

【重要提示】

- 1) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 2) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 3) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 4) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 5) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 6) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 7) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 8) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 9) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 10) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 11) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 12) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 13) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 14) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 15) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 16) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 17) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 18) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 19) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 20) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 21) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 22) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 23) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 24) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 25) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 26) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 27) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 28) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 29) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 30) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 31) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 32) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 33) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 34) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 35) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 36) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 37) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 38) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 39) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 40) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 41) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 42) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 43) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 44) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 45) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 46) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 47) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 48) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 49) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 50) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 51) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 52) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 53) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 54) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 55) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 56) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 57) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 58) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 59) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 60) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 61) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 62) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 63) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 64) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 65) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 66) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 67) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 68) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 69) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 70) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 71) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 72) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 73) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 74) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 75) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 76) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 77) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 78) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 79) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 80) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 81) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 82) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 83) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 84) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 85) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 86) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 87) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 88) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 89) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 90) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 91) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 92) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 93) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 94) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 95) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 96) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 97) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 98) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 99) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额
- 100) 报告期末持有处于转股期的可转换债券余额

3. 宝盈货币投资基金

4) 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	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	27,968,527.66	3.13
	其中:股票	27,968,527.66	3.13
2	固定收益投资	741,161,914.62	82.89
	其中:债券	741,161,914.62	82.89
	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	60,586,451.90	6.78
6	其他资产	64,474,500.68	7.21
7	合计	894,191,394.86	100.00

5) 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	2,185,984.89	0.25
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,605,376.62	1.53
C0	食品、饮料	1,185,775.98	0.13
C1	纺织、服装、皮毛	421,982.40	0.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	917,881.38	0.10
C5	电子、电器、通讯	2,634,783.70	0.30
C6	金属、非金属	13,275.00	0.00
C7	机械、设备、仪器	5,129,133.63	0.58
C8	医药、生物制品	3,302,544.53	0.37
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,099,828.32	0.12
E	建筑业	671,430.48	0.08
F	交通运输、仓储业	1,701,520.28	0.19
G	信息技术业	2,726,064.86	0.31
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,514,239.62	0.51
L	传播与文化业	1,464,072.59	0.16
M	综合类	-	-
	合计	27,968,527.66	3.15

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权证投资明细

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	601299	中国北车	547,152	3,354,041.76	0.38
2	300006	莱英药业	83,371	2,787,092.53	0.31
3	601117	中国化学	487,136	2,645,148.48	0.30
4	002321	华英农业	82,149	2,185,984.89	0.25
5	300032	金发科技	58,838	1,753,372.40	0.20
6	002320	海味股份	33,246	1,701,520.28	0.19
7	300027	华冠兄弟	26,413	1,464,072.59	0.16
8	002311	海天集团	31,587	1,185,775.98	0.13
9	601139	深圳燃气	65,544	1,099,828.32	0.12
10	601888	中国国旅	44,679	935,578.26	0.11

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债券投资明细

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	央行票据	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	国债	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	国债	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	国债	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

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资产投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

9) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

10) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

11) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

12) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

13) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

14) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

15) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

16) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

17) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

18) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	4.63
5	070420	07央行发20	400,000	40,240,000.00	4.53

19) 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权证投资明细

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	1,200,000	123,492,000.00	13.89
2	070215	07切让15	600,000	61,848,000.00	6.96
3	0901067	09央行票据67	500,000	49,835,000.00	5.61
4	0801038				