泓德裕鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:泓德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泓德裕鑫一年定开债券
基金主代码	004196
基金运作方式	契约型、定期开放式,本基金以定期开放的方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金自《基金合同》生效后,每年开放一次
基金合同生效日	2017年05月24日
报告期末基金份额总额	348,225,291.12份
投资目标	本基金在保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人带来长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金的主要投资策略包括:类属资产配置策略、期限配置策略、利率策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、国债期货投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等。 本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,预测未来的利率趋势,判断证券市场对上述变量和政策的反应,并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平,利息支付方式、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素,采取积极投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权数。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	泓德裕鑫一年定开债券A	泓德裕鑫一年定开债券C
下属分级基金的交易代码	004196	004197
报告期末下属分级基金的份额总额	348,022,812.29份	202,478.83份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)	
	泓德裕鑫一年定开债券A	泓德裕鑫一年定开债券C
1.本期已实现收益	8,133,493.47	2,224.37
2.本期利润	5,617,156.03	1,920.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0144	0.0174
4.期末基金资产净值	401,827,275.12	232,081.69
5.期末基金份额净值	1.155	1.146

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2019年06月30日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德裕鑫一年定开债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.32%	0.09%	-0.24%	0.06%	1.56%	0.03%

泓德裕鑫一年定开债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.24%	0.08%	-0.24%	0.06%	1.48%	0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李倩	泓德泓利货币、泓德裕泰债券、泓德泓富混合、泓德泓业混合、泓德裕旗债券、泓德裕荣纯债债券、泓德裕和纯债债券、泓德裕祥债券、泓德裕利货币、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕丰中短债债券基金经理	2017-06-24	-	7年	硕士研究生,具有基金从业资格。资管行业从业经验10年。曾任中国农业银行股份有限公司金融市场部,资产管理部理财组合投资经理,中信建投证券股份有限公司资产管理部债券交易员、债券投资经理助理。
赵珊瑚	泓德裕荣纯债债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕丰中短债债券、泓德裕祥债券基金经理	2018-10-25	-	4年	硕士研究生,具有基金从业资格。资管行业从业经验13年。曾任太安财产保险股份有限公司资产管理中心固定收益部资深投资经理、阳光资产管理股份有限公司固定收益投资事业部高级投资经理。泰买基金管理有限公司机构业务部产品经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《泓德裕鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度,债券市场收益率先上后下,6月份以后维持窄幅震荡,4月份开始,由于PMI向好,经济、金融数据接连超市场预期,同时货币政策开始出现边际收紧的迹象,DR007中枢水平有所提升,市场对货币政策转向存在担忧,再叠加通胀高企等多重利空因素引发债券市场大幅回调,十年期国债收益率由不到3.1%快速上行至3.4%左右,信用债收益率也跟随利率债大幅上行。5月份开始,偏弱的PMI数据已经使此前过于乐观的经济预期略有下修,加上特朗普政府对从中国进口的2000亿美元产品加征的关税从10%提高到25%,经济悲观预期再起,债券收益率出现一波下行。5月下旬包商事件爆发,市场一度受到冲击,随即央行释放大量流动性进行对冲,整体资金面极为宽松,但却出现了流动性分层的现象,市场风险偏好显著降低,尽管短期风险因素趋于稳定,但信用风险重定价是个中长期的过程,预计利差分层及等级利差的走扩将面临持续压力。

在报告期本基金通过对宏观经济的研究、对利率水平变化趋势的判断,积极调整债券组合的平均久期和杠杆水平,信用上不太做主体资质的下沉,保持以投资中高等级信用债为主,精挑个券,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合资产的增值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德裕鑫一年定开债券A基金份额净值为1.155元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.32%,同期业绩比较基准收益率为-0.24%;截至报告期末泓德裕鑫一年定开债券C基金份额净值为1.146元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.24%,同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	629,288,200.00	96.18
	其中:债券	629,288,200.00	96.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,841,282.13	1.81
8	其他资产	13,166,654.73	2.01
9	合计	654,296,136.86	100.00

5.2 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。

5.3 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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	203,859,100.00	50.70
5	企业短期融资券	25,083,500.00	6.24
6	中期票据	400,345,600.00	99.57
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	629,288,200.00	156.52

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101800432	18大同煤矿MTN002	385,000	39,331,600.00	9.78
2	101800321	18陕煤化MTN002	350,000	36,837,500.00	9.16
3	101800667	18豫交投MTN001	350,000	36,760,500.00	9.14
4	101764039	17晋能MTN004	350,000	35,980,000.00	8.95
5	143099	17连港01	320,000	32,630,400.00	8.12

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除17连港01(证券代码143099)外,其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2019年1月16日,17连港01发行人大连港股份有限公司因公司重大应收款项减值准备计提程序不当被上海证券交易所予以监管关注。

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分析,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判断未发生改变。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,421.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,158,233.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,166,654.73

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	泓德裕鑫一年定开债券A	泓德裕鑫一年定开债券C
报告期期初基金份额总额	410,041,793.80	60,895.50
报告期期间基金总申购份额	137,994,378.97	148,062.30
减:报告期期间基金总赎回份额	200,013,360.48	6,478.97
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	348,022,812.29	202,478.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/05/31-2019/06/30	69,999,000.00	0.00	0.00	69,999,000.00	20.10%
	2	2019/05/31-2019/06/30	69,999,000.00	0.00	0.00	69,999,000.00	20.10%
	3	2019/04/01-2019/05/30	200,008,000.00	0.00	200,008,000.00	0.00	0.00%
产品特有风险							

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。由于基金份额持有人占比相对集中,本基金可能存在集中赎回甚至巨额赎回从而引起基金净值大幅波动的风险,甚至引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,有效防控产品流动性风险,在运作中保持合适的流动性水平,保护持有人利益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证券监督管理委员会批准泓德裕鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金设立的文件

(2)《泓德裕鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》

(3)《泓德裕鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)泓德裕鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

地点为管理人地址:北京市西城区德胜门外大街125号

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司,客户服务电话:4009-100-888

(3)投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
2019年07月17日

泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:泓德基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泓德臻远回报混合
基金主代码	005395
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月04日
报告期末基金份额总额	376,455,232.01份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过研究宏观经济未来长期运行趋势及调控政策规律,结合对股票、债券等大类资产运行趋势、风险收益对比及估值情况等进行的综合分析,进行本基金资产在股票、债券等大类资产的配置。 在A股投资方面,本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的方法进行股票投资。在个股投资层面,本基金选择长期成长行业进行重点投资。在个股投资层面,本基金重点投资于长期成长行业中具有竞争优势的上市公司,在港股通标的股票投资范围,在对A、H股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下,本基金管理人将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。 本基金债券投资采取适当的久期策略、信用策略、时机策略和可转换债券投资策略相结合的方法。 本基金本着谨慎原则,从风险管理角度出发,适度参与股指期货、国债期货投资。权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的品种,其长期预期风险与预期收益特征低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。 本基金除了投资于A股市场优质企业外,还可在法律法规规定的范围内投资港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	13,901,689.25
2.本期利润	-7,631,048.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0191
4.期末基金资产净值	402,743,852.06
5.期末基金份额净值	1.0698

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2019年06月30日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

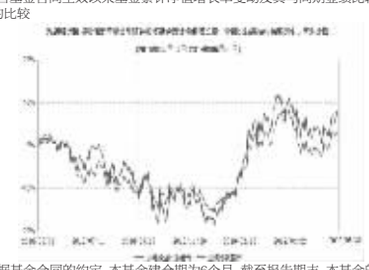
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.60%	1.48%	-0.61%	1.14%	-0.99%	0.34%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:根据基金合同的约定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹传雁	公司副总经理、事业二部总监,泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德臻远回报混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合基金经理	2018-05-04	-	5年	硕士研究生,具有基金从业资格,资管行业从业经验19年。曾任华夏人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理,阳光保险集团股份有限公司资产投资管理中心投资负责人,阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理,光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管,光大证券股份有限公司研究所分析师,华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度, 外国美国特朗普政府对中国的贸易战突然朝不利方向发展,季末出现缓和迹象。国内方面随着宏观经济继续呈现预期内的放缓趋势,调控政策继续温和偏松,减税降费等实质性政策的逐步落实。本基金继续坚定地长期看好,在人口老龄化和新技术新管理新商业模式背景下的国内经济转型,认为养老服务产业链和新技术、新管理、新商业模式创新相关产业具备长期向好的强劲的内在基础。具体行业方面长期看好创新药产业链、高端内容层面的传媒行业、电子、新能源、云计算产业链和智能零售等六个方向。

2019年二季度,金融市场资金状况继续偏松,股票市场和可转债市场反而出现较大的回撤波动,市场风险偏好快速回落,机构和个人投资者信心逐步下降。HS300指数和创业板指数在二季度分别下跌1.21%和10.75%。

整个二季度,面对波动加大的A股市场,本基金仍然坚定地坚持长期回报的理念,没有进行主动的股票配置比例下调,维持偏长期成长股票组合的稳定;考虑到股票池中股票的绝对估值仍然处于较低估的状态,本基金仍然坚定地坚持高比例的股票配置。二季度本基金绝大部分时间用于多维度考证持仓股票和一批潜在投资对象的管理能力方面,备选股票名单略有扩充,对少数研究较为深入个股进行了增持。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德臻远回报混合基金份额净值为1.0698元,本报告期内,基金份额净值增长率为-1.60%,同期业绩比较基准收益率为-0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	362,315,628.58	89.62
	其中:股票	362,315,628.58	89.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,322,763.42	8.74
	其中:债券	35,322,763.42	8.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,090,894.42	1.51
8	其他资产	531,529.12	0.13
9	合计	404,260,815.54	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币26,261,642.00元,占期末净值比例6.52%。

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	-	-
B	采矿业	209,673.65	0.05
C	制造业	261,196,668.61	64.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,173,334.30	0.29
J	金融业	15,253,173.24	3.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,471,217.74	0.37
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	56,749,919.04	14.09
S	综合	-	-
	合计	336,053,986.58	83.44

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	4,917,550.00	1.22
医疗保健	21,344,092.00	5.3
合计	26,261,642.00	6.52

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	002841	视源股份	482,896	37,429,268.96	9.29
2	600276	恒瑞医药	546,900	36,095,400.00	8.96
3	002475	立讯精密	1,436,410	35,608,603.90	8.84
4	601012	隆基股份	1,487,897	34,385,299.67	8.54
5	300124	汇川技术	1,348,415	30,892,187.65	7.67
6	603096	新经典	563,482	30,213,904.84	7.50
7	300251	光线传媒	3,898,957	26,512,907.60	6.58
8	600563	法拉电子	620,000	25,525,400.00	6.34
9	02359	药明康德	354,200	21,344,092.00	5.30
10	002595	豪迈科技	916,879	19,263,627.79	4.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,212,000.00	5.02
	其中:政策性金融债	20,212,000.00	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	15,110,763.42	3.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,322,763.42	8.77

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150208	15国开08	200,000	20,212,000.00	5.02
2	110034	九州转债	57,410	5,883,376.80	1.46
3	113021	中信转债	50,000	5,197,000.00	1.29
4	128020	水晶转债	20,392	2,023,090.32	0.50
5	128069	视源转债	7,940	912,306.00	0.23

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除中信转债(证券代码113021)外,其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年12月7日,中信银行收到发行人中信银行股份有限公司因理财资金违规缴纳土地款信息披露虚假或严重误导性陈述,未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会处以罚款2280万元。

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分析,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判断未发生改变。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91,750.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	117,392.00
4	应收利息	207,104.50
5	应收申购款	115,282.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	531,529.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	5,883,376.80	1.46
2	128020	水晶转债	2,023,090.32	0.50

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	425,251,155.42
报告期期间基金总申购份额	66,444,893.75
减:报告期期间基金总赎回份额	115,240,817.16
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	376,455,232.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证券监督管理委员会批准泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3)《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

地点为管理人地址:北京市西城区德胜门外大街125号

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司,客户服务电话:4009-100-888

(3)投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
2019年07月17日

泓德三年封闭运作丰泽混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:泓德基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期