

天治稳健双盈债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

受贸易摩擦等影响,市场对经济增长前景和企业盈利前景较为悲观,另外,金融去杠杆使得权益类市场资金能力下降,部分公司股票的股权回购比例上升带来自身的平仓风险,股票市场在二季度也经历了市场自身去杠杆的负面影响。

在这样的市场环境宏观背景下,稳健双盈2018年2季度的投资运作基本按照这一市场环境下资产配置,调整了组合配置结构和仓位,降低了权益仓位,调整了持仓结构,在债券市场分化的走势中获得超额收益,在权益市场调整中风险控制好于1季度。总的来看,组合调整的效果较好,风险控制有所好转,二季度表现好于1季度,但未能获得较大收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期末,本基金份额净值为1.7890元,报告期内本基金份额净值增长率为-0.66%,业绩比较基准收益率为2.16%,低于同期业绩比较基准收益率为2.82%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,本基金未出现持有人数少于200人或基金资产净值低于5000万的情况。

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	33,989,762.00	14.50
	其中:股票	33,989,762.00	14.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	196,377,426.22	85.49
	其中:债券	196,377,426.22	85.49
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行承兑票据和回购资产合计	896,577.29	0.39
8	其他资产	3,463,043.02	1.48
9	合计	233,566,808.53	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	2,270,262.00	1.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,784,548.00	4.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,216,022.00	1.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,141,528.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	18,407,402.00	8.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	文化、体育和娱乐业	-	-
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		33,989,762.00	15.62

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未有港股通投资股票。

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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.11 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未有股指期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未有国债期货。

5.10 报告期末资产支持证券