

泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

本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。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	27,680,902.64	8.91
2	固定收益投资	277,331,524.81	89.26
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	277,331,524.81	89.26
5	银行存款和结算备付金合计	—	—
6	其他资产	6,462,136.24	2.13
7	负债和所有者权益合计	309,474,559.69	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为12,050,385.42元，占期末资产净值比例为3.90%。

5.2 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	采矿业	200,130.00	0.09
C	制造业	14,812,262.30	6.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	982,263.42	0.42
F	批发和零售业	30,263,300.00	12.26
G	交通运输、仓储和邮政业	107,381,500.00	47.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	617,799,022.27	0.27
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	教育、文体和娱乐业	286.00	0.00
P	综合	—	—
Q	其他	16,630,517.22	6.07

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为12,050,385.42元，占期末资产净值比例为3.90%。

5.3 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

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	170215	17年国投	200,000	20,642,000.00	9.07
2	10751036	10年国投	200,000	20,564,000.00	9.04
3	139417	13年国投	146,000	14,588,320.00	6.01
4	011801455	18年国投	100,000	10,470,800.00	5.31
5	10751038	17年国投	100,000	10,464,000.00	4.60

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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债券投资

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	001719	国投转债	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	3,003,600.00	1.32
2	央行票据	—	—
3	金融债	49,932,000.00	21.59
4	企业债	58,303,800.00	25.63
5	企业短期融资券	30,263,300.00	12.26
6	中期票据	107,381,500.00	47.29
7	可转债(可交换债)	19,447,504.80	8.56
8	国债存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	277,331,524.81	121.91

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.6 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

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	170215	17年国投	200,000	20,642,000.00	9.07
2	10751036	10年国投	200,000	20,564,000.00	9.04
3	139417	13年国投	146,000	14,588,320.00	6.01
4	011801455	18年国投	100,000	10,470,800.00	5.31
5	10751038	17年国投	100,000	10,464,000.00	4.60

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.7 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

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	001719	国投转债	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.8 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

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.9 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股票投资

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	170215	17年国投	200,000	20,642,000.00	9.07
2	10751036	10年国投	200,000	20,564,000.00	9.04
3	139417	13年国投	146,000	14,588,320.00	6.01
4	011801455	18年国投	100,000	10,470,800.00	5.31
5	10751038	17年国投	100,000	10,464,000.00	4.60

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

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	000519	贵州茅台	12,000	7,462,128.00	3.32
2	002688	金隅转债	726,200	4,456,312.00	1.96
3	02232	万科企业	120,000	2,797,200.00	1.23
4	001661	格力电器	67,420	2,162,079.00	0.96
5	002990	招商转债	55,500	1,947,020.00	0.87
6	603285	海天味业	25,126	1,729,288.00	0.76
7	600300	万华化学	49,500	1,385,505.00	0.61
8	010109	国药控股	34,074	882,353.42	0.43
9	00094	北京首都机场	102,000	742,540.00	0.31

注：对于同时存在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

序号
