

# 华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

## 2017年第三季度报告

报告者基金资产净值低于五千万元的情况

\$ 6 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	125,379,881.00	33.77
	其中：股票	125,379,881.00	33.77
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	货币市场基金	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	衍生金融产品投资	-	-
5	买入返售资金资产	169,500,000.00	46.62
6	银行存款和结算备付金合计	76,412,528.10	2.03
7	其他各项资产	221,982.12	0.06
8	合计	371,514,391.22	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)	占基金净资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,574,686.00	0.96
C	制造业	67,042,161.00	18.08
D	电力、火力、燃气及水生产和供应业	8,907,214.00	2.40
E	建筑业	-	-
F	批发零售业	3,589,748.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	3,542,452.00	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,802,480.00	1.83
J	金融业	19,278,405.00	5.20
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	12,651,760.00	3.41
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	-	-
S	综合	-	-
合计		125,379,881.00	33.77

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

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债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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二十名权证及投资品种投资明细

本基金本报告期末未持有权证及投资品种。

5.9 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.10 报告期末持有的其他投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有其他投资的国债期货。

5.11 报告期末持有的其他投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有其他投资的股指期货。

5.12 报告期末持有的其他投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有其他投资的国债期货。

5.13 其他资产构成情况

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.14 报告期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。

5.15 报告期前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限情况。

5.16 报告期投资组合报告中的其他披露事项

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

报告期各区间份额变动情况

报告期各区间份额变动情况