

泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

土其阿根廷等新兴经济体快速增长,人民币加速贬值等因素影响,A股市场一路下行,并一度接近2638点的前期低点。9月上旬,受中美贸易摩擦升级影响,A股市场继续震荡下行,并一度非常接近2638点的前期低点。但从9月中旬开始,受A股即将入摩和降准预期推动,蓝筹股带动了一波较强的反弹。本基金三季度重点持有了计算机、军工、电子元器件行业,对钢铁和建材等周期性板块进行了波段操作。在三季度末重点加仓了大金融板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末本基金份额净值为6.17元;本报告期基金份额净值增长率为-7.22%,业绩比较基准收益率为-0.45%。

4.6 报告期内基金持有的人数或基金份额净值预警说明
本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金份额净值低于五毛分的情况。

5.1 投资组合报告
5.1.1 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	92,991,679.20	89.74
2	固定收益	92,991,679.20	89.74
3	国债逆回购	-	-
4	银行存款	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,526,223.46	10.17
8	其他资产	97,246.62	0.09
9	合计	103,624,649.18	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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	49,742,370.20	44.40
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	房地产业	-	-
G	金融业	-	-
H	信息技术	2,837,200.00	2.76
I	其他行业	-	-
J	信息传输、软件和信息技术服务业	22,700,400.00	21.12
K	金融业	19,577,700.00	19.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,044,000.00	1.98
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	综合	-	-
合计		92,991,679.20	90.26

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300263	卫宁健康	260,000	3,740,200.00	3.64
2	600846	宝信软件	150,000	3,676,500.00	3.57
3	000977	浪潮信息	150,000	3,612,000.00	3.51
4	300168	万达信息	170,000	3,477,000.00	3.35
5	000781	中顺洁柔	202,000	3,297,700.00	3.11
6	601229	上海银行	200,000	3,060,000.00	2.96
7	300032	拥有科技	300,000	2,940,000.00	2.86
8	603128	华锐风电	410,000	2,837,200.00	2.76
9	002271	北方华创	60,000	2,823,000.00	2.74
10	600319	中国神华	60,000	2,812,800.00	2.73

5.4 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

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.13 投资组合报告附注

5.14 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.15 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.16 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.17 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.18 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.19 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.20 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.21 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.22 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.23 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.24 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.25 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.26 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.27 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.28 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.29 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.30 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.31 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.32 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.33 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.34 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.35 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.36 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.37 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.38 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.39 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.40 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.41 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.42 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.43 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.44 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.45 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.46 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.47 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.48 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.49 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.50 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.51 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.52 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.53 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.54 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.55 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.56 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.57 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.58 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.59 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.60 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.61 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.62 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.63 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.64 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.65 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.66 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.67 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.68 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.69 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.70 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.71 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.72 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.73 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.74 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.75 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.76 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.77 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.78 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.79 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.80 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.81 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.82 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.83 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.84 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.85 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.86 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.87 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.88 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.89 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.90 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.91 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.92 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.93 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.94 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.95 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.96 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.97 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.98 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.99 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.100 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.101 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.102 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.103 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.104 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.105 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.106 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.107 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.108 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.109 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.110 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.111 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.112 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.113 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.114 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.115 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.116 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.117 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.118 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.119 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.120 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.121 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.122 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.123 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.124 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.125 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.126 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.127 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.128 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.129 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.130 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.131 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.132 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.133 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.134 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.135 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.136 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.137 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.138 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.139 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.140 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.141 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.142 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.143 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.144 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.145 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.146 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.147 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.148 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.149 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.150 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.151 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.152 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.153 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.154 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.155 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.156 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.157 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.158 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.159 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.160 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.161 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.162 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.163 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.164 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.165 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.166 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.167 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.168 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.169 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.170 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.171 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.172 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.173 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.174 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.175 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.176 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.177 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.178 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.179 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.180 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.181 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.182 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.183 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.184 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.185 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.186 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.187 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.188 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.189 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.190 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.191 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.192 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.193 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.194 报告期内本基金投资的非公开发行股票

5.195 报告期内本基金投资的非公开发行股票