

## 前海开源鼎瑞债券型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

情形：本基金本报告期内，从2019年5月9日至2019年6月5日连续20个工作日基金份额持有人数量不满二百人。

## § 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	权证投资	198,806,297.10	7.71
2	基金投资	198,806,297.10	7.71
3	固定收益投资	2,319,642,322.74	89.92
4	股票投资	2,047,436,502.21	79.36
5	资产支持证券	272,206,820.54	1.05
6	买入返售金融资产	—	—
7	金融衍生品投资	—	—
8	买入返售金融资产	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,047,436,502.21	100.00

5.4 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	—	—
3	金融债券	630,896,000.00	31.64
4	企业债券	896,734,600.00	44.93
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	620,747,000.00	26.12
7	可转换债券(可交换债券)	68,902.20	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,047,436,502.21	100.00

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

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	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
2	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
3	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
4	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
5	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
6	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
7	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
8	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
9	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
10	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139146	信用03A	500,000	50,898,657.63	25.6
2	139063	深中油	500,000	50,394,136.98	2.53
3	136263	深中油	900,000	89,449,000.00	4.50
4	150405	平安	800,000	81,266,000.00	4.08
5	150210	15国开	700,000	72,002,000.00	3.61
6	150210	15国开	700,000	72,002,000.00	3.61
7	150210	15国开	700,000	72,002,000.00	3.61
8	150210	15国开	700,000	72,002,000.00	3.61

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十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
2	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
3	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
4	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
5	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
6	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
7	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
8	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
9	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
10	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—

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十名股票投资组合

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002351	海普瑞	36,000	36,044,400.00	1.81
2	000651	格力电器	500,000	20,000,376.00	1.41
3	000985	五粮液	170,000	10,705,660.00	0.59
4	000030	中行证	171,804	18,276,052.00	0.92
5	001318	中国平安	187,330	16,699,311.00	0.83
6	000363	中行证	16,067,946.00	0.81	
7	000233	美的集团	258,400	13,400,624.00	0.67
8	000698	海普瑞	177,000	13,382,850.00	0.37
9	000002	万科A	252,500	7,022,025.00	0.36
10	300015	爱尔眼科	209,074	6,502,894.78	0.33

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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
2	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
3	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
4	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
5	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
6	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
7	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
8	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
9	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
10	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—

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十名资产支持证券投资组合

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
2	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
3	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
4	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
5	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
6	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
7	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
8	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
9	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	—
10	1280101	信用债转债	68,902.20	0.00	