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

基金管理人:泓德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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2017年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泓德泓业混合
基金主代码	001695
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月27日
报告期末基金份额总额	810,918,416.44份
投资目标	本基金通过科学的、谨慎的大类资产配置策略,和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略,力争实现绝对收益的目标。
投资策略	本基金在对宏观经济周期及宏观调控政策规律的分析与研究的基础上,结合股票、债券、货币等大类资产的市场变化趋势、风险收益对比、估值情况等因素,对基金资产进行灵活配置。股票投资方面,本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的方法选择具有较高安全边际的股票进行投资。债券投资方面,本基金将采取久期策略、信用策略、时机策略等多策略。本基金力争通过科学、谨慎的大类资产配置策略、和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略,力争为投资人带来稳健的投资回报。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高收益的品种,其长期风险与收益特征低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1.本期已实现收益	25,376,772.35
2.本期利润	28,839,351.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0319
4.期末基金资产净值	942,585,216.49
5.期末基金份额净值	1.162

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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2017年9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。

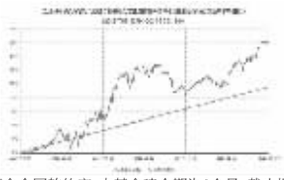
3.2 基金净值表现

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	2.74%	0.27%	1.05%	0.01%	1.69%	0.26%

注:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%

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,截止报告期末,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
邹传耀	公司副总经理,本基金、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德裕泰债券、泓德泓利货币、泓德致远混合基金经理	2015-08-27	-	17年	硕士研究生,具有基金从业资格,曾任幸福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。
李倩	本基金、泓德泓利货币、泓德裕泰债券、泓德泓富混合、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕祯利货币、泓德裕祥一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德泓华混合基金经理	2016-02-04	-	8年	硕士研究生,具有基金从业资格,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。
秦毅	研究部总监助理,本基金基金经理	2017-06-02	-	5年	博士研究生,具有基金从业资格,曾任本公司特定客户资产投资部投资经理,阳光资产管理股份有限公司研究部研究员。

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、《泓德泓业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

2017年三季度,宏观经济数据仍然延续了较好的复苏趋势。资本市场流动性由二季度时的偏紧转为中性,市场风格方面也由二季度开始呈现的风险偏好急剧下降,转为风险偏好逐步恢复。在这一过程中,主板和创业板均呈现出稳步回升的态势。

就定增市场整体而言,由于市场风险偏好发生显著变化,定增市场呈现卖方市场特征,市场参与者数量快速增加,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新的定增项目,同时产品积极参与新股申购以进一步增强产品收益。此外,由于二季度市场出现较为明显的回调,不少公司出现了长期价值的投资机会,因此本基金在追求长期稳健投资收益的前提下,加大了股票仓位的配置。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涨略微降低了仓位,为客户实现稳健的收益。后续配置思路主要从自下而上的角度,精选具备长期成长空间的个股进行择机配置,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	298,426,954.46	31.63
	其中:股票	298,426,954.46	31.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	393,539,455.10	41.70
	其中:债券	393,539,455.10	41.70
	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	66,860,253.79	7.09
	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	16,927,371.19	1.79
8	其他资产	167,885,154.98	17.79
9	合计	943,639,189.52	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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	191,710,047.79	20.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	3,321,328.00	0.35
F	批发和零售业	8,253,537.25	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	3,334,160.04	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,899,302.56	1.47
J	金融业	58,320,728.25	6.19
K	房地产业	4,988,516.00	0.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	37,937.00	0.00
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	4,982,408.83	0.53
R	文化、体育和娱乐业	9,482,529.80	1.01
S	综合	-	-
	合计	298,426,954.46	31.66

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	300003	乐普医疗	847,500	18,212,775.00	1.93
2	000970	中科三环	851,112	15,243,415.92	1.62
3	601398	工商银行	2,357,700	14,146,200.00	1.50
4	601288	农业银行	3,359,200	12,832,144.00	1.36
5	603338	浙江鼎力	192,880	11,279,622.40	1.20
6	000538	云南白药	120,900	10,965,630.00	1.16
7	601988	中国银行	2,373,300	9,777,996.00	1.04
8	601318	中国平安	180,000	9,748,800.00	1.03
9	600132	重庆啤酒	428,769	9,462,931.83	1.00
10	002273	水晶光电	367,300	9,380,842.00	1.00

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	49,930,000.00	5.30
	其中:政策性金融债	49,930,000.00	5.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	339,169,000.00	35.98
7	可转债(可交换债)	4,440,455.10	0.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	393,539,455.10	41.75

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	101469010	14丰台国资MTN001	500,000	51,020,000.00	5.41
2	101551007	15国电集MTN002	500,000	49,945,000.00	5.30
3	170401	17农发01	500,000	49,930,000.00	5.30
4	101558037	15扬城建MTN001	400,000	39,540,000.00	4.19
5	101552011	15三峡MTN002	300,000	29,973,000.00	3.18

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	64,865.29
2	应收证券清算款	161,550,289.05
3	应收股利	-
4	应收利息	6,269,591.15
5	应收申购款	409.39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	167,885,154.98

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	代码	名称	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	4,177,135.80	0.44

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有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	811,105,680.40
报告期期间基金总申购份额	23,862.91
减:报告期期间基金总赎回份额	211,126.87
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	810,918,416.44

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,700.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,700.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.23

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	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/07/01-2017/09/30	799,999,000.00	0.00	0.00	799,999,000.00	98.65
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泓业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3)《泓德泓业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)泓德泓业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

基金管理人、基金托管人处

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
二〇一七年十月二十五日

泓德泓益量化混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月25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2017年10月24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2017年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泓德泓益量化混合
基金主代码	002562
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年04月26日
报告期末基金份额总额	369,899,011.50份
投资目标	本基金通过数量化投资模型,在严格控制风险的前提下,合理配置资产权重,精选个股,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产长期稳健增值。
投资策略	基金管理人主要以宏观政策、微观行业、市场情绪为基础,构建中短期系统风险模型,进行市场风险的主动判断,为基金仓位权模调整和利用股指期货管理系统风险提供准确的量化依据。 本基金通过合理确定股票、股指期货、债券、现金等金融工具上的投资比例,达到控制净值大幅回撤风险,改善投资组合的风险收益特性的目的。 在股票投资中,本基金将运用基金管理人开发的"多因子阿尔法模型"、"行业轮动模型"、"事件驱动模型"等各类量化模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中,将定期或不定期的进行修正,优化股票投资组合。本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略,结合定量分析和定性分析的方法,综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、和收益补偿因素,选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与股指期货投资。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高收益的品种,其长期风险与收益特征低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
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

§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(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1.本期已实现收益	21,353,795.74
2.本期利润	15,325,260.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0414
4.期末基金资产净值	448,986,051.47
5.期末基金份额净值	1.214

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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2017年09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。

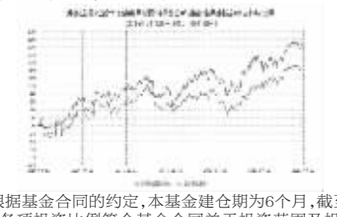
3.2 基金净值表现

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	3.58%	0.65%	4.49%	0.50%	-0.91%	0.15%

注:本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%

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,截至报告日,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
苏昌景	本基金基金经理	2016-04-29	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格,曾任本公司研究部研究员、国都证券股份有限公司研究所金融工程研究员、资产管理总部总经理助理、投资经理。

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、《泓德泓益量化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

报告期内, 本基金按照一贯的经过实证检验的基本面量化策略进行投资管理。报告期内量化模型运行平稳,权益持仓维持在90%的水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,泓德泓益量化混合的基金份额净值为1.214元,本报告期份额净值增长率为3.58%,同期业绩比较基准增长率为4.49%。

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	371,927,437.33	82.61
	其中:股票	371,927,437.33	82.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,721,490.00	11.04
	其中:债券	49,721,490.00	11.04
	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	8,500,000.00	1.89
	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	12,025,108.93	2.67
8	其他资产	8,058,518.23	1.79
9	合计	450,232,554.49	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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,080,000.00	0.46
B	采矿业	10,616,847.10	2.36
C	制造业	180,331,574.92	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,678,773.44	0.37
E	建筑业	6,629,480.00	1.48
F	批发和零售业	19,164,556.35	4.27
G	交通运输、仓储和邮政业	10,365,051.19	2.31
H	住宿和餐饮业	332,976.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,882,126.58	2.87
J	金融业	88,258,073.00	19.66
K	房地产业	11,852,274.00	2.64
L	租赁和商务服务业	3,938,205.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	6,845,099.00	1.52
N	水利、环境和公共设施管理业	8,254,034.26	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,806,798.99	0.40
R	文化、体育和娱乐业	6,891,570.50	1.53
S	综合	-	-
	合计	371,927,437.33	82.84

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	601318	中国平安	393,200	21,295,712.00	4.74
2	601939	建设银行	767,400	5,348,778.00	1.19
3	601288	农业银行	1,395,000	5,328,900.00	1.19
4	002142	宁波银行	336,900	5,316,282.00	1.18
5	601166	兴业银行	307,000	5,308,030.00	1.18
6	601988	中国银行	1,275,400	5,254,648.00	1.17
7	601169	北京银行	703,800	5,250,348.00	1.17
8	600036	招商银行	203,900	5,209,645.00	1.16
9	000001	平安银行	468,500	5,205,035.00	1.16
10	002583	海能达	302,800	5,023,452.00	1.12

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	19,960,000.00	4.45
	其中:政策性金融债	19,960,000.00	4.45
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)	85,490.00	0.02
8	同业存单	29,676,000.00	6.61
9	其他	-	-
10	合计	49,721,490.00	11.07

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	111720220	17广发银行CD220	300,000	29,676,000.00	6.61
2	170301	17进出01	200,000	19,960,000.00	4.45
3	132012	17巨化KB	830	85,490.00	0.02

注:本基金本报告期末只持有三只债券。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1712	中证500股指期货1712合约	16	20,839,680.00	266,786.67	-
IC1803	中证500股指期货1803合约	9	11,648,520.00	139,920.00	-
公允价值变动总额合计(元)					406,706.67
股指期货投资本期收益(元)					356,493.33
股指期货投资本期公允价值变动(元)					343,586.67

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同, 我们可以使用股指期货代替一部分现货仓位,以提升本基金的资金利用效率及产品流动性。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	6,908,372.78
2	应收证券清算款	689,816.89
3	应收股利	-
4	应收利息	431,645.30
5	应收申购款	28,683.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,058,518.23

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有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	370,180,763.88
报告期期间基金总申购份额	1,899,403.52
减:报告期期间基金总赎回份额	2,171,155.90
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	369,899,011.50

§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	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/07/01-2017/09/30	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	27.03
机构	2	2017/07/01-2017/09/30	200,008,000.00	0.00	0.00	200,008,000.00	54.07
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泓益量化混合型证券投资基金设立的文件

(2)《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》

(3)《泓德泓益量化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)泓德泓益量化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

基金管理人、基金托管人处

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
二〇一七年十月二十五日

泓德添利货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:泓德基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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2017年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泓德添利货币	
基金主代码	003997	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年06月04日	
报告期末基金份额总额	540,386,419.74份	
投资目标	在控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类