

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

本报告期内,本基金不存在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) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 422,967,219.69 63.47

其中:股票 422,967,219.69 63.47

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 40,026,000.00 6.01

其中:债券 40,026,000.00 6.01

货币市场基金 - -

4 贵金属 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 次级类金融资产 178,000,000.00 26.71

其中:次级类金融资产的买入返售金融资产 - -

7 银行存款和结算备付金合计 23,470,206.20 3.52

8 其他资产 1,995,709.97 0.29

9 合计 666,418,310.00 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 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 363,412.56 0.06

C 制造业 234,516,233.31 36.30

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 12,161,480.00 1.83

F 批发、零售业 6,262,620.26 0.09

G 交通运输、仓储和邮政业 1,225,454.00 0.18

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息、通信、电子设备制造业 53,176,030.10 8.00

J 金融业 29,372,743.28 4.42

K 房地产业 11,500,360.00 1.73

L 租赁和商务服务业 10,666,655.01 1.51

M 科学研究、技术服务业 5,378,720.00 0.81

N 水利、环境和公共设施管理业 19,931,713.58 3.00

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 21,061,590.00 3.17

R 文化、体育和娱乐业 17,980,290.00 2.71

S 综合 - -

合计 422,967,219.69 63.47

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 代码 证券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000638 云南白药 472,956,393 39,463,900.10 6.04

2 600046 中国中车 1,900,013 36,431,154.32 5.33

3 002236 华孚时尚 2,576,654 27,932,066.00 4.19

4 000197 正泰电器 1,104,074 26,511,540.00 3.94

5 600066 沪农股份 826,006 24,872,815.16 3.74

6 601233 恒邦股份 1,677,722 24,470,546.77 3.68

7 002650 三花智控 2,114,338 22,306,266.00 3.36

8 002044 美年健康 1,692,260 21,061,590.00 3.17

9 600064 浙江旅游 2,146,502 19,931,713.58 3.00

10 601336 新华保险 367,100 19,651,213.00 2.96

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 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 8,992,800.00 2.89

2 行业债券 - -

3 金融债券 29,856,000.00 0.60

其中:政策性金融债 29,856,000.00 0.60

4 企业债券 121,429,000.00 38.04

5 企业短期融资券 36,176,500.00 11.31

6 中期票据 67,989,500.00 21.00

7 可转换债券(含权债券) - -

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 363,418,800.00 94.71

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十名债券投资明细

序号 代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 04190044 中国银行 2019年01月20日付息CD001 200,000 20,130 6.47

2 190203 19国开03 200,000 19,872 6.39

3 124940 PR徽州债 300,000 12,610 5.04

4 124940 PR贵国债 300,000 12,376 5.00

5 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD002 200,000 12,050 4.03

6 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD003 200,000 12,050 4.03

7 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD004 200,000 12,050 4.03

8 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD005 200,000 12,050 4.03

9 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD006 200,000 12,050 4.03

10 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD007 200,000 12,050 4.03

11 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD008 200,000 12,050 4.03

12 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD009 200,000 12,050 4.03

13 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD010 200,000 12,050 4.03

14 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD011 200,000 12,050 4.03

15 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD012 200,000 12,050 4.03

16 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD013 200,000 12,050 4.03

17 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD014 200,000 12,050 4.03

18 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD015 200,000 12,050 4.03

19 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD016 200,000 12,050 4.03

20 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD017 200,000 12,050 4.03

21 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD018 200,000 12,050 4.03

22 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD019 200,000 12,050 4.03

23 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD020 200,000 12,050 4.03

24 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD021 200,000 12,050 4.03

25 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD022 200,000 12,050 4.03

26 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD023 200,000 12,050 4.03

27 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD024 200,000 12,050 4.03

28 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD025 200,000 12,050 4.03

29 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD026 200,000 12,050 4.03

30 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD027 200,000 12,050 4.03

31 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD028 200,000 12,050 4.03

32 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD029 200,000 12,050 4.03

33 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD030 200,000 12,050 4.03

34 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD031 200,000 12,050 4.03

35 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD032 200,000 12,050 4.03

36 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD033 200,000 12,050 4.03

37 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD034 200,000 12,050 4.03

38 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD035 200,000 12,050 4.03

39 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD036 200,000 12,050 4.03

40 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD037 200,000 12,050 4.03

41 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD038 200,000 12,050 4.03

42 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD039 200,000 12,050 4.03

43 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD040 200,000 12,050 4.03

44 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD041 200,000 12,050 4.03

45 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD042 200,000 12,050 4.03

46 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD043 200,000 12,050 4.03

47 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD044 200,000 12,050 4.03

48 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD045 200,000 12,050 4.03

49 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD046 200,000 12,050 4.03

50 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD047 200,000 12,050 4.03

51 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD048 200,000 12,050 4.03

52 600903 中国银行 2019年01月20日付息CD049 200,000 12,050 4.03

53 600903