

天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§1 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	162,528,968.18	68.04
2	其中:股票	162,528,968.18	68.04
3	固定收益投资	828,897.50	0.34
4	资产支持证券	828,897.50	0.34
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	79,764,428.02	32.74
10	其他资产	136,278.08	0.06
11	合计	243,415,173.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	14,533,287.88	6.18
B	医药	-	-
C	制造业	147,896,690.32	61.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	租赁和商务服务业	-	-
K	科学研究和技术服务业	-	-
L	水利、环境和公共设施管理业	-	-
M	教育、文体、娱乐和休闲服务业	-	-
N	其他行业	-	-
合计		162,528,968.18	67.38

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	600674	中国核能	532,068	16,791,767.68	6.90
2	002289	圣发股份	802,189	14,533,287.88	6.18
3	603288	海天味业	102,324	11,187,891.20	4.62
4	600893	旭创科技	369,000	10,464,300.00	4.33
5	600519	贵州茅台	36,300	9,817,303.08	4.05
6	002511	中国铝业	1,110,400	9,460,400.00	3.92
7	600086	同方股份	318,448	8,762,765.43	3.60
8	000887	伊利股份	230,400	7,569,162.00	3.13
9	002627	南广食品	301,000	7,469,872.00	3.09
10	600108	海螺水泥	642,000	7,387,158.00	3.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	1130013	光大转债	5,264,048.00	0.88	
2	125004	中信转债	4,460,770.15	0.36	

天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	717,389,643.35	97.34
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,741,764.27	0.91
8	其他资产	727,753,722.46	99.00
9	合计	727,753,722.46	99.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林、牧、渔业	-	-
2	医药	-	-
3	制造业	-	-
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储和邮政业	-	-
7	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
8	金融业	-	-
9	房地产业	-	-
10	租赁和商务服务业	-	-
11	科学研究和技术服务业	-	-
12	水利、环境和公共设施管理业	-	-
13	教育、文体、娱乐和休闲服务业	-	-
14	其他行业	-	-
合计		717,389,643.35	115.87

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

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

2	央行票据	-	-
3	金融债券	162,524,000.00	27.07

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

4	企业债券	443,772,928.00	73.90
---	------	----------------	-------

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

6	中期票据	50,688,000.00	8.44
7	可转债(可交换债)	10,047,715.85	1.67

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9	其他		
---	----	--	--

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:可转债项下包含可交换债4,560,770.10元。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资策略

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1130013	光大转债	5,264,048.00	0.88	
2	125004	中信转债	4,460,770.15	0.36	

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1100211	1100000000	900,000	91,107,000.00	16.19

5.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

3	180210	18国开10	400,000	41,252,000.00	6.87
---	--------	--------	---------	---------------	------

5.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

5	112690	187 发01	300,000	30,429,000.00	5.07
---	--------	---------	---------	---------------	------

5.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

5.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1130013	光大转债	5,264,048.00	0.88	
2	125004	中信转债	4,460,770.15	0.36	

5.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1130013	光大转债	5,264,048.00	0.88	
2	125004	中信转债	4,460,770.15	0.36	

5.18 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

2019年第四季度招生

5.19 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1130013	光大转债	5,264,048.00	0.88	
2	125004	中信转债	4,460,770.15	0.36	

5.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

度宽松,但是期间央行也曾停止逆回购操作长达36个交易日之久,表明央

5.21 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

显著、宽信用乐观预期出现预期差以及股市下跌引发风险偏好显著回落

5.22 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

本基金在报告期内,严格按照监管指标要求,严控信用风险,以稳健风格进

5.23 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

4.5 报告期内基金的业绩表现

5.24 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

75%,同期业绩比较基准增长率1.08%。

5.25 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

5.26 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.27 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

1	权益投资	—	—
---	------	---	---

5.28 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

2	基金投资		
	FOF基金(人民币)		

5.29 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

	资产支持证券	—	—
--	--------	---	---

5.30 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

6	金融衍生品投资	—	—
7	资产支持证券	—	—

5.31 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

资产	—	—
金融资产	—	—
金融资产公允价值变动损益	—	—
金融资产减值损失	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回	—	—
金融资产减值损失转回</		

5.32 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

8	其他资产	17,922,400.40	1.21
9	合计	1,438,042,438.81	100.00

5.33 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票

5.34 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1130013	光大转债	5,264,048.00	0.88	
2	125004	中信转债	4,460,770.15	0.36	

5.35 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细