

天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	—	—
C	制造业	90,350,329.02	12.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,098,802.00	0.96
E	建筑业	101,842.00	0.01
F	批发和零售业	74,080.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	11,060,366.09	1.68
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	37,140,636.58	5.22
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究、技术服务及地质勘查业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	公园、休闲和娱乐业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生、社会保障和社会福利业	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	信息业	—	—
	合计	146,721,143.09	20.49

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

金额单位:人民币元

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	002669	美的集团	1,220,137	16,329,433.00	2.30
2	000033	美的集团	400,000	13,320,000.00	1.97
3	300007	东方财富	1,216,300	13,246,507.00	1.96
4	601006	农业银行	1,661,300	11,819,041.00	1.66
5	002422	平安银行	600,000	11,062,000.00	1.56
6	000079	海通证券	3,000,000	10,820,000.00	1.52
7	000176	中国石化的	1,017,100	10,740,670.00	1.51
8	600014	上汽集团	419,000	10,646,910.00	1.50
9	002036	京东方A	299,922	10,011,396.36	1.41
10	601169	银行股	999,000	9,600,115.00	1.36
	合计		683,927,000.00	96.16	

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五名债券投资组合

金额单位:人民币元

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	企业短期融资券	—	—
3	金融债券	139,990,000.00	19.68
4	其中:政策性金融债	139,990,000.00	19.68
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	公司债	—	—
8	可转债	—	—
9	公司存单	543,937,000.00	76.47
10	其他	—	—
	合计	683,927,000.00	96.16

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1117100000	17兴业银行CD000	1,400,000	136,460,000.00	19.47
2	1117100100	17上海银行CD016	1,300,000	128,570,000.00	18.08
3	1117100200	17江苏银行CD007	1,200,000	116,696,000.00	16.08
4	170304	17国开行	1,000,000	99,360,000.00	14.06
5	11171072	17平安银行CD077	900,000	99,010,000.00	13.63
	合计		683,927,000.00	96.16	

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五名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	—	—	—	—
2	—	—	—	—
3	—	—	—	—
4	—	—	—	—
5	—	—	—	—
	合计		700,664,152.61	10.03

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	基金代码	基金名称	基金类型	基金代码
1	天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金	混合型	002669	天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金	混合型	002669
2	天弘永定债券型证券投资基金	债券型	000033	天弘永定债券型证券投资基金	债券型	000033

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贵金属投资组合

金额单位:人民币元

序号	贵金属品种	贵金属名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	—	—	—	—	—
2	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
	合计		0	0.00	0.00

5.9 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股票投资组合

金额单位:人民币元

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	002669	美的集团	1,220,137	16,329,433.00	2.30
2	000033	美的集团	400,000	13,320,000.00	1.97
3	300007	东方财富	1,216,300	13,246,507.00	1.96
4	601006	农业银行	1,661,300	11,819,041.00	1.66
5	002422	平安银行	600,000	11,062,000.00	1.56
	合计		683,927,000.00	96.16	

5.10 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组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—	—	—
2	企业短期融资券	—	—	—	—
3	金融债券	139,990,000.00	19.68	139,990,000.00	19.68
4	其中:政策性金融债	139,990,000.00	19.68	139,990,000.00	19.68
5	企业短期融资券	—	—	—	—
	合计		683,927,000.00	96.16	

5.11 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资产支持证券投资组合

金额单位:人民币元

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

<tbl_r cells="6" ix="4" maxcspan="1" maxr