

金融工程专题研究

公募 FOF 基金 2024 年三季度报解析

核心观点

公募FOF基金 2024 年三季度概览

截至 2024Q3, 全市场已成立 FOF 产品数量 500 只, 合计规模为 1472.94 亿元, 相比 2024Q2 增加 5.60%。根据穿透后权益资产占比将 FOF 划分为偏债型 FOF、平衡型 FOF 和偏股型 FOF, 2024Q3 规模分别为 671.87 亿元、401.62 亿元、399.44 亿元, 2024 年三季度收益中位数分别为 1.75%、5.69%、9.15%。

2024 年三季度报中 FOF 配置最多的基金

为了更好地观察 FOF 基金经理的投资偏好, 本文就市场关注度较高的几类基金分别统计了 FOF 重仓数量最多和重仓规模最大的基金。

在主动权益基金中, 重仓该基金的 FOF 数量最多的三只基金是**大成高新技术产业A、宝盈品质甄选A、工银创新动力**; 重仓规模最大的三只基金是**大成高新技术产业A、易方达供给改革、易方达瑞恒**。

在债券型基金中, 重仓该基金的 FOF 数量最多的三只基金是**广发纯债A、交银裕隆纯债A、富国信用债A**; 重仓规模最大的三只基金是**交银裕隆纯债A、交银丰晟收益A、交银纯债AB**。

相比 2024Q2, FOF 基金经理增配了哪些基金?

追踪 FOF 基金经理的投资动态: 在主动权益基金中, FOF 预估净增持数量最多的三只基金是**大成高新技术产业A、宝盈品质甄选A、宝盈龙头优选A**; FOF 预估净增持规模最大的三只基金是**易方达核心优势C、易方达信息产业A、易方达医药生物C**。

在债券型基金中, FOF 预估净增持数量最多的三只基金是**广发纯债A、天弘安益A、易方达信用债A**; FOF 预估净增持规模最大的三只基金是**东方红短债A、中欧中短债A、富国安慧A**。

2024 年三季度报中 FOF 配置数量最多的基金经理

FOF 配置数量最多的前三位主动权益基金经理是**刘旭先生、徐彦先生、王斌先生**; FOF 配置数量最多的前三位“固收+”基金经理是**王晓晨女士、胡剑先生、张翼飞先生**。

2024 年三季度报中 FOF 股票投资情况

截至 2024Q3, 共有 153 只 FOF 直接投资股票, 平衡型 FOF 中投资股票资产的 FOF 数量占比最高, 偏债型 FOF 次之。

从 FOF 重仓的股票标的来看, 重仓该股票的 FOF 数量排名前三的是**宁德时代、贵州茅台、立讯精密**; 重仓市值排名前三的是**宁德时代、贵州茅台、豪迈科技**。

风险提示: 本报告基于历史客观数据统计, 不构成投资建议。

金融工程专题报告

金融工程·数量化投资

证券分析师: 张欣慰

021-60933159

zhangxinwei1@guosen.com.cn

S0980520060001

证券分析师: 杨丽华

021-60933116

yanglihua@guosen.com.cn

S0980521030002

证券分析师: 陈梦琪

021-60375447

chenmengqi@guosen.com.cn

S0980524070009

相关研究报告

《海外资管机构月报-9月美国新发基金超70只, 发行热度提升》
——2024-10-19

《基金投资价值分析-市场回暖, 关注创业板高弹性机遇——光大创业板量化优选投资价值分析》——2024-09-30

《金融工程专题研究-百亿私募 2024 年二季度持仓变化透视分析》——2024-09-11

《金融工程专题研究-哪类 ETF 的机构投资者占比在提升?——穿透算法下的 ETF 机构持仓行为分析》——2024-09-09

《金融工程专题研究-中证 A500 指数投资价值分析》
——2024-09-09

内容目录

公募 FOF 基金 2024 年三季度概览	4
FOF 发行情况	5
FOF 业绩表现	6
FOF 配置最多的基金	8
FOF 配置最多的股票基金	8
FOF 配置最多的债券基金	10
相比 2024Q2，FOF 基金经理增配了哪些基金？	11
FOF 配置最多的基金经理	13
外部 FOF 重仓投资规模	14
FOF 投资股票情况	15
总结	18
风险提示	19

图表目录

图1: FOF 规模及数量（按资产配置策略划分）	4
图2: FOF 规模及数量（按穿透后权益资产占比划分）	4
图3: 前 20 家基金管理人的 FOF 管理规模（亿元）和数量（截至 20240930）	5
图4: FOF 发行数据统计（截至 20240930）	5
图5: 不同类别 FOF 收益中位数（按穿透后权益资产占比划分）	6
图6: 外部 FOF 重仓投资规模最大的前 20 家基金公司（亿元，截至 20240930）	14
图7: 投资股票资产的 FOF 数量占比变化	15
图8: 投资股票资产的 FOF 的平均股票仓位	16
表1: 2024Q3 偏债型 FOF 收益 TOP10	7
表2: 2024Q3 平衡型 FOF 收益 TOP10	7
表3: 2024Q3 偏股型 FOF 收益 TOP10	7
表4: FOF 配置最多的主动权益基金 TOP10（截至 20240930）	8
表5: FOF 配置最多的股票型被动指数基金 TOP10（截至 20240930）	9
表6: FOF 配置最多的指数增强基金 TOP10（截至 20240930）	10
表7: FOF 配置最多的债券型基金 TOP10（截至 20240930）	10
表8: FOF 配置最多的“固收+”基金 TOP10（截至 20240930）	11
表9: FOF 基金经理预估增持最多的主动权益基金 TOP10（截至 20240930）	12
表10: FOF 基金经理预估增持最多的债券型基金 TOP10（截至 20240930）	12
表11: FOF 配置数量最多的主动权益基金经理 TOP10（截至 20240930）	13
表12: FOF 配置数量最多的“固收+”基金经理 TOP10（截至 20240930）	14
表13: FOF 配置最多的股票 TOP10（截至 20240930）	16
表14: FOF 基金经理预估股票调仓市值 TOP10（截至 20240930）	17

公募 FOF 基金 2024 年三季度概览

截至 2024Q3，全市场已成立 FOF 产品数量 500 只，合计规模为 1472.94 亿元，相比 2024Q2 增加 5.60%。按资产配置策略划分，FOF 可以分为目标日期基金、目标风险基金、普通 FOF 基金三类，图 1 显示目前 FOF 市场主要以普通 FOF 基金和目标风险基金为主，规模分别为 829.02 亿元、421.53 亿元，合计占比 84.90%。

我们还可以根据 FOF 实际投资的权益资产的占比来对其进行分类。本文根据最新的半年报和年报，通过 FOF 持仓基金和股票的比例来估算穿透权益仓位，最终得到 FOF 穿透后权益资产占比 W ，具体计算公式为：

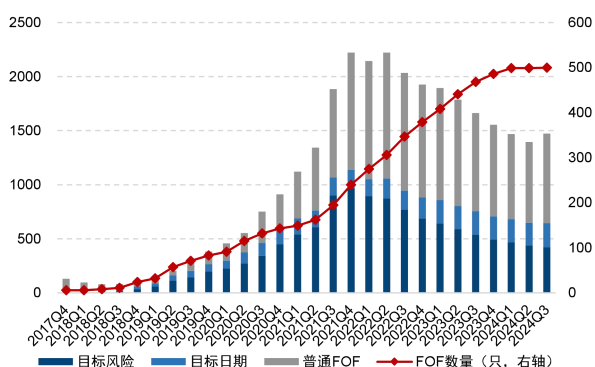
$$W = \sum_i Fund_i \times Fund_Stock_i + Stock$$

其中， $Fund_i$ 表示 FOF 持有的基金 i 规模占净值比， $Fund_Stock_i$ 表示基金 i 的股票投资市值占基金自身净值比， $Stock$ 是 FOF 直接投资的股票市值占净值比。对于成立不足 3 个月的 FOF，使用其基准指数对应的权益仓位作为穿透后的权益资产占比。

依据穿透后的权益资产占比将 FOF 分为**偏债型 FOF**、**平衡型 FOF** 和**偏股型 FOF** 三类：偏债型 FOF 定义为穿透后权益资产占比小于 30% 的 FOF，平衡型 FOF 定义为穿透后权益资产占比大于等于 30% 且小于 60% 的 FOF，偏股型 FOF 定义为穿透后权益资产占比大于等于 60% 的 FOF。

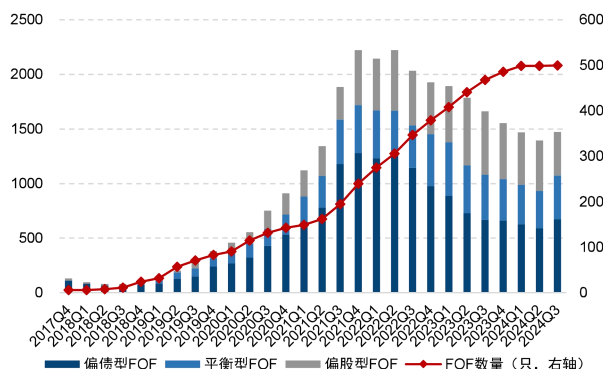
从图 2 可以看到这三种类别 FOF 规模变化情况：偏债型 FOF 规模最高，为 671.87 亿元，平衡型 FOF 和偏股型 FOF 近年来合计规模占比有所提升，截至 2024Q3 合计规模占比已达 54.39%，相比 2021Q3 增加 16.85%。

图1：FOF 规模及数量（按资产配置策略划分）



资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

图2：FOF 规模及数量（按穿透后权益资产占比划分）



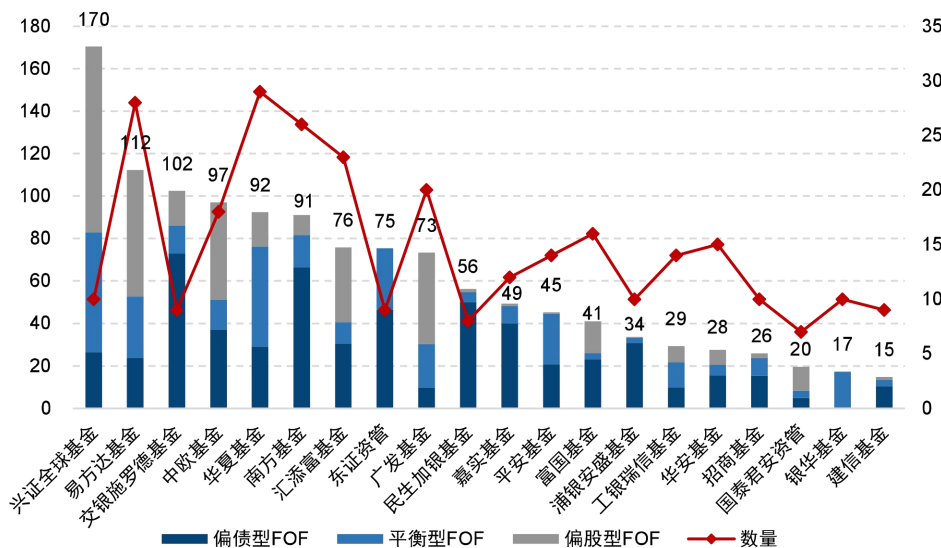
资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

从基金公司的维度来看，截至 2024Q3，开展 FOF 业务的基金公司共有 85 家。前 5 大 FOF 基金管理人合计规模占比 39.02%，相比 2024Q2 的 40.60% 小幅下降。

FOF 管理规模占比排名前三的基金管理人分别是兴证全球基金（11.57%）、易方达基金（7.62%）、交银施罗德基金（6.96%）。按不同类别 FOF 的管理规模来看，兴证全球基金的 FOF 产品集中在偏股型 FOF 和平衡型 FOF，管理规模占比分别为

51%、33%；易方达基金的 FOF 产品集中在偏股型 FOF 和平衡型 FOF，管理规模占比分别为 53%、26%；交银施罗德基金的 FOF 产品主要以偏债型 FOF 为主，管理规模中有 71%是偏债型 FOF。

图3：前 20 家基金管理人的 FOF 管理规模（亿元）和数量（截至 20240930）

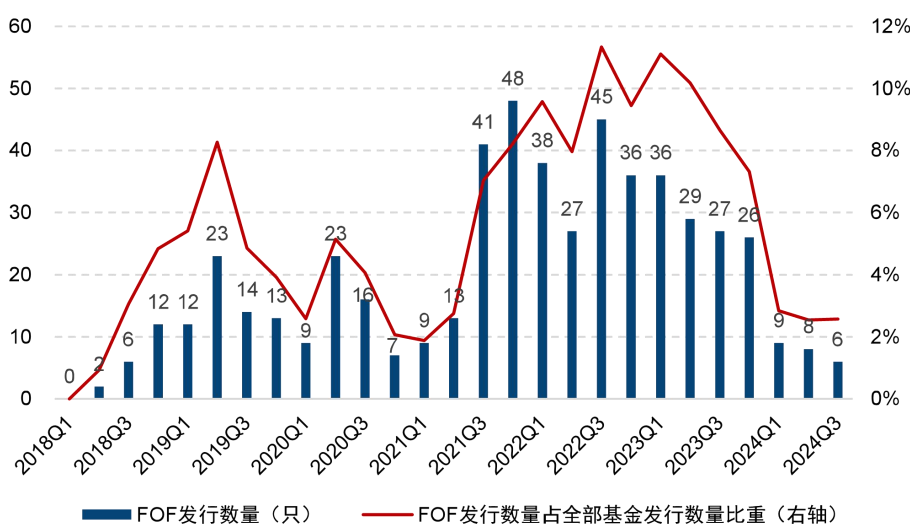


资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

FOF 发行情况

按 FOF 发行日期统计各个季度的 FOF 发行数量（仅统计初始基金）。2024Q3 的 FOF 发行数量为 6 只，相比 2024Q2，FOF 发行数量减少了 2 只。

图4：FOF 发行数据统计（截至 20240930）



资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

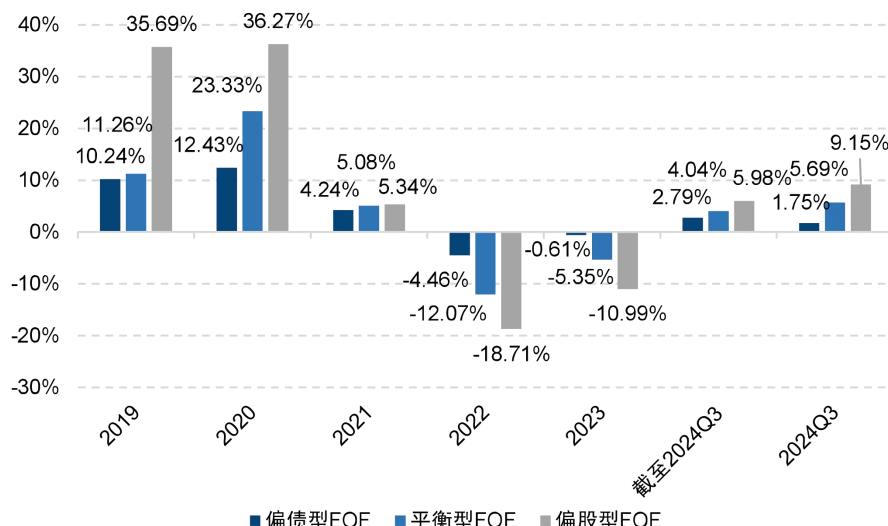
FOF 业绩表现

得益于 2019 年、2020 年权益市场的上涨，FOF 也取得了较好的业绩表现。如图 5 所示，2019 年偏债型 FOF、平衡型 FOF、偏股型 FOF 的收益中位数分别为 10.24%、11.26%、35.69%。2020 年偏债型 FOF、平衡型 FOF、偏股型 FOF 的收益中位数分别为 12.43%、23.33%、36.27%。

对比 2019 年和 2020 年，2021 年 FOF 整体业绩表现相对较弱，偏债型 FOF、平衡型 FOF、偏股型 FOF 的收益中位数分别为 4.24%、5.08%、5.34%。2022 年，受权益市场回调的影响，偏债型 FOF、平衡型 FOF、偏股型 FOF 收益纷纷下行，收益中位数分别为-4.46%、-12.07%、-18.71%。

2023 年偏债型 FOF、平衡型 FOF、偏股型 FOF 收益中位数分别为-0.61%、-5.35%、-10.99%。2024 年三季度偏债型 FOF、平衡型 FOF、偏股型 FOF 收益中位数分别为 1.75%、5.69%、9.15%。

图 5：不同类别 FOF 收益中位数¹（按穿透后权益资产占比划分）



资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

对于不同类别的 FOF，我们分别列出了 2024 年三季度业绩表现排名前 10 的基金。偏债型 FOF 中，2024 年三季度收益排名前三的基金分别是中欧预见稳健养老一年持有 A、国泰民享稳健养老一年持有、南方富元稳健养老一年 A，收益分别为 7.03%、6.36%、6.05%。

¹ 新成立 FOF 在 3 个月建仓期后才参与统计。

表1: 2024Q3 偏债型 FOF 收益 TOP10

基金代码	基金简称	基金成立日	基金经理	2024Q3 收益
015999.OF	中欧预见稳健养老一年持有 A	20220719	桑磊	7.03%
014898.OF	国泰民享稳健养老一年持有	20230110	曾辉	6.36%
007159.OF	南方富元稳健养老一年 A	20190510	黄俊	6.05%
009151.OF	国寿安保策略优选 3 个月持有	20200806	张志雄	6.03%
018297.OF	南方浩稳优选 9 个月持有 A	20230506	黄俊	5.37%
016177.OF	东财稳健配置六个月持有 A	20221018	郭志斌	5.17%
015131.OF	鹏扬稳健优选一年持有 A	20220802	赵会龙	5.14%
018914.OF	华夏聚嘉优选三个月持有 A	20231219	卢少强,孟清扬	4.99%
005218.OF	华夏聚惠稳健目标 A	20171103	卢少强,孟清扬	4.84%
016368.OF	博时稳健优选三个月持有 A	20220914	张卫卫	4.83%

资料来源: Wind, 国信证券经济研究所整理

平衡型 FOF 中, 2024 年三季度收益排名前三的基金分别是同泰优选配置 3 个月持有 A、中欧预见养老 2035 三年 A、英大延福养老 2055 三年持有, 收益分别为 19.35%、12.31%、11.73%。

表2: 2024Q3 平衡型 FOF 收益 TOP10

基金代码	基金简称	基金成立日	基金经理	2024Q3 收益
013849.OF	同泰优选配置 3 个月持有 A	20211029	刘坚	19.35%
006321.OF	中欧预见养老 2035 三年 A	20181010	桑磊	12.31%
016922.OF	英大延福养老 2055 三年持有	20230301	申恒亮	11.73%
016217.OF	中银证券慧泽平衡 3 个月持有 A	20220713	威海宁,陈乐天	11.19%
006872.OF	长信颐天平衡养老(FOF)A	20190926	李宇,潘媛	11.14%
009573.OF	南方养老 2045 三年 A	20200722	黄俊	10.90%
017164.OF	英大延福养老 2060 三年持有	20230301	申恒亮,岳子义	10.80%
015359.OF	摩根博睿均衡一年持有 A	20220427	恩学海,吴春杰	10.62%
017394.OF	英大延福养老目标 2050 三年持有	20230801	申恒亮	10.32%
016649.OF	广发养老目标日期 2045 三年持有 A	20230505	杨喆,王浩	10.20%

资料来源: Wind, 国信证券经济研究所整理

偏股型 FOF 中, 2024 年三季度收益排名前三的基金分别是国泰优选领航一年持有、中欧汇选 A、中欧甄选 3 个月持有 A, 收益分别为 27.40%、22.04%、21.72%。

表3: 2024Q3 偏股型 FOF 收益 TOP10

基金代码	基金简称	基金成立日	基金经理	2024Q3 收益
013279.OF	国泰优选领航一年持有	20220105	曾辉	27.40%
501213.SH	中欧汇选 A	20211110	桑磊	22.04%
013381.OF	中欧甄选 3 个月持有 A	20211028	桑磊	21.72%
012282.OF	中欧睿智精选一年持有	20210628	桑磊,侯丹琳	21.64%
501220.SH	国泰行业轮动 A	20220719	曾辉	20.10%
017685.OF	中欧预见积极养老目标五年持有 A	20221230	邓达	19.92%
016138.OF	中银证券慧泽进取 3 个月持有 A	20220707	威海宁,陈乐天	18.85%
007241.OF	中欧预见养老 2050 五年 A	20190510	桑磊	17.94%
016170.OF	中欧盈选平衡 6 个月持有 A	20221206	桑磊	16.84%
501216.SH	富国智鑫行业精选 A	20211216	张子炎	16.78%

资料来源: Wind, 国信证券经济研究所整理

FOF 配置最多的基金

FOF 主要投资于其他基金资产，那么 2024 年三季报中 FOF 配置最多的基金是哪些？本文就市场关注度较高的几类基金分别统计了 **FOF 重仓数量最多和重仓规模最大的基金**，以供参考。需要注意的是，由于 FOF 季报只公布前十大基金，下文统计的 FOF 持有情况和增持情况可能与实际存在偏差。另外本文在统计过程中进行了以下处理：

- (1) 对于同一基金的不同份额（如 A/C 类等），我们仅使用初始份额进行统计，并将不同份额的规模进行了合并。如表 4 列出的重仓大成高新技术产业 A 的 FOF 数量和规模中同时包含了重仓大成高新技术产业 C 的 FOF 数量和规模。
- (2) 在 FOF 投资动态方面，我们对比的是 2024Q2 全部持仓的基金和 2024Q3 的重仓基金。在 2024Q3 没有被重仓的基金，不计算其增减情况。
- (3) 按重仓该基金的 FOF 数量对基金进行排序时，如果重仓该基金的 FOF 数量相同，则按 FOF 重仓规模排序。

FOF 配置最多的股票基金

◆ FOF 配置最多的主动权益基金

我们把保持较高权益仓位运作的基金称为主动权益基金，具体来说，本文将主动权益基金定义为 Wind 基金分类中的普通股票型基金、偏股混合型基金以及最近 4 个报告期权益仓位大于 70% 的灵活配置型基金。

表 4 展示了 FOF 配置最多的主动权益基金。按重仓该基金的 FOF 数量来看，排名第一的基金是刘旭先生管理的大成高新技术产业 A，共被 94 只 FOF 重仓，排名第二和第三的基金是杨思亮先生管理的宝盈品质甄选 A、杨鑫鑫先生管理的工银创新动力，分别被 29 只、22 只 FOF 重仓。

按 FOF 重仓规模来看，FOF 重仓规模最大的基金是刘旭先生管理的大成高新技术产业 A，重仓规模为 10.20 亿元，排名第二和第三的基金分别是杨宗昌先生管理的易方达供给改革、萧楠先生和王元春先生共同管理的易方达瑞恒，重仓规模分别为 6.20 亿元、5.79 亿元。

表4: FOF 配置最多的主动权益基金 TOP10（截至 20240930）

重仓该基金的 FOF 数量最多的基金					FOF 重仓规模最大的基金				
基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)	基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)
000628.OF	大成高新技术产业 A	刘旭	94	10.20	000628.OF	大成高新技术产业 A	刘旭	94	10.20
013859.OF	宝盈品质甄选 A	杨思亮	29	3.08	002910.OF	易方达供给改革	杨宗昌	14	6.20
000893.OF	工银创新动力	杨鑫鑫	22	2.18	001832.OF	易方达瑞恒	萧楠,王元春	13	5.79
010385.OF	华安汇嘉精选 A	王斌	19	3.18	011301.OF	易方达智造优势 C	祁禾	9	5.02
008269.OF	大成睿享 A	徐彦	18	1.21	002980.OF	华夏创新前沿	屠环宇	15	4.09
006567.OF	中泰星元价值优选 A	姜诚	17	3.25	450009.OF	国富中小盘 A	赵晓东	8	3.76
002980.OF	华夏创新前沿	屠环宇	15	4.09	010388.OF	易方达医药生物 C	杨桢霄,许征	6	3.46
006624.OF	中泰玉衡价值优选 A	姜诚	15	1.30	110029.OF	易方达科讯	刘健维	4	3.28
002910.OF	易方达供给改革	杨宗昌	14	6.20	006567.OF	中泰星元价值优选 A	姜诚	17	3.25
166301.OF	华商新趋势优选	周海栋	14	1.98	260112.OF	景顺长城能源基建 A	鲍无可	13	3.20

资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

◆ FOF 配置最多的股票型被动指数基金

近几年被动指数型基金快速发展，指数化投资越来越受到投资者认可。下面我们统计了 FOF 基金经理对股票型被动指数基金的配置情况。

表 5 展示了 FOF 配置最多的股票型被动指数基金。按重仓该基金的 FOF 数量来看，排名第一的基金是蔡卡尔女士和田希蒙先生共同管理的富国中证港股通互联网 ETF，共被 27 只 FOF 重仓，排名第二和第三的基金分别是柳军先生管理的华泰柏瑞沪深 300ETF、徐猛先生管理的华夏恒生科技 ETF，分别被 27 只、23 只 FOF 重仓。

按 FOF 重仓规模来看，FOF 重仓规模最大的基金是徐猛先生管理的华夏恒生 ETF，重仓规模为 7.46 亿元，排名第二和第三的基金分别是艾小军先生管理的国泰中证全指证券公司 ETF、徐猛先生管理的华夏恒生科技 ETF，重仓规模分别为 5.00 亿元、4.69 亿元。

表5: FOF 配置最多的股票型被动指数基金 TOP10（截至 20240930）

重仓该基金的 FOF 数量最多的基金					FOF 重仓规模最大的基金				
基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)	基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)
159792.OF	富国中证港股通互联网 ETF	蔡卡尔,田希蒙	27	3.37	159920.OF	华夏恒生 ETF	徐猛	16	7.46
510300.OF	华泰柏瑞沪深 300ETF	柳军	27	2.83	512880.OF	国泰中证全指证券公司 ETF	艾小军	16	5.00
513180.OF	华夏恒生科技 ETF	徐猛	23	4.69	513180.OF	华夏恒生科技 ETF	徐猛	23	4.69
159915.OF	易方达创业板 ETF	成曦,刘树荣	20	1.48	510900.OF	易方达恒生 H 股 ETF	余海燕,成曦,潘令旦	13	3.48
159920.OF	华夏恒生 ETF	徐猛	16	7.46	159792.OF	富国中证港股通互联网 ETF	蔡卡尔,田希蒙	27	3.37
512880.OF	国泰中证全指证券公司 ETF	艾小军	16	5.00	513500.OF	博时标普 500ETF	万琼	15	2.87
513500.OF	博时标普 500ETF	万琼	15	2.87	510300.OF	华泰柏瑞沪深 300ETF	柳军	27	2.83
510310.OF	易方达沪深 300ETF	余海燕,庞亚平	15	1.18	512890.OF	华泰柏瑞红利低波动 ETF	柳军	14	1.83
510500.OF	南方中证 500ETF	罗文杰	15	0.42	512000.OF	华宝中证全指证券 ETF	丰晨成,胡洁	5	1.56
512890.OF	华泰柏瑞红利低波动 ETF	柳军	14	1.83	159915.OF	易方达创业板 ETF	成曦,刘树荣	20	1.48

资料来源：Wind，国信证券经济研究所整理

◆ FOF 配置最多的指数增强基金

与被动指数型基金不同，指数增强基金在跟踪基准指数的基础上，力求获取更多超额收益，下面我们统计了 FOF 基金经理对指数增强基金的配置情况。

表 6 展示了 FOF 配置最多的指数增强基金。按重仓该基金的 FOF 数量来看，排名第一的基金是许一尊先生管理的汇添富中证 500 指数增强 A，共被 12 只 FOF 重仓，排名第二和第三的基金分别是许一尊先生管理的汇添富沪深 300 指数增强 A、李笑薇女士和方旻先生共同管理的富国沪深 300 增强 A，分别被 11 只、6 只 FOF 重仓。

按 FOF 重仓规模来看，FOF 重仓规模最大的基金是许一尊先生管理的汇添富沪深 300 指数增强 A，重仓规模为 2.81 亿元，排名第二和第三的基金分别是许一尊先生管理的汇添富中证 500 指数增强 A、申庆先生管理的兴全沪深 300 指数增强 A，重仓规模分别为 1.69 亿元、1.03 亿元。

表6: FOF 配置最多的指数增强基金 TOP10 (截至 20240930)

重仓该基金的 FOF 数量最多的基金					FOF 重仓规模最大的基金				
基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)	基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)
001050.OF	汇添富中证 500 指数增强 A	许一尊	12	1.69	005530.OF	汇添富沪深 300 指数增强 A	许一尊	11	2.81
005530.OF	汇添富沪深 300 指数增强 A	许一尊	11	2.81	001050.OF	汇添富中证 500 指数增强 A	许一尊	12	1.69
100038.OF	富国沪深 300 增强 A	李笑薇,方旻	6	0.76	163407.OF	兴全沪深 300 指数增强 A	申庆	1	1.03
008682.OF	富国中证红利指数增强 C	徐幼华,方旻	5	0.49	100038.OF	富国沪深 300 增强 A	李笑薇,方旻	6	0.76
004194.OF	招商中证 1000 指数增强 A	王平,蔡振	5	0.21	014156.OF	国泰君安中证 500C	胡崇海,邓雅琨	4	0.62
014156.OF	国泰君安中证 500C	胡崇海,邓雅琨	4	0.62	008682.OF	富国中证红利指数增强 C	徐幼华,方旻	5	0.49
010737.OF	易方达沪深 300 精选增强 C	张胜记	3	0.33	001015.OF	华夏沪深 300 指数增强 A	宋洋,袁英杰	2	0.41
009439.OF	西部利得国企红利指数增强 C	盛丰衍	3	0.10	018258.OF	国泰君安沪深 300 指数增强 C	胡崇海	1	0.38
001015.OF	华夏沪深 300 指数增强 A	宋洋,袁英杰	2	0.41	013332.OF	富国中证 500 指数增强 C	李笑薇,徐幼华,方旻	2	0.37
013332.OF	富国中证 500 指数增强 C	李笑薇,徐幼华,方旻	2	0.37	010737.OF	易方达沪深 300 精选增强 C	张胜记	3	0.33

资料来源: Wind, 国信证券经济研究所整理

FOF 配置最多的债券基金

◆ FOF 配置最多的债券型基金

为了凸显债券型基金的债券属性, 本文将债券型基金定义为 Wind 基金分类中的所有短期纯债型基金、被动指数型债券基金(非 ETF) 以及最近 4 个报告期权益占比小于 10% 的偏债混合型基金、混合债券型二级基金、混合债券型一级基金和中长期纯债型基金。

表 7 展示了 FOF 配置最多的债券型基金。按重仓该基金的 FOF 数量来看, 排名第一的基金是宋倩倩女士管理的广发纯债 A, 共被 34 只 FOF 重仓, 排名第二和第三的基金分别是黄莹洁女士管理的交银裕隆纯债 A、黄纪亮先生和陈倩女士共同管理的富国信用债 A, 分别被 27 只、26 只 FOF 重仓。

按 FOF 重仓规模来看, FOF 重仓规模最大的基金是黄莹洁女士管理的交银裕隆纯债 A, 重仓规模为 17.54 亿元, 排名第二和第三的基金分别是于海颖女士管理的交银丰晟收益 A、于海颖女士和魏玉敏女士共同管理的交银纯债 AB, 重仓规模分别为 9.95 亿元、9.21 亿元。

表7: FOF 配置最多的债券型基金 TOP10 (截至 20240930)

重仓该基金的 FOF 数量最多的基金					FOF 重仓规模最大的基金				
基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)	基金代码	基金名称	基金经理	FOF 数量	重仓规模 (亿元)
270048.OF	广发纯债 A	宋倩倩	34	6.55	519782.OF	交银裕隆纯债 A	黄莹洁	27	17.54
519782.OF	交银裕隆纯债 A	黄莹洁	27	17.54	005577.OF	交银丰晟收益 A	于海颖	7	9.95
000191.OF	富国信用债 A	黄纪亮,陈倩	26	5.09	519718.OF	交银纯债 AB	于海颖,魏玉敏	14	9.21
000032.OF	易方达信用债 A	纪玲云	24	4.89	014910.OF	东方红短债 A	丁锐,李燕	5	8.41
100066.OF	富国纯债 AB	吕春杰	22	5.77	008204.OF	交银稳利中短债 A	黄莹洁	17	7.18
004388.OF	鹏华丰享	方昶	20	4.64	006985.OF	兴全恒裕 A	王帅	19	6.81
003949.OF	兴全稳泰 A	王帅	20	4.62	270048.OF	广发纯债 A	宋倩倩	34	6.55
006985.OF	兴全恒裕 A	王帅	19	6.81	100066.OF	富国纯债 AB	吕春杰	22	5.77
003863.OF	招商招祥纯债 A	王梓林	19	4.25	000191.OF	富国信用债 A	黄纪亮,陈倩	26	5.09
006668.OF	华夏中短债 A	刘明宇	18	2.79	000032.OF	易方达信用债 A	纪玲云	24	4.89

资料来源: Wind, 国信证券经济研究所整理

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：<https://d.book118.com/237032150123006200>