

# 2020Q3 基金重仓股与重仓债券数据库

## ——“数据智库”系列之三

报告日期：2020-10-29

分析师：严佳炜

执业证书号：S0010520070001

邮箱：yanjw@hazq.com

分析师：朱定豪

执业证书号：S0010520060003

邮箱：zhudh@hazq.com

联系人：钱静闲

执业证书号：S0010120080059

邮箱：qianjx@hazq.com

### 相关报告

- 1.《华安金工指数增强基金跟踪模板——“数据智库”系列之一》2020-07-21
- 2.《华安金工 ETF 跟踪模板发布——“数据智库”系列之二》2020-08-05

### 主要观点：

#### ● 主要内容

我们根据基金三季报整理了公募基金股票和债券持仓明细。根据 WIND 口径，剔除 ETF 联接基金、短期理财视为债券型基金、剔除 FOF 所持有基金市值，全市场基金共计 17.91 万亿元，其中股票型基金 1.61 万亿、混合型 4.06 万亿、债券型 4.77 万亿、货币型 7.25 万亿、另类投资型 0.10 万亿、QDII 基金 0.11 万亿。

根据季报披露持仓，我们整理了《华安金工 2020Q3 基金重仓股数据库》和《华安金工 2020Q3 基金重仓债券数据库》，两份数据库根据基金季报披露规则，收录基金持股数据 37688 条，收录基金持有债券数据 34106 条。根据三季报统计，公募前十大重仓股共计 1432 只，合计市值 1.49 万亿。公募基金披露持有债券（含 ABS、可转债等）4357 只，合计市值 14.27 万亿。

根据股票型、偏股混合和灵活配置三类基金的持股，我们汇总了基金持有的每只股票的总市值和持有该股票的基金数量。基金前五大重仓股中，974 只基金持有茅台共计 703.4 亿元、729 只基金持有五粮液共计 569.9 亿元、769 只基金持有立讯精密共计 446.9 亿元、524 只基金持有隆基股份共计 384.9 亿元、406 只基金持有中国中免共计 303.8 亿元。

基金季报重仓股和重仓债券数据库片段见正文，整个数据库采取 Excel 形式存储，已集成数据透视表，可根据个性化需求进行数据的筛选、排序、分组、增添函数等操作，如需试用数据库请联系华安证券研究所对口销售。

#### ● 风险提示

本表格为数据模板，收录公募基金三季报的公开持仓数据，不代表投资观点。

# 正文目录

1 基金三季报持仓数据库.....	4
风险提示: .....	8

## 图表目录

图表 1 2020Q3 全市场基金分类规模 .....	4
图表 2 2020Q3 公募基金资产配置 .....	5
图表 3 公募基金“热门股”持有统计 .....	5
图表 4 2020Q3 公募基金前 40 大重仓股 .....	6
图表 5 2020Q3 公募基金中信一级行业配置 .....	6
图表 6 2020Q3 中长期纯债基金持有债券评级分布 .....	7
图表 7 2020Q3 各类型公募基金持有的企业债占比 .....	7
图表 8 2020Q3 公募基金持股数据库片段截取（37661-37688） .....	7
图表 9 2020Q3 公募基金持有债券数据库片段截取（31557-33116） .....	8

## 1 基金三季报持仓数据库

截止 2020/10/29，基金三季报基本披露完毕。根据 WIND 口径，剔除 ETF 联接基金、短期理财视为债券型基金、剔除 FOF 所持有基金市值，全市场基金共计 17.91 万亿元，其中股票型基金 1.61 万亿、混合型 4.06 万亿、债券型 4.77 万亿、货币型 7.25 万亿、另类投资型 0.10 万亿、QDII 基金 0.11 万亿。

从资产配置来看，公募基金共计持有股票 4.16 万亿（其中 A 股 3.87 万亿），占净值比 24.4%；债券 8.56 万亿，占净值比 50.1%。股票持仓方向，基金三季报披露前十大重仓股。债券持仓方向，基金三季报披露前五大重仓债券、前十大资产支持债券、处于转股期的可转换债券等数据。

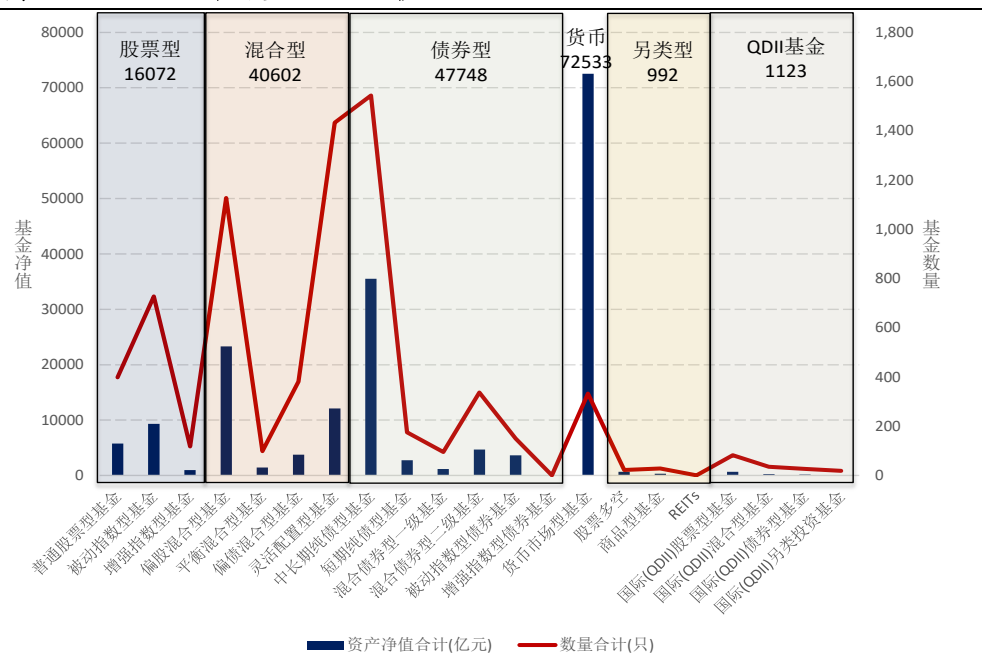
根据季报披露持仓，我们整理了《华安金工 2020Q3 基金重仓股数据库》和《华安金工 2020Q3 基金重仓债券数据库》，两份数据库收录基金持股数据 37688 条，收录基金持有债券数据 34106 条。根据三季报，公募前十大重仓股共计 1432 只，合计市值 1.49 万亿。公募基金披露持有债券（含 ABS、可转债等）4357 只，合计市值 14.27 万亿。

根据股票型、偏股混合和灵活配置三类基金的持股，我们汇总了基金持有的每只股票的总市值和持有该股票的基金数量。前四十大重仓股如图表 4 所示，974 只基金持有茅台共计 703.4 亿元、729 只基金持有五粮液共计 569.9 亿元、769 只基金持有立讯精密共计 446.9 亿元、524 只基金持有隆基股份共计 384.9 亿元、406 只基金持有中国中免共计 303.8 亿元。

基金季报重仓股和重仓债券数据库片段如图表 8-9 所示，整个数据库采取 Excel 形式存储，已集成数据透视表，可根据个性化需求进行数据的筛选、排序、分组、增添函数等操作。

系列数据库包括：《华安金工指数增强基金跟踪模板》、《华安金工 ETF 跟踪模板发布》，《华安金工 2020Q3 基金重仓股数据库》、《华安金工 2020Q3 基金重仓债券数据库》，如需试用数据库请联系华安证券研究所对口销售。

图表 1 2020Q3 全市场基金分类规模



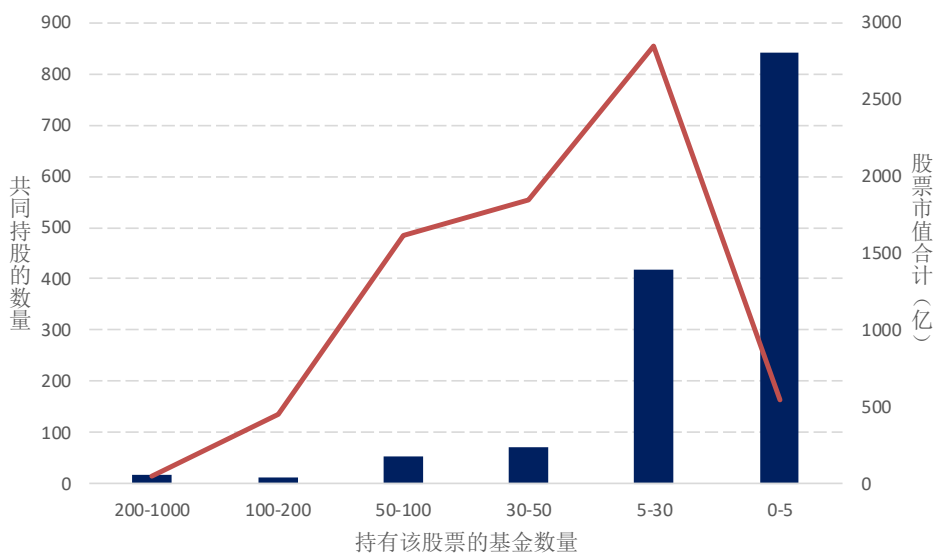
资料来源：Wind 资讯，华安证券研究所

图表 2 2020Q3 公募基金资产配置

资产科目	市值(万元)	占总值比(%)	占净值比(%)	市值增长率(%)
股票	415,676,924	22.5	24.4	23.7
其中：A股	387,482,298	21.0	22.7	22.3
债券	855,982,590	46.4	50.1	-3.8
基金	6,977,085	0.4	0.4	29.4
权证	1	0.0	0.0	-84.2
现金	366,166,752	19.8	21.5	20.9
其他资产	200,324,034	10.9	11.7	-20.5
资产净值	1,707,042,460	92.5	100.0	4.0
资产总值	1,845,127,384	100.0	108.1	3.3

资料来源：Wind 资讯，华安证券研究所

图表 3 公募基金“热门股”持有统计



备注：上图统计了基金共同持股特征，例如上图最左统计了全市场符合200-1000只基金共同持有的股票有20只，合计5000亿市值。

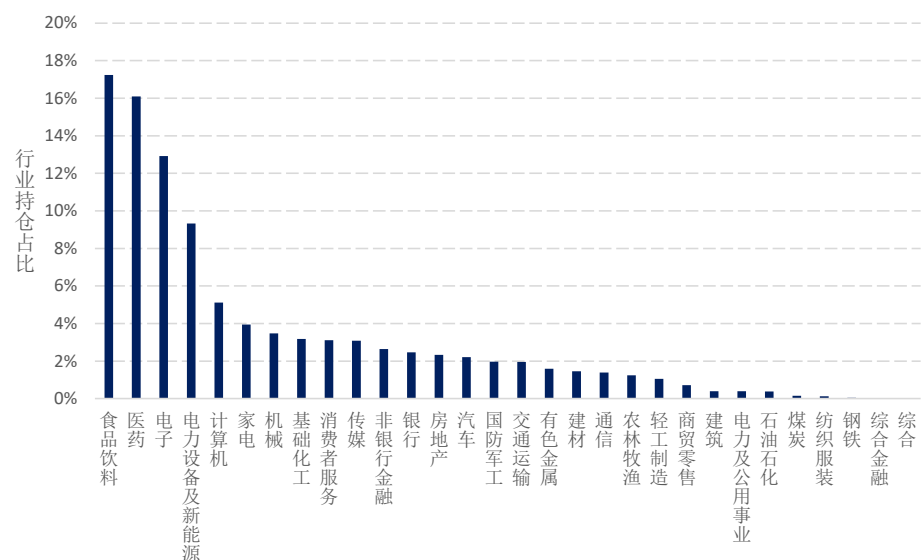
资料来源：Wind 资讯，华安证券研究所

图表 4 2020Q3 公募基金前 40 大重仓股

序号	股票名称	基金持有市值 合计	持有基金个数	序号	股票名称	基金持有市值 合计	持有基金个数
1	贵州茅台	703.4	974	21	亿纬锂能	130.4	165
2	五粮液	569.9	729	22	招商银行	126.1	386
3	立讯精密	446.9	769	23	歌尔股份	121.7	271
4	隆基股份	384.9	524	24	分众传媒	121.3	131
5	中国中免	303.8	406	25	三一重工	117.3	280
6	腾讯控股	286.7	192	26	山西汾酒	113.0	133
7	宁德时代	270.7	501	27	通策医疗	112.5	88
8	迈瑞医疗	262.9	337	28	芒果超媒	107.1	108
9	泸州老窖	251.8	230	29	恒生电子	104.1	183
10	美的集团	245.9	455	30	万华化学	101.9	136
11	美团-W	220.7	141	31	康泰生物	98.5	79
12	中国平安	210.9	580	32	智飞生物	98.0	187
13	顺丰控股	196.5	200	33	宁波银行	93.4	193
14	恒瑞医药	181.4	373	34	海康威视	92.6	99
15	药明康德	178.8	254	35	东方雨虹	91.9	130
16	长春高新	156.2	242	36	三安光电	91.8	26
17	通威股份	145.1	204	37	京东方A	90.8	120
18	伊利股份	139.8	299	38	广联达	89.8	86
19	万科A	134.2	293	39	汇川技术	86.2	115
20	爱尔眼科	133.3	128	40	洋河股份	83.6	30

资料来源：Wind 资讯，华安证券研究所

图表 5 2020Q3 公募基金中信一级行业配置



资料来源：Wind 资讯，华安证券研究所

图表 6 2020Q3 中长期纯债基金持有债券评级分布

基金类型	中长期纯债型基金	
债券WIND分类	(全部)	
基金2020Q3规模合计 (亿)	(全部)	
行标签	求和项:债券市值	求和项:债券市值2
0	1,168,530,697,173	73%
A+	130,829,282	0%
A-1	5,904,904,048	0%
AA	9,854,885,088	1%
AA-	1,001,782,558	0%
AA+	32,640,442,810	2%
AAA	376,742,474,551	24%
C	2,149,700	0%
总计	1,594,808,165,211	100%

资料来源: Wind 资讯, 华安证券研究所

图表 7 2020Q3 各类型公募基金持有的企业债占比

债券WIND分类	一般企业债	
基金2020Q3规模合计 (亿)	(全部)	
最新债项评级	AA+	
行标签	求和项:债券市值	求和项:债券市值2
短期纯债型基金	67452000	2%
混合债券型二级基金	231444202	8%
混合债券型一级基金	168691400	6%
灵活配置型基金	47213000	2%
偏债混合型基金	165683000	6%
中长期纯债型基金	2163349920	76%
总计	2843833522	100%

资料来源: Wind 资讯, 华安证券研究所

图表 8 2020Q3 公募基金持股数据库片段截取

1	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K
	基金代码	基金名称	基金经理	基金类型	股票代码	个股名称	中信一级行	股票持有市值	股票占净	基金规模	季报更新日
37661	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	600201.SH	生物股份	医药	28,379,970	6.0	4.7	20201028
37662	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	300015.SZ	爱尔眼科	医药	26,031,478	5.5	4.7	20201028
37663	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	002241.SZ	歌尔股份	电子	24,731,031	5.3	4.7	20201028
37664	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	002050.SZ	三花智控	家电	24,395,025	5.2	4.7	20201028
37665	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	002352.SZ	顺丰控股	交通运输	22,930,880	4.9	4.7	20201028
37666	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	002242.SZ	九阳股份	家电	20,282,266	4.3	4.7	20201028
37667	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	300750.SZ	宁德时代	电力设备及新	18,602,901	4.0	4.7	20201028
37668	762001.OF	国金国鑫灵活配置	张航	灵活配置型基金	600585.SH	海螺水泥	建材	18,550,782	3.9	4.7	20201028
37669	005515.OF	银华中小市值A	马君	普通股票型基金	002557.SZ	洽洽食品	食品饮料	116,290	1.0	0.1	20201027
37670	671030.OF	西部利得事件驱动	刘芸,童国	普通股票型基金	000858.SZ	五粮液	食品饮料	88,400	2.5	0.0	20201028
37671	005179.OF	信达澳银新起点A	王咏辉	灵活配置型基金	600519.SH	贵州茅台	食品饮料	40,044	0.3	0.1	20201028
37672	006195.OF	国金量化多因子	宫雪,马芳	普通股票型基金	000858.SZ	五粮液	食品饮料	22,100	0.8	0.0	20201028
37673	006195.OF	国金量化多因子	宫雪,马芳	普通股票型基金	000596.SZ	古井贡酒	食品饮料	21,678	0.8	0.0	20201028
37674	770001.OF	德邦优化	房建威,汪	灵活配置型基金	002241.SZ	歌尔股份	电子	6,064,500	3.5	1.8	20201027
37675	770001.OF	德邦优化	房建威,汪	灵活配置型基金	601628.SH	中国人寿	非银行金融	5,998,050	3.4	1.8	20201027
37676	770001.OF	德邦优化	房建威,汪	灵活配置型基金	601888.SH	中国中免	消费者服务	4,793,210	2.7	1.8	20201027
37677	770001.OF	德邦优化	房建威,汪	灵活配置型基金	300124.SZ	汇川技术	电力设备及新	4,053,000	2.3	1.8	20201027
37678	770001.OF	德邦优化	房建威,汪	灵活配置型基金	300433.SZ	蓝思科技	电子	3,854,818	2.2	1.8	20201027
37679	005489.OF	中金衡优A	陈诗昆	灵活配置型基金	605338.SH	巴比食品	食品饮料	12,873	0.0	4.9	20201028
37680	005076.OF	创金合信优选回报	曹春林	灵活配置型基金	605338.SH	巴比食品	食品饮料	8,853	0.0	1.7	20201028
37681	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	601888.SH	中国中免	消费者服务	477,798,097	6.4	74.7	20201028
37682	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	000333.SZ	美的集团	家电	475,593,598	6.4	74.7	20201028
37683	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	600612.SH	老凤祥	商贸零售	429,554,886	5.8	74.7	20201028
37684	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	002493.SZ	荣盛石化	石油石化	350,104,786	4.7	74.7	20201028
37685	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	300059.SZ	东方财富	计算机	346,164,401	4.6	74.7	20201028
37686	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	300750.SZ	宁德时代	电力设备及新	292,749,878	3.9	74.7	20201028
37687	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	1810.HK	小米集团	-0	243,739,099	3.3	74.7	20201028
37688	910007.OF	东方红启元三年持	钱思佳	偏股混合型基金	600732.SH	爱旭股份	电力设备及新	213,910,726	2.9	74.7	20201028

资料来源: Wind 资讯, 华安证券研究所



图表 9 2020Q3 公募基金持有债券数据库片段截取

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O
1	基金代码	基金名称	基金经理	基金类型	债券代码	债券名称	债券WIND分类	债券市值	债券占比	基金2020Q3持仓	债券余额	最新信用评级	最新主体	剩余期限	季报更新日期
31557	485120.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	101200045	20中铝SCP0	超短期融资债券	3E+07	8.83	3.4	10.0	0	AAA	0.05	20201027	
31558	485120.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	101200078	20京汽股SC	超短期融资债券	3E+07	8.82	3.4	15.0	0	AAA	0.10	20201027	
31559	485120.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	138456.SZ	链融22A1	证监会主管ABS	1E+07	2.94	3.4	10.0	AAA	0	0.20	20201027	
31560	485120.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	165091.SH	19国风1A	证监会主管ABS	9999000	2.93	3.4	0.0	AAA	0	0.00	20201027	
31561	485120.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	138175.SZ	19融惠7A	证监会主管ABS	9055800	2.66	3.4	3.5	AAA	0	0.08	20201027	
31562	485120.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	138389.SZ	瑞新12A1	证监会主管ABS	5023000	1.47	3.4	3.0	AAA	0	0.20	20201027	
31563	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	10190076	19首钢MTN	一般中期票据	2E+07	7.74	2.6	20.0	AAA	AAA	3.60	20201027	
31564	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	163789.SH	20浦土02	一般公司债	2E+07	7.58	2.6	10.0	AAA	AA+	4.75	20201027	
31565	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	163774.SH	20中证15	证券公司债	2E+07	7.58	2.6	75.0	AAA	AAA	2.75	20201027	
31566	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	149173.SZ	20申证06	证券公司债	2E+07	7.56	2.6	41.0	AAA	AAA	2.75	20201027	
31567	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	13200000	20江苏铁路	一般中期票据	2E+07	7.5	2.6	10.0	AAA	AAA	2.39	20201027	
31568	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	165091.SH	19国风1A	证监会主管ABS	1.9E+07	7.23	2.6	0.0	AAA	0	0.00	20201027	
31569	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	138426.SZ	瑞新13A1	证监会主管ABS	1E+07	3.82	2.6	9.7	AAA	0	0.22	20201027	
31570	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	138452.SZ	瑞新14A1	证监会主管ABS	5016500	1.91	2.6	10.3	AAA	0	0.22	20201027	
31571	485122.O	工银瑞信·谷街	短期纯债	138389.SZ	瑞新12A1	证监会主管ABS	4018400	1.53	2.6	3.0	AAA	0	0.20	20201027	
32165	519199.O	万家享·陈奕雯	短期纯债	200201.BZ	20国开01	政策银行债	9994000	14.95	0.7	897.8	0	0	0.21	20201027	
32166	519199.O	万家享·陈奕雯	短期纯债	10180059	18金地MTN	一般中期票据	5073500	7.59	0.7	20.0	AAA	AAA	0.52	20201027	
32167	519199.O	万家享·陈奕雯	短期纯债	10180075	18恒隆地产	一般中期票据	5061500	7.57	0.7	10.0	AAA	AAA	0.72	20201027	
32168	519199.O	万家享·陈奕雯	短期纯债	10190062	19吉利MTN	一般中期票据	5032500	7.53	0.7	35.0	AAA	AAA	1.49	20201027	
32169	519199.O	万家享·陈奕雯	短期纯债	136239.SH	16国联01	一般公司债	5012000	7.5	0.7	10.0	AAA	AAA	0.35	20201027	
33112	531028.O	建信短债·陈建良·刘	短期纯债	180208.BZ	18国开08	政策银行债	1E+08	4.39	23.0	1302.4	0	0	0.50	20201027	
33113	531028.O	建信短债·陈建良·刘	短期纯债	101200105	20中兴通讯	超短期融资债券	1E+08	4.36	23.0	20.0	0	AAA	0.15	20201027	
33114	531028.O	建信短债·陈建良·刘	短期纯债	101200110	20中化TSC	超短期融资债券	1E+08	4.36	23.0	15.0	0	AAA	0.15	20201027	
33115	531028.O	建信短债·陈建良·刘	短期纯债	107200020	20平安证券	证券公司短期融	9E+07	3.92	23.0	30.0	A-1	AAA	0.02	20201027	
33116	531028.O	建信短债·陈建良·刘	短期纯债	104200016	20天津轨交	一般短期融资券	8E+07	3.48	23.0	20.0	A-1	AAA	0.44	20201027	

资料来源：Wind 资讯，华安证券研究所

## 风险提示：

本表格为数据模板，收录公募基金三季报的公开持仓数据，不代表投资观点。



## 重要声明

### 分析师声明

本报告署名分析师具有中国证券业协会授予的证券投资咨询执业资格，以勤勉的执业态度、专业审慎的研究方法，使用合法合规的信息，独立、客观地出具本报告，本报告所采用的数据和信息均来自市场公开信息，本人对这些信息的准确性或完整性不做任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。报告中的信息和意见仅供参考。本人过去不曾与、现在不与、未来也将不会因本报告中的具体推荐意见或观点而直接或间接接收任何形式的补偿，分析结论不受任何第三方的授意或影响，特此声明。

### 免责声明

华安证券股份有限公司经中国证券监督管理委员会批准，已具备证券投资咨询业务资格。本报告中的信息均来源于合规渠道，华安证券研究所力求准确、可靠，但对这些信息的准确性及完整性均不做任何保证。在任何情况下，本报告中的信息或表述的意见均不构成对任何人的投资建议。在任何情况下，本公司、本公司员工或者关联机构不承诺投资者一定获利，不与投资者分享投资收益，也不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的任何损失负任何责任。投资者务必注意，其据此做出的任何投资决策与本公司、本公司员工或者关联机构无关。华安证券及其所属关联机构可能会持有报告中提到的公司所发行的证券并进行交易，还可能为这些公司提供投资银行服务或其他服务。

本报告仅向特定客户传送，未经华安证券研究所书面授权，本研究报告的任何部分均不得以任何方式制作任何形式的拷贝、复印件或复制品，或再次分发给任何其他人，或以任何侵犯本公司版权的其他方式使用。如欲引用或转载本文内容，务必联络华安证券研究所并获得许可，并需注明出处为华安证券研究所，且不得对本文进行有悖原意的引用和删改。如未经本公司授权，私自转载或者转发本报告，所引起的一切后果及法律责任由私自转载或转发者承担。本公司并保留追究其法律责任的权利。

## 投资评级说明

以本报告发布之日起 6 个月内，证券（或行业指数）相对于同期沪深 300 指数的涨跌幅为标准，定义如下：

### 行业评级体系

- 增持—未来 6 个月的投资收益率领先沪深 300 指数 5%以上；
- 中性—未来 6 个月的投资收益率与沪深 300 指数的变动幅度相差-5%至 5%；
- 减持—未来 6 个月的投资收益率落后沪深 300 指数 5%以上；

### 公司评级体系

- 买入—未来 6-12 个月的投资收益率领先市场基准指数 15%以上；
- 增持—未来 6-12 个月的投资收益率领先市场基准指数 5%至 15%；
- 中性—未来 6-12 个月的投资收益率与市场基准指数的变动幅度相差-5%至 5%；
- 减持—未来 6-12 个月的投资收益率落后市场基准指数 5%至；
- 卖出—未来 6-12 个月的投资收益率落后市场基准指数 15%以上；
- 无评级—因无法获取必要的资料，或者公司面临无法预见结果的重大不确定性事件，或者其他原因，致使无法给出明确的投资评级。市场基准指数为沪深 300 指数。