

泓德战略转型股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

人或基金资产净值低于五千元的情形。

§1 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	521,169,373.33	89.03
2	其中:股票	501,669,373.33	88.03
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	1,236,166.11	0.22
10	合计	522,405,539.44	100.00

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	21,303,304.00	3.07
B	制造业	301,036,326.52	56.28
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	19,831,289.00	3.14
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	住宿和餐饮业	-	-
H	金融业	34,623,560.25	5.10
I	信息技术、软件和信息技术服务业	77,989,077.08	12.06
J	其他资产	1,236,166.11	0.22
K	合计	600,474,906.96	100.00

§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	002538	顺鑫农业	669,532	36,004,477.90	6.01
2	001018	中信国安	453,988	31,089,960.00	5.19
3	300470	日创科技	1,228,698	30,585,876.60	5.03
4	002202	金融机具	2,384,704	29,761,116.64	4.84
5	000812	承德股份	666,727	27,798,547.35	4.64
6	000006	中航资本	1,809,988	26,060,088.28	4.28
7	000036	招商银行	799,404	25,563,476.00	4.20
8	000079	华安基金	524,228	23,546,263.52	3.87
9	300065	传智教育	942,220	21,264,220.00	3.49
10	300104	德康药业	2,304,300	21,393,904.00	3.47

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	1,236,166.11	0.22
10	合计	1,236,166.11	0.22

§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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100003	10国债03	1,000,000	122,654,000.00	3.27
2	180004	18国债04	1,200,000	122,064,000.00	3.26
3	180009	18国债09	1,200,000	121,926,000.00	3.25
4	180028	18国债28	1,200,000	121,238,000.00	3.24
5	180029	18国债29	1,200,000	121,137,000.00	3.23

§6 报告期末按资产类别分类的资产投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	1,236,166.11	0.22
10	合计	1,236,166.11	0.22

§7 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§8 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		100,166.19
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		1,208,448.13

§9 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§10 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§11 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§12 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§13 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§14 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§15 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§16 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§17 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§18 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§19 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§20 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§21 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§22 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§23 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§24 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§25 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§26 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		60,242.33
2	应收证券清算款		1,106,887.39
3	应收股利		-
4	应收利息		111,274,290.61
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		113,141,747.64

§27 投资组合报告附注

5.1.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码:600036、511)外,其他证券发行主体没有被监管部门立案调查,不存在被报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据2018年6月4日中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚字[2018]118),该处罚发行人因内部管理不到位违反审慎经营规则等14项违法违规事实被中国银行保险监督管理委员会处以罚款,并责令改正。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和核实,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资价值判断未发生改变。

5.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

§28 其他资产构成

||
||
||