

大成景沛灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年第三季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易；主动投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易情形；投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易，原因为投资策略需要；投资组合间相向交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但组合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度，宏观政策出现了一些微调。财政方面，7月的国务院常务会议强调财政政策更加积极，三季度地方债也确实加快了发行，但目前地方政府加杠杆空间有限。货币政策方面，资金面持续相对宽松，但货币市场利率在8月达到低点后有有所反弹，未来进一步下行可能受到汇率和通胀的约束。金融监管政策继续落地，但节奏趋缓，受益于政策的微调而整体利率水平的下降，表外融资萎缩的速度减缓，信用收缩趋缓。

具体到市场方面，三季度纯债上涨为主，其中信用债表现较利率债好。以中债综合财富总指数为例，三季度上涨了约15%，利率债收益率曲线明显陡峭化，其中，代表性品种10年期国债二季度末上行13bps，10年期国债收益率下降了75bps。信用债市场方面，主要股债的中高表现，其中上证50指数二季度涨幅约6%，创业板指数下跌12%。

操作上，大类资产配置方面主要侧重于中短久期信用债和蓝筹股。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末，大成景沛灵活配置混合A基金份额净值为1.066元；本报告期基金份额净值增长率为2.50%，同期业绩比较基准收益率为1.07%。

4.6 报告期内基金持有人或或基金资产净值预警说明
本基金在本报告期内，曾出现了连续20个工作日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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	421,397,203	52.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	货币资金	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	应收利息	63,234,839	8.00
9	其他	7,291,308,649	913.00

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	-	-
C	制造业	421,397,203	60.1
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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	合计	421,397,203	60.1

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.3 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	000485	贺龙集团	39,458	421,397.20	60.1

5.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.3.1 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

5.3.2 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明细

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.3.4 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权证投资明细

5.3.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.3.6 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.3.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.3.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.3.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.3.10 本期国债期货投资政策

5.3.11 本期国债期货投资评价

5.4 投资组合报告附注

5.4.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

5.4.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

5.4.3 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

5.4.4 本基金投资的前十名债券是否超出基金合同规定的备选股票库之外股票。

5.4.5 其他资产构成

5.4.6 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股票投资明细

5.4.7 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债券投资明细

5.4.8 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资产支持证券投资明细

5.4.9 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权证投资明细

5.4.10 本基金投资的股指期货交易情况说明

5.4.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.4.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.4.13 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.4.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.4.15 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.4.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.4.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.4.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.4.19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.4.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.4.21 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.4.22 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.23 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.24 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.25 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.26 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.27 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.28 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.29 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.30 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.31 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.32 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.33 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.34 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.35 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.36 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.37 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.38 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.39 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.40 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.41 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.42 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.43 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.44 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.45 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.46 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.47 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.48 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.49 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.50 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.51 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.52 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.53 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.54 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.55 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.56 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.57 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.58 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.59 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.60 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.61 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.62 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.63 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.64 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.65 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.66 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.67 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.68 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.69 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.70 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.71 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.72 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.73 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.74 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.75 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.76 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.77 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.78 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.79 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.80 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.81 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.82 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.83 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.84 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.85 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.86 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.87 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.88 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.89 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.90 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.91 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.92 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.93 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.94 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.95 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.96 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.97 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.98 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.99 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.100 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.101 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.102 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.103 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.104 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.105 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.106 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.107 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.108 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.109 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.110 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.111 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.112 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.113 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.114 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.115 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.116 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.117 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.118 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.119 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.120 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.121 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.122 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.123 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.124 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.125 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.126 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.127 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.128 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.129 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.130 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.131 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.132 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.133 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.134 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.135 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.136 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.137 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.138 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.139 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.140 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.141 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.142 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.143 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.144 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.145 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.146 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.147 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.148 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.149 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.150 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.151 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.152 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.153 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.154 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.155 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.156 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.157 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.158 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.159 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.4.160 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合