

# 华夏国企改革灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第四季度报告

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 6 投资组合报告

#### 6.1 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	472,294,307.66	76.11
2	其中:股票	472,294,307.66	76.11
3	固定收益投资	18,128,000.00	2.98
4	其中:债券	18,128,000.00	2.98
5	货币市场投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	620,523,547.71	100.00

#### 6.2 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)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	6,129,462.09	1.00
B	房地产业	215,406,472.87	35.62
C	制造业	20,070,708.00	3.29
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	17,082,000.00	2.80
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	91,085,521.12	14.90
G	交通运输、仓储和邮政业	6,392,248.89	1.05
H	信息传输、软件和信息技术服务业	14,908,429.63	2.44
I	金融业	11,889,522.00	1.95
J	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
K	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
L	其他	6,269,206.24	1.04
合计		472,294,307.66	77.27

#### 6.3 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	000003	中兴通讯	1,306,336	26,546,626.85	4.39
2	603869	通惠泵	500,000	23,700,000.00	3.92
3	600116	三钢闽光	2,741,000	20,070,708.00	3.29
4	002230	科大讯飞	77,500	59,100,000.00	9.68
5	002516	深信服	235,100	18,467,360.00	3.02
6	000032	际华集团	681,771	18,429,160.00	3.02
7	000006	万科A	602,600	17,082,000.00	2.80
8	000007	潍柴动力	1,289,700	17,082,000.00	2.80
9	600034	广田集团	400,100	36,226,000.00	5.95
10	600486	横店影视	670,000	36,226,000.00	5.95

#### 6.4 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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	中兴通讯	1,306,336	26,546,626.85	4.39
2	603869	通惠泵	500,000	23,700,000.00	3.92
3	600116	三钢闽光	2,741,000	20,070,708.00	3.29
4	002230	科大讯飞	77,500	59,100,000.00	9.68
5	002516	深信服	235,100	18,467,360.00	3.02
6	000032	际华集团	681,771	18,429,160.00	3.02
7	000006	万科A	602,600	17,082,000.00	2.80
8	000007	潍柴动力	1,289,700	17,082,000.00	2.80
9	600034	广田集团	400,100	36,226,000.00	5.95
10	600486	横店影视	670,000	36,226,000.00	5.95

#### 6.5 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

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	000003	中兴通讯	1,306,336	26,546,626.85	4.39
2	603869	通惠泵	500,000	23,700,000.00	3.92
3	600116	三钢闽光	2,741,000	20,070,708.00	3.29
4	002230	科大讯飞	77,500	59,100,000.00	9.68
5	002516	深信服	235,100	18,467,360.00	3.02
6	000032	际华集团	681,771	18,429,160.00	3.02
7	000006	万科A	602,600	17,082,000.00	2.80
8	000007	潍柴动力	1,289,700	17,082,000.00	2.80
9	600034	广田集团	400,100	36,226,000.00	5.95
10	600486	横店影视	670,000	36,226,000.00	5.95

#### 6.6 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贵金属投资明细

本基金持有的股票				
序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	占基金资产比例(%)
1	中兴通讯	1,306,336	26.54662685	4.39
2	通惠泵	500,000	23.70000000	3.92
3	三钢闽光	2,741,000	20.07070800	3.29
4	科大讯飞	77,500	59.10000000	9.68
5	深信服	235,100	18.46736000	3.02
6	际华集团	681,771	18.42916000	3.02
7	万科A	602,600	17.08200000	2.80
8	潍柴动力	1,289,700	17.08200000	2.80
9	广田集团	400,100	36.22600000	5.95
10	横店影视	670,000	36.22600000	5.95

#### 6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	000003	中兴通讯	1,306,336	26,546,626.85	4.39
2	603869	通惠泵	500,000	23,700,000.00	3.92
3	600116	三钢闽光	2,741,000	20,070,708.00	3.29
4	002230	科大讯飞	77,500	59,100,000.00	9.68
5	002516	深信服	235,100	18,467,360.00	3.02
6	000032	际华集团	681,771	18,429,160.00	3.02
7	000006	万科A	602,600	17,082,000.00	2.80
8	000007	潍柴动力	1,289,700	17,082,000.00	2.80
9	600034	广田集团	400,100	36,226,000.00	5.95
10	600486	横店影视	670,000	36,226,000.00	5.95

#### 6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

## 2018年第四季度报告

#### 6.9 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	000003	中兴通讯	1,306,336	26,546,626.85	4.39
2	603869	通惠泵	500,000	23,700,000.00	3.92
3	600116	三钢闽光	2,741,000	20,070,708.00	3.29
4	002230	科大讯飞	77,500	59,100,000.00	9.68
5	002516	深信服	235,100	18,467,360.00	3.02
6	000032	际华集团	681,771	18,429,160.00	3.02
7	000006	万科A	602,600	17,082,000.00	2.80
8	000007	潍柴动力	1,289,700	17,082,000.00	2.80
9	600034	广田集团	400,100	36,226,000.00	5.95
10	600486	横店影视	670,000	36,226,000.00	5.95

#### 6.10 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商品期货投资明细

房地产龙头企业逆市进行巨额再融资进一步打击了投资者信心。但从11月中开

#### 6.11 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贵金属投资明细

物在极度悲观的环境下正趋反弹。11月底至12月中,若干只中小型优质房企以较低价发行超短期债券,加上境内货币放松和融资环境进一步放松的措施陆续公

#### 6.12 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

报告期内,本基金操作上仍以调仓换券,增加中资债券投资为主,增配了受益于政策确定性提升的公司债及期票类债券。根据信用风险评级变化的行业及流动性变化

#### 6.13 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股指期货投资明细

积极参与配置。4季度,本基金进一步减持了非中资的高收益债券,尤其是与大宗

#### 6.14 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国债期货投资明细

截至2018年12月31日,华夏收益债券(QDII)A基金份额净值为1.246元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.00%,同期业绩比较基准收益率为0.00%,基金份额持有人每持有10份基金份额,报告期内基金份额净值增长0.00元。

#### 6.15 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商品期货投资明细

期份额净值增长率为-1.06%,同期业绩比较基准增长率为0.69%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明