝康债券投资基金产品概况

基金简称:	宝康债券
交易代码:	240003
报告期末基金份额总额:	4,983,896,693.67份
投资目标:	在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金财产安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略:	本基金将采用类属配置、久期偏离、收益率曲线配置和特定券种选择等积极投资策略,并把握市场创新机会。
业绩比较基准:	中信全债指数。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 宝康消费品基金主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2008年07月01日-2008年9月30日)
1.本期已实现收益	-377,503,672.97
2.本期利润	-322,068,052.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1369
4.期末基金资产净值	2,225,679,219.05
5.期末基金份额净值	0.9627

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.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。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 本报告期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

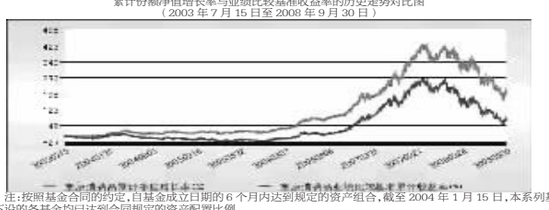
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	-12.35%	2.09%	-15.15%	2.36%	2.80%	-0.27%

3.1.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华宝兴业宝康消费品证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年7月15日至2008年9月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2004年1月15日,本系列基金下设的各基金均已达到合同规定的资产配置比例。

3.2 宝康灵活配置基金主要财务指标和基金净值表现

3.2.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2008年07月01日-2008年9月30日)
1.本期已实现收益	-194,133,407.31
2.本期利润	-302,608,412.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1677
4.期末基金资产净值	2,100,634,592.32
5.期末基金份额净值	1.1352

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 本报告期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

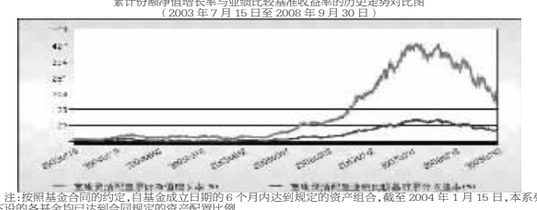
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	-13.04%	2.10%	-4.98%	1.02%	-8.06%	1.08%

3.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年7月15日至2008年9月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2004年1月15日,本系列基金下设的各基金均已达到合同规定的资产配置比例。

3.3 宝康债券基金主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2008年07月01日-2008年9月30日)
1.本期已实现收益	-36,991,302.27
2.本期利润	38,785,941.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062
4.期末基金资产净值	5,740,124,959.81
5.期末基金份额净值	1.1517

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.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。

3.3.2 基金净值表现

3.3.2.1 本报告期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

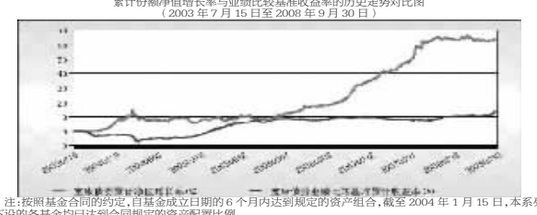
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	0.64%	0.10%	2.93%	0.12%	-2.29%	-0.02%

3.3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华宝兴业宝康债券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年7月15日至2008年9月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2004年1月15日,本系列基金下设的各基金均已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理简介

4.1.1 宝康消费品基金基金经理简介

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		
闫旭	本基金基金经理、行业精选基金基金经理	2008-04-25	-	8年	硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作,2004年10月进入本公司,先后任多策略增长基金基金经理助理、宝康消费品基金基金经理助理。2007年6月至2008年9月23日期间任行业精选基金经理。

4.1.2 宝康灵活配置基金基金经理简介

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		
魏东	本基金基金经理,先进成长基金基金经理,公司投资副总监,公司国内投资部总经理	2004-05-17	-	11年	硕士。1997年至2002年,在平安证券公司、国信证券有限责任公司和深圳市深投科技创业投资有限公司从事证券研究工作和资产管理等工作。2003年初加入本公司,曾任交易部总经理,2006年11月起任先进成长基金基金经理。

4.1.3 宝康债券基金基金经理简介

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		
王旭巍	本基金基金经理	2003-07-15	-	15年	硕士。1993年起在中国(深圳)物资工贸集团有限公司、宏达期货经纪有限公司、中信证券股份有限公司从事交易、投资、资产管理业务。2003年初加入本公司,2005年3月到2007年2月期间兼任现金宝货币市场基金基金经理。

4.2 报告期内本系列基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,进行了交易价差分析和异常交易行为监控系统开发,加强了对所管理的不同投资组合的收益率差异和同向交易价差的分析,以及异常交易行为的监控。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本系列基金下设的各基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本系列基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 宝康消费品基金

2008年三季度市场继续呈现下跌走势,指数跌幅超过20%。期间有投资者对未来经济前景悲观预期的因素,同时海外金融市场的大幅震荡也给国内市场带来更大的不确定性。国内从紧的调控政策也随着CPI的回落而逐渐趋于放松,并随之出台了降低交易印花税、鼓励上市公司大股东增持公司股份等稳定金融市场的措施。期间石化、铁路运输、证券存在正收益,食品饮料、公用事业等行业表现相对较好,而采掘、有色、信息设备等行业跌幅相对较大。

本基金在三季度减持了部分银行、保险等金融股,而证券股在金融资净制度推行的预期下取得了较高的超额收益。期间本基金继续增持了啤酒、蛋白饮料等部分食品饮料类个股,在减持了部分化学原料药的同时增持了部分现代中药类企业,同时增持了部分农业及信息服务类个股。

在美国金融危机蔓延、全球金融动荡的背景下,国内的宏观调控措施也趋于更加积极灵活,降低交易印花税、降息、鼓励上市公司大股东增持股份等一系列稳定金融与经济的措施陆续推出。而刚刚召开的十七届三中全会也提出要"采取灵活审慎的宏观经济政策,着力扩大国内需求特别是消费需求,保持经济稳定、金融稳定、资本市场稳定"。

以农村改革为主题的十七届三中全会提出,建立健全农村土地承包经营权流转市场,完善农村宅基地制度,改革征地制度,建立现代农村金融制度。我们相信,十七届三中全会将了有力推进农村改革,从而启动中国经济新一轮,可持续的增长,未来较差的经济能见度似乎变得日渐清晰。

但面对证券市场,我们在未来一段时间内可能仍面临企盈利下滑的问题,而在估值水平已大幅回落的情景下,我们也又一次面对实证资本与金融资本的博弈。我们相信,如果从实证资本层面看,企业已具有了足够的收购价值,或许这个时候我们就不应该一味地惟怕"趋势"的力量。而对于我们机构投资者,重要的是寻找到足够的安全边际,知道企业的价值底线在哪里,股市的波动只是给我们提供了有更高安全边际的机会。未来经济增长的过程中结构会较以往有所变化,在投资中我们仍关注那些真正有创新能力,能够提高整体经济效率的环节中孕育出优秀的企业。同时,我们也关注进一步解放农村生产力带来的相关投资机会,并在股市的波动寻找价值底线。

感谢持有人一直以来对我们的支持,在后续投资中,我们将继续总结经验,勤勉尽责,努力实现消费品基金的良好表现。

4.4.2 宝康灵活配置基金

在过去的一个季度,投资者对全球经济衰退的担忧不断加剧,金融创新和衍生品的迅猛发展使得实体经济的下滑趋势在金融市场被无尽的放大,导致全球金融市场的巨大波动。虽然我们没有次贷,我们的银行业务也较为传统,即使在经济出现下滑的过程中,也不会有类似国外银行破产的风险,但国际市场近期的大幅下跌还是严重影响了A股市场的投资者情绪,上证指数在本阶段创下1802点新低。随后政府出台的救市政策以及上市公司不断增持股份给市场带来了一些信心,但在短暂的反弹之后,A股再次受到国际市场恐慌性下跌的影响,走势持续低靡。降印花税、汇金入市到推出融资融券,以及后续可能还将陆续推出的其他政策,这些都体现了政府稳定资本市场的决心,另外货币政策放松的基调已经非常明确,保增长将成为后续经济工作的重点,这些对于投资者信心的恢复都是较为积极的。

三季度我们保持了比较稳定的仓位,延续了我们二季度末对市场较为理性的判断。但是我们没有预料到国外市场的这场金融风暴来得如此剧烈,而A股投资者对中国经济的悲观预期也不断超出我们的想象,我们的基金净值伴随大盘系统性的下跌,遭受了较大的损失。

往后看,中国能否减缓经济下滑的趋势,以及全球金融市场能否企稳将成为我们判断A股市场能否过渡到平稳状态的重要依据。在投资上,我们将坚持以下几点:第一,努力配置估值低且增长确定的品种,抵御市场的不确定性波动;第二,估值体系崩溃的环境下,从企业的内在价值角度去挖掘长期有竞争力的个股;第三,阶段性的把握周期性行业的投资机会,尤其是政府出台刺激经济政策下的投资机会;第四,把握好弱市中的主题投资机会,比如政策预期较明确的农业、节能减排等。

灵活配置基金的特点是指数化配置加精选个股策略,在不明确的市场中通过配置优质个股来优化组合,而一旦认为市场趋于明朗,我们也会积极的选时,调整仓位。的确,目前的市场,从长期来看可能是个底部,但短期情绪化的趋势投资掩盖了价值投资的思维理念,所以我们只有看得更长远些,才能从这轮金融危机中找回信心。

4.4.3 宝康债券基金

三季度证券市场如同一台大戏,各幕悲喜剧你唱罢来我登场,令人眼花缭乱。美国次贷危机演变成了全球金融海啸,其剧烈程度百年不遇。在这场风暴中经历过一百五十八年风风雨雨的老牌投行雷曼兄弟公司瞬间倒下,不免令人伤感,在从事债券业务的同行心目中雷曼兄弟如同教父,他的灭亡着实使我们对市场力量和市场风险产生了深深敬畏。在国内,国人向全世界展示了一届完美无缺的奥运会,但人们期盼的奥运行情并没有来临,相反三季度沪指又跌去近一千点。面对财富缩水,更多的只是无奈和遗憾,而债券市场的颓丽表现,似乎让投资者在凛冽的寒风中感受到一丝暖意和安慰。

相关数据显示美国已进入经济衰退,中国也不能独善其身,经济下行风险增大,贷款增速减缓,出口增速下降,CPI指数快速回落,全国用电量也在减少,股市下跌隐含了市场对经济下行的担忧。与此相对应,三季度以来货币政策也发生了重大改变,由上半年的从紧到目前趋于放松,9月16日人民银行调降"双率",使市场预期降息周期开始,促成债市上涨。宝康债券基金按照三季度末制定的投资计划,继续降低风险资产比例,处置上半年新股,增发所留存的股票,目前风险资产配置比例控制在一个百分点左右;减少现金比例,增加债券配置;在保障组合流动性的前提下适当加长债券组合的久期,目前仍以配置1-3年期限央票为主;遵循行业分散、个券分散的配置原则,主要通过一级市场增持企业债。得益于债市上涨,三季度本基金取得了正收益,弥补了上半年大部分净值损失。四季度我们将稳健运作,控制风险,确保基金持有人本金安全。

截止本文交稿,包括中国在内全球七国央行联手同时减息,这是史无前例的举措,企图挽救市场信心,但股市仍在下跌,资本大戏仍在上演,远未到散场的时候。我们所能做的正如王歧山副总理最近所说的那样,最重要的是把自己的事情办好。

§5 投资组合报告

5.1 宝康消费品基金投资组合报告

5.1.1 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	1,499,393,221.70	66.30
	其中:股票	1,499,393,221.70	66.30
2	固定收益投资	501,160,305.20	22.16
	其中:债券	501,160,305.20	22.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	2,049,163.45	0.09
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	224,373,702.63	9.92
6	其他资产	34,615,471.99	1.53
7	合计	2,261,591,864.97	100.00

5.1.2 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	53,161,156.25	2.39
B	采掘业	215,708,133.12	9.69
C	制造业	451,122,048.78	20.27
C0	食品、饮料	175,767,716.54	7.90
C1	纺织、服装、皮毛	8,063,120.16	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	65,961,921.44	2.96
C7	机械、设备、仪表	134,045,617.30	6.02
C8	医药、生物制品	67,283,673.34	3.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	46,766,101.34	2.10
E	建筑业	69,264,000.00	3.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	140,630,780.57	6.32
H	批发和零售贸易	155,415,769.25	6.98
I	金融、保险业	126,847,171.80	5.70
J	房地产业	190,019,514.36	8.54
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	50,458,546.23	2.27
M	综合类	-	-
	合计	1,499,393,221.70	67.37

5.1.3 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	600737	中粮屯河	8,699,303	94,561,423.61	4.25
2	600030	中信证券	3,699,805	91,607,171.80	4.12
3	000800	一汽轿车	10,229,796	69,562,612.80	3.13
4	601186	中国铁建	7,400,000	69,264,000.00	3.11
5	600058	五矿发展	3,601,178	65,217,333.58	2.93
6	601808	中海油服	3,839,400	59,395,518.00	2.67
7	600880	博瑞传播	4,125,801	50,458,546.23	2.27
8	600570	恒生电子	4,427,886	50,300,784.96	2.26
9	000402	金融街	5,544,976	48,241,291.20	2.17
10	600900	长江电力	5,099,902	46,766,101.34	2.10

5.1.4 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	366,137,000.00	16.45
3	金融债券	131,631,000.00	5.91
	其中:政策性金融债	131,631,000.00	5.91
4	企业债券	3,392,305.20	0.15
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	501,160,305.20	22.52

5.1.5 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	0801041	08央行票据41	1,500,000	151,920,000.00	6.83
2	0701121	07央票121	900,000	86,634,000.00	3.89
3	040220	04国开(20)	800,000	79,976,000.00	3.59
4	0801098	08央行票据98	800,000	76,928,000.00	3.46
5	080215	08国开15	500,000	51,655,000.00	2.32

5.1.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 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	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580026	江铜权证	1,254,078	2,049,163.45	0.09

5.1.8 投资组合报告附注

5.1.8.1 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,无证券投资决策程序需特别说明。

5.1.8.2 本基金主要投资对象为消费品类股票,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

5.1.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,370,050.40
2	应收证券清算款	22,492,556.70
3	应收股利	-
4	应收利息	7,851,961.85
5	应收申购款	884,143.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	16,759.90
8	其他	-
9	合计	34,615,471.99

5.1.8.4 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。

5.1.8.5 报告期末前十名股票中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)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	46,766,101.34	2.10	重大资产重组

5.2 宝康灵活配置基金投资组合报告

5.2.1 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	1,465,289,850.17	68.59
	其中:股票	1,465,289,850.17	68.59
2	固定收益投资	528,121,737.58	24.72
	其中:债券	528,121,737.58	24.72
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	121,254,283.85	5.68
6	其他资产	21,516,886.45	1.01
7	合计	2,136,182,758.05	100.00

5.2.2 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	4,140,000.00	0.20
B	采掘业	69,752,982.03	3.32
C	制造业	571,006,344.11	27.18
C0	食品、饮料	90,883,489.11	4.33
C1	纺织、服装、皮毛	11,928,000.00	0.57
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,290,000.00	0.78
C4	石油、化学、塑胶、塑料	115,668,847.00	5.51
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	75,890,800.00	3.61
C7	机械、设备、仪表	213,240,614.90	10.15
C8	医药、生物制品	47,104,593.10	2.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	27,510,000.00	1.31
E	建筑业	81,540,000.00	3.88
F	交通运输、仓储业	45,045,000.00	2.14
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	137,286,424.03	6.54
I	金融、保险业	387,868,000.00	18.46
J	房地产业	36,297,600.00	1.73
K	社会服务业	43,065,000.00	2.05
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	61,778,500.00	2.94
	合计	1,465,289,850.17	69.75

5.2.3 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	600309	烟台万华	7,200,088	91,657,120.24	4.36
2	600036	招商银行	4,500,000	79,290,000.00	3.77
3	600000	浦发银行	5,000,000	78,100,000.00	3.72
4	000001	深发展A	4,600,000	68,954,000.00	3.28
5	600895	张江高科	6,650,000	61,778,500.00	2.94
6	600030	中信证券	2,200,000	54,472,000.00	2.59
7	000338	潍柴动力	1,299,910	50,553,499.90	2.41
8	601186	中国铁建	5,000,000	46,800,000.00	2.23
9	601398	工商银行	10,000,000	43,500,000.00	2.07
10	000069	华侨城A	4,500,000	43,065,000.00	2.05

5.2.4 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	179,442,000.00	8.54
2	央行票据	346,335,000.00	16.49
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	111,905.38	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	2,232,832.20	0.11
7	其他	-	-
8	合计	528,121,737.58	25.14

5.2.5 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	0801019	08央行票据19	1,900,000	182,780,000.00	8.70
2	010115	21国债(5)	1,000,000	100,050,000.00	4.76
3	0801028	08央行票据28	1,000,000	96,180,000.00	4.58
4	010210	02国债(10)	800,000	79,392,000.00	3.78
5	0701133	07央行票据133	700,000	67,375,000.00	3.21

5.2.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 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,无证券投资决策程序需特别说明。

5.2.8.2 本基金股票主要投资对象为上证180指数、深圳100指数的成分股。本基金投资的前十名股票均为合同规定的成分股。

5.2.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	980,247.70
2	应收证券清算款	8,693,602.82
3	应收股利	-
4	应收利息	11,498,536.51
5	应收申购款	327,739.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	16,759.90
8	其他	-
9	合计	21,516,886.45

5.2.8.4 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。

5.2.8.5 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情况。

5.3 宝康债券基金投资组合报告

5.3.1 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	65,946,243.81	1.07
	其中:股票	65,946,243.81	1.07
2	固定收益投资	5,956,881,201.20	96.71
	其中:债券	5,956,881,201.20	96.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	3,073,745.18	0.05
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	5,202,161.72	0.08
6	其他资产	128,290,245.98	2.08
7	合计	6,159,393,597.89	100.00

5.3.2 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	-	-
B	采掘业	11,910,000.00	0.21
C	制造业	41,401,457.47	0.72
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,245,215.26	0.02
C5	电子	272,625.00	0.00
C6	金属、非金属	24,918,500.00	0.43
C7	机械、设备、仪表	10,787,888.46	0.19
C8	医药、生物制品	4,177,228.75	0.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	500,509.26	0.01
E	建筑业	9,360,000.00	0.16
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	726,599.94	0.01
H	批发和零售贸易	2,047,677.14	0.04
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	65,946,243.81	1.15

5.3.3 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	600585	海螺水泥	950,000	24,918,500.00	0.43
2	601958	金钼股份	1,000,000	11,910,000.00	0.21
3	601766	中国南车	2,747,898	9,617,643.00	0.17
4	601186	中国铁建	1,000,000	9,360,000.00	0.16
5	600557	康缘药业	214,400	3,586,912.00	0.06
6	002269	美邦服饰	59,612	1,520,106.00	0.03
7	002263	大东南	146,639	718,531.10	0.01
8	002252	上海莱士	27,141	590,316.75	0.01
9	002261	拓维信息	23,911	557,126.30	0.01
10	002258	利尔化学	51,434	526,684.16	0.01

5.3.4 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	10,043,000.00	0.17
2	央行票据	5,789,977,000.00	100.87
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	105,711,801.20	1.84
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	51,149,400.00	0.89
7	其他	-	-
8	合计	5,956,881,201.20	103.78

5.3.5 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	0801034	08央行票据34	16,000,000	1,538,560,000.00	26.80
2	0801047	08央行票据47	11,000,000	1,114,190,000.00	19.41
3	0801065	08央行票据65	10,000,000	1,013,400,000.00	17.65
4	0801028	08央行票据28	4,000,000	384,720,000.00	6.70
5	0801044	08央行票据44	3,300,