

泓德泓益量化混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.5 报告期内基金的投资表现
截至报告期末泓德泓益量化混合基金份额净值为1.087元,本报告期内,基金份额净值增长率为-6.48%,同期业绩比较基准收益率为-2.50%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内基金持有人人数或基金资产净值均未触及本报告期内预警标准。

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	272,719,470.63	92.21
2	其中:股票	272,719,470.63	92.21
3	固定收益投资	27,210,762.20	8.79
4	其中:债券	27,210,762.20	8.79
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	107,232,303.08	34.30
10	其他资产	1,222,037.99	0.39
11	其他负债	994,232,303.08	306.00

5.2 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	9,157,000.00	22.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,232,303.08	26.42
D	电力、热力、燃气及生产性服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,796,603.34	3.89
G	交通运输、仓储和邮政业	11,490,700.00	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,702,270.00	4.50
J	金融业	76,383,404.00	17.56
K	房地产业	19,102,690.00	4.39
L	租赁和商务服务业	6,282,300.00	1.45
M	科学研究和技术服务业	6,982,100.00	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	2,582,090.00	0.59
S	文化、体育和娱乐业	13,608,064.55	3.14
T	合计	372,719,470.63	92.42

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	001318	中国平安	429,620	20,427,600.00	4.70
2	600036	招商银行	614,900	18,671,280.00	4.26
3	000009	深发展A	1,790,000	12,360,000.00	2.83
4	002242	深智信	699,100	12,439,000.00	2.83
5	000048	招商局A	740,000	9,006,000.00	2.02
6	300069	东方雨润	698,700	7,726,370.00	1.85
7	000223	启明星辰	168,000	7,707,480.00	1.85
8	000096	广联达	208,244	6,926,183.30	1.60
9	000001	平安银行	282,000	6,282,000.00	1.45
10	000227	众泰汽车	790,000	6,212,900.00	1.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至报告期末泓德泓益量化混合基金份额净值为1.087元,本报告期内,基金份额净值增长率为-6.48%,同期业绩比较基准收益率为-2.50%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内基金持有人人数或基金资产净值均未触及本报告期内预警标准。

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	170,068,306.26	85.07
2	其中:股票	170,068,306.26	85.07
3	固定收益投资	952,134.60	0.44
4	其中:债券	952,134.60	0.44
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	33,600,287.70	16.42
10	其他资产	19,401,908.00	9.63
11	其他负债	204,719,103.21	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	1,981,360.00	0.97
C	制造业	68,911,726.03	41.54
D	电力、热力、燃气及生产性服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	108,222.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	22,763,260.00	11.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,304,620.00	3.58
J	金融业	27,101,410.71	13.50
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	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	170,068,306.26	85.30

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	001318	中国平安	226,479	10,938,011.56	6.28
2	000036	招商银行	428,000	11,702,400.00	6.72
3	000096	广联达	175,017	11,103,720.00	6.60
4	000222	启明星辰	268,700	11,149,470.00	6.56
5	000048	招商局A	712,300	10,891,040.00	6.33
6	000029	天虹股份	122,500	9,702,000.00	5.75
7	000038	顺天能源	602,500	8,103,520.00	4.80
8	000001	平安银行	264,300	7,834,407.00	4.62
9	000001	平安银行	289,000	7,784,520.00	4.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至报告期末泓德泓益量化混合基金份额净值为1.087元,本报告期内,基金份额净值增长率为-6.48%,同期业绩比较基准收益率为-2.50%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内基金持有人人数或基金资产净值均未触及本报告期内预警标准。

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	170,068,306.26	85.07
2	其中:股票	170,068,306.26	85.07
3	固定收益投资	952,134.60	0.44
4	其中:债券	952,134.60	0.44
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	33,600,287.70	16.42
10	其他资产	19,401,908.00	9.63
11	其他负债	204,719,103.21	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	1,981,360.00	0.97
C	制造业	68,911,726.03	41.54
D	电力、热力、燃气及生产性服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	108,222.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	22,763,260.00	11.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,304,620.00	3.58
J	金融业	27,101,410.71	13.50
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	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	170,068,306.26	85.30

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	001318	中国平安	226,479	10,938,011.56	6.28
2	000036	招商银行	428,000	11,702,400.00	6.72
3	000096	广联达	175,017	11,103,720.00	6.60
4	000222	启明星辰	268,700	11,149,470.00	6.56
5	000048	招商局A	712,300	10,891,040.00	6.33
6	000029	天虹股份	122,500	9,702,000.00	5.75
7	000038	顺天能源	602,500	8,103,520.00	4.80
8	000001	平安银行	264,300	7,834,407.00	4.62
9	000001	平安银行	289,000	7,784,520.00	4.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至报告期末泓德泓益量化混合基金份额净值为1.087元,本报告期内,基金份额净值增长率为-6.48%,同期业绩比较基准收益率为-2.50%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内基金持有人人数或基金资产净值均未触及本报告期内预警标准。

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	170,068,306.26	85.07
2	其中:股票	170,068,306.26	85.07
3	固定收益投资	952,134.60	0.44
4	其中:债券	952,134.60	0.44
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	33,600,287.70	16.42
10	其他资产	19,401,908.00	9.63
11	其他负债	204,719,103.21	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	1,981,360.00	0.97
C	制造业	68,911,726.03	41.54
D	电力、热力、燃气及生产性服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	108,222.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	22,763,260.00	11.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,304,620.00	3.58
J	金融业	27,101,410.71	13.50
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	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	170,068,306.26	85.30

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	001318	中国平安	226,479	10,938,011.56	6.28
2	000036	招商银行	428,000	11,702,400.00	6.72
3	000096	广联达	175,017	11,103,720.00	6.60
4	000222	启明星辰	268,700	11,149,470.00	6.56
5	000048	招商局A	712,300	10,891,040.00	6.33
6	000029	天虹股份	122,500	9,702,000.00	5.75
7	000038	顺天能源	602,500	8,103,520.00	4.80
8	000001	平安银行	264,300	7,834,407.00	4.62
9	000001	平安银行	289,000	7,784,520.00	4.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至报告期末泓德泓益量化混合基金份额净值为1.087元,本报告期内,基金份额净值增长率为-6.48%,同期业绩比较基准收益率为-2.50%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内基金持有人人数或基金资产净值均未触及本报告期内预警标准。

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	170,068,306.26	85.07
2	其中:股票	170,068,306.26	85.07
3	固定收益投资	952,134.60	0.44
4	其中:债券	952,134.60	0.44
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	33,600,287.70	16.42
10	其他资产	19,401,908.00	9.63
11	其他负债	204,719,103.21	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	1,981,360.00	0.97
C	制造业	68,911,726.03	41.54
D	电力、热力、燃气及生产性服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	108,222.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	22,763,260.00	11.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,304,620.00	3.58
J	金融业	27,101,410.71	13.50
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	水利、环境和公共设施管理业	-	-