

大成景恒混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.3.2 异常交易行为的专项说明
 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3季度公司旗下主动投资组合间交易不存在同日反向交易；主动投资组合组合与指数投资组合之间或指数投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易组合公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易且超过该组合当日成交5%的交易情形；投资组合间指数投资组合组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易组合公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易且超过该组合当日成交5%的交易情形；投资组合间非交易类投资组合组合之间存在股票同日反向交易，成交均价与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，但不存在交易价差分布统计分析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，宏观局势依然未趋于明朗。中美贸易摩擦是当前最为突出的矛盾，进而影响国内经济的增长。随着美国中期大选临近，多方利益冲突也愈激烈。作为最敏感资产类别，人民币相对美元汇率继续走低。在国内方面，虽然近期公布经济数据尚可，但长远发展的根基并不牢固。货币政策相对宽松，银行间流动性较为充裕，但资金并没有进入股市的态势。

本季度股票市场表现仍然不理想，整体呈宽幅震荡的走势，本季度市场整体涨跌幅度为-2.06%，在普跌背景下跌幅加深。较二季度有极大改善，但板块分化非常严重。市值因子区分度更为显著，表明两市大盘蓝筹股和中证100指数本季度上涨1.12%，下跌0.43%，起到了稳定大盘的作用；而表征成长股的综合、创业板指数则分别下跌10.43%和12.16%。在行业方面，金融、钢铁、煤炭等周期板块表现较好，而受消费数据下滑的影响，家电、纺织服装等行业则表现较差。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
 截至三季度末，本基金已完成建仓，投资组合符合基金合同约定的要求。基于对后市阶段性反弹的判断，在投资风格方面，基金持仓偏重于中小市值、反弹因子。本季度基金A类份额净值下降0.30%。

截至本报告期末大成景恒混合A基金份额净值为1.011，本报告期基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为-1.29%；截至本报告期末大成景恒混合C基金份额净值为1.047，本报告期基金份额净值增长率为3.46%，同期业绩比较基准收益率为2.08%。

4.6 报告期内基金持有人数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60个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同约定拟定相关应对方案上报中国证监会资产管理部。

5.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	300,166.00	2.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,288,782.00	49.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,320.00	1.62
E	建筑业	1,132,642.00	5.77
F	批发和零售业	1,480,801.00	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	97,215.00	4.03
H	住宿和餐饮业	202,128.00	1.01
I	信息技术业	697,046.00	3.68
J	金融业	513,348.00	2.62
K	房地产业	929,032.00	4.73
L	租赁和商务服务业	79,016.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	275,006.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	其他行业	-	-
R	合计	38,000,000.00	1.96

5.2 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股票投资组合明细

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	600011	华仪股份	40,000	613,744.00	2.62
2	600022	海螺水泥	72,000	427,016.00	2.18
3	002285	大立科技	132,000	318,048.00	2.13
4	000759	中航工业	32,800	301,168.00	2.04
5	000769	中航光电	62,000	337,400.00	2.02
6	002521	伟思医疗	60,300	303,168.00	2.02
7	600195	双环传动	31,000	309,312.00	1.96
8	600620	现代制药	26,000	288,460.00	1.91
9	001940	南方传媒	40,000	308,000.00	1.90
10	002526	龙力食品	47,000	284,400.00	1.86

5.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001	中期票据	16,328,224.00	81.02
2	160002	中期票据	16,328,224.00	81.02

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明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001	中期票据	16,328,224.00	81.02
2	160002	中期票据	16,328,224.00	81.02

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资产支持证券投资明细
 无。

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明细
 无。

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明细
 无。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.8.1 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(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
IF1810	沪深300股指期货	1	38,520.00	-	-

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.9.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
T1812	国债期货	1	38,520.00	-	-

5.10 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.10.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	300,166.00	2.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,288,782.00	49.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,320.00	1.62
E	建筑业	1,132,642.00	5.77
F	批发和零售业	1,480,801.00	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	97,215.00	4.03
H	住宿和餐饮业	202,128.00	1.01
I	信息技术业	697,046.00	3.68
J	金融业	513,348.00	2.62
K	房地产业	929,032.00	4.73
L	租赁和商务服务业	79,016.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	275,006.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	其他行业	-	-
R	合计	38,000,000.00	1.96

5.10.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
 无。

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十名债券投资组合明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001	中期票据	16,328,224.00	81.02	
2	160002	中期票据	16,328,224.00	81.02	

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资产支持证券投资明细
 无。

5.13 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
 无。

5.14 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
 无。

5.15 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.15.1 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(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
IF1810	沪深300股指期货	1	38,520.00	-	-

5.15.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.15.2.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
T1812	国债期货	1	38,520.00	-	-

5.15.3 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.15.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	300,166.00	2.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,288,782.00	49.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,320.00	1.62
E	建筑业	1,132,642.00	5.77
F	批发和零售业	1,480,801.00	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	97,215.00	4.03
H	住宿和餐饮业	202,128.00	1.01
I	信息技术业	697,046.00	3.68
J	金融业	513,348.00	2.62
K	房地产业	929,032.00	4.73
L	租赁和商务服务业	79,016.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	275,006.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	其他行业	-	-
R	合计	38,000,000.00	1.96

5.15.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
 无。

5.15.4 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组合明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001	中期票据	16,328,224.00	81.02	
2	160002	中期票据	16,328,224.00	81.02	

5.15.5 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资产支持证券投资明细
 无。

5.15.6 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明细
 无。

5.15.7 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明细
 无。

5.15.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.15.8.1 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(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
IF1810	沪深300股指期货	1	38,520.00	-	-

5.15.8.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.15.8.2.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
T1812	国债期货	1	38,520.00	-	-

5.15.8.3 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.15.8.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	300,166.00	2.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,288,782.00	49.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,320.00	1.62
E	建筑业	1,132,642.00	5.77
F	批发和零售业	1,480,801.00	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	97,215.00	4.03
H	住宿和餐饮业	202,128.00	1.01
I	信息技术业	697,046.00	3.68
J	金融业	513,348.00	2.62
K	房地产业	929,032.00	4.73
L	租赁和商务服务业	79,016.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	275,006.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	其他行业	-	-
R	合计	38,000,000.00	1.96

5.15.8.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
 无。

5.15.8.4 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组合明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001	中期票据	16,328,224.00	81.02	
2	160002	中期票据	16,328,224.00	81.02	

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

5.15.8.4.3 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贵金属投资明细
 无。

5.15.8.4.4 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
 无。

5.15.8.4.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.15.8.4.5.1 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(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
IF1810	沪深300股指期货	1	38,520.00	-	-

5.15.8.4.5.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.15.8.4.5.2.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
T1812	国债期货	1	38,520.00	-	-

5.15.8.4.5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.15.8.4.5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	300,166.00	2.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,288,782.00	49.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,320.00	1.62
E	建筑业	1,132,642.00	5.77
F	批发和零售业	1,480,801.00	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	97,215.00	4.03
H	住宿和餐饮业	202,128.00	1.01
I	信息技术业	697,046.00	3.68
J	金融业	513,348.00	2.62
K	房地产业	929,032.00	4.73
L	租赁和商务服务业	79,016.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	275,006.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	国防军工	-	-
Q	其他行业	-	-
R	合计	38,000,000.00	1.96

5.15.8.4.5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
 无。

5.15.8.4.5.4 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组合明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001	中期票据	16,328,224.00	81.02	
2	160002	中期票据	16,328,224.00	81.02	

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

5.15.8.4.5.4.3 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贵金属投资明细
 无。

5.15.8.4.5.4.4 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
 无。

5.15.8.4.5.4.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.15.8.4.5.4.5.1 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(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
IF1810	沪深300股指期货	1	38,520.00	-	-

5.15.8.4.5.4.5.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.15.8.4.5.4.5.2.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(张)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	浮动盈亏(元)
T1812	国债期货	1	38,520.00	-	-

5.15.8.4.5.4.5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.15.8.4.5.4.5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	300,166.00	2.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,288,782.00	49.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,320.00	1.62
E	建筑业	1,132,642.00	5.77
F	批发和零售业	1,480,801.00	7.99