

浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

§ 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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	119,987,683.00	88.55
1.1	其中：股票	119,987,683.00	88.55
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	7,173,424.80	5.18
3.1	其中：债券	7,173,424.80	5.18
4	货币资金	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
6.1	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合计	11,116,394.72	8.08
8	其他资产	262,640.00	0.19
9	合计	138,489,648.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	9,187,688.04	6.66
B	采矿业	2,196,189.76	1.60
C	制造业	88,411,022.88	63.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,816,087.60	2.79
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	6,576,436.06	4.80
G	交通运输、仓储和邮政业	1,764,400.00	1.26
H	信息传输、软件和信息技术服务业	2,989,760.00	2.19
I	金融业	6,862,876.19	5.00
J	房地产业	—	—
K	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	—	—
P	教育、体育和公共事业管理	—	—
Q	卫生和社公事业	720,794.00	0.53
R	文化、体育和娱乐业	1,406,300.00	1.03
S	综合	—	—
合计		119,987,683.00	87.66

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600619	中国神华	9,542	5,493,475.02	4.13
2	000668	泸州老窖	86,147	3,989,030.62	2.91
3	300488	国瓷股份	148,709	3,918,196.00	2.86
4	002304	洋河股份	38,718	3,669,263.36	2.69
5	000888	华泰证券	72,088	3,480,240.00	2.59
6	600012	浦发银行	71,016	3,326,100.00	2.50
7	300059	东方财富	231,966	2,906,770.69	2.09
8	603689	口子窖	79,800	2,796,560.00	2.04
9	002714	友阿股份	97,300	2,797,276.00	2.04
10	002342	牧原股份	170,076	2,773,279.38	2.03

5.4 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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180408	18国开08	2,100,000	210,727,000.00	8.86
2	182203	18上银转债（转股）	3,000,000	300,960,000.00	8.04
3	170400	17广发04	2,500,000	264,958,000.00	6.81
4	172804	17江证转债（转股）	1,800,000	182,214,000.00	4.67
5	11180979	18中国华能转债H2094	1,000,000	172,166,000.00	4.22

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明细

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投资明细

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明细

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明细

5.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.10 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的股指期货投资持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资持仓和损益明细

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	180408	18国开08	2,100,000	210,727,000.00	8.86
2	182203	18上银转债（转股）	3,000,000	300,960,000.00	8.04
3	170400	17广发04	2,500,000	264,958,000.00	6.81
4	172804	17江证转债（转股）	1,800,000	182,214,000.00	4.67
5	11180979	18中国华能转债H2094	1,000,000	172,166,000.00	4.22

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.82 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.90 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.91 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.93 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.97 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.100 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.101 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.102 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.103 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.105 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.106 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.107 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.108 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.109 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.110 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.111 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.112 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.113 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.114 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.115 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.116 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.117 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.118 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.119 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.120 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.121 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.122 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.123 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.124 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.125 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.126 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.127 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.128 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.129 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.130 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.131 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.132 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.133 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.134 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.135 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.136 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.137 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.138 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.139 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.140 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.141 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.142 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.143 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.144 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.145 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.146 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.147 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.148 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.149 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.150 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.151 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.152 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.153 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.154 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.155 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.156 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.157 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.158 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.159 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.160 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.161 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.162 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.163 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.164 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.165 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.166 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.167 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细