

泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

万市场证, 市场参与数量快速增加, 项目折扣率显著降低, 出于审慎的考虑, 产品并未进一步申购的定增项目, 同时产品和参与参与新股申购以进一步增加产品收益。此外, 由于二季度市场出现较为明显的回调, 不少公司出现了较长时间的停牌, 因此本基金在追求长期稳健投资收益的前提下, 加大了股票资产的投资。这一配置使得本基金在三季度市场上涨的过程中较为主动, 并随着市场的逐步上落略微降低了仓位, 为客户实现稳健的收益。后续配置策略主要从自上而下的角度, 精选具备长期成长空间个股进行择机配置, 为客户创造长期稳健价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末, 本基金的基金份额净值为1.162元, 本报告期份额净值增长率为2.74%, 同期业绩比较基准增长率为1.05%。

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	258,428,354.40	31.83
2	其中: 股票	258,428,354.40	31.83
3	固定收益投资	303,529,465.10	41.79
4	其中: 债券	303,529,465.10	41.79
5	货币资金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	应收股利	-	-
8	应收利息	-	-
9	其他资产	-	-
10	合计	361,957,819.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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十名债券投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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十名资产支持证券投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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贵金属投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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权证投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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股指期货投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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国债期货投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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商品期货投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

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贵金属投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	2,080,000.00	0.46
B	制造业	39,793.00	0.01
C	信息技术	191,710,047.90	20.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	5,351,300.00	0.58
F	交通运输业	8,263,027.28	0.89
G	金融业	26,571.21	0.00
H	房地产业	3,334,100.00	0.36
I	综合类	13,899,302.56	1.47
J	其他行业	68,200,124.08	7.19
K	其他资产	4,988,543.00	0.53
L	其他资产	-	-
M	其他资产	-	-
N	其他资产	-	-
O	其他资产	-	-
P	其他资产	-	-
Q	其他资产	-	-
R	其他资产	-	-
S	其他资产	-	-
T	其他资产	-	-
U	其他资产	-	-
V	其他资产	-	-
W	其他资产	-	-
X	其他资产	-	-
Y	其他资产	-	-
Z	其他资产	-	-
合计		258,428,354.40	31.83

5.12 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

8	其他资产	8,068,518.23	1.79
9	合计	450,232,554.49	100.00