

景顺长城能源基建混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
3季度,国内经济较为景气,我们认为国内经济在未来2-3个季度仍将保持稳定。尽管9月底国家出台了定向降准政策,我们认为这并不意味着货币政策的转向放松,当前的利率水平仍将维持较长时间。

3季度,A股市场整体上涨,沪深300指数上涨4.63%,创业板综指上涨4.04%。3季度,基金在操作上较为谨慎,基金净值上涨3.22%。
展望2017年4季度,整体经济仍将保持平稳,在房产、股票(包括港股)、现金、债券、商品这几类资产中,我们更加看好股票。尽管今年蓝筹股经历了大幅上涨,当前还有一些蓝筹股仍然具有机会。此外,随着创业板的下跌,一些质地优良的成长股开始值得投资。

均衡配置的风格将在下一个阶段延续。选股一直是我们的投资流程的关键,本基金将坚持自下而上选股,继续挖掘成长和基建行业内的投资机会,买入持有业务壁垒高、估值相对便宜的个股,力争获取长期回报。

4.5 报告期内基金的投资表现
2017年3季度,本基金净值增长率为3.22%,业绩比较基准收益率为3.82%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

§ 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,638,797,882.52	68.63
其中:股票	1,638,797,882.52	68.63	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	期货投资	-	-
6	买入返售金融资产	678,001,487.90	27.21
7	银行存款和拆入的款项及债券融资款	-	-
8	其他资产	86,321,353.07	3.43
9	其他负债	94,400,103.94	3.79
10	合计	2,403,001,454.43	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

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	61,389,244.69	2.56
B	采矿业	48,277,913.93	1.98
C	制造业	579,913,961.27	23.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	498,064,794.34	20.30
E	建筑业	17,383,460.30	0.72
F	批发和零售业	38,515,066.67	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.91	0.00
H	信息传输、软件和信息技术服务业	17,400.03	0.00
I	金融业	121,327,877.64	5.01
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	1,020,300.00	0.04
N	卫生和社会工作	169,482,119.3	6.83
B	文化、体育和娱乐业	44,000.00	0.00
9	合计	1,638,797,882.52	67.63

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	农、林、牧、渔业	61,389,244.69	2.56
B	采矿业	48,277,913.93	1.98
C	制造业	579,913,961.27	23.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	498,064,794.34	20.30
E	建筑业	17,383,460.30	0.72
F	批发和零售业	38,515,066.67	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.91	0.00
H	信息传输、软件和信息技术服务业	17,400.03	0.00
I	金融业	121,327,877.64	5.01
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	1,020,300.00	0.04
N	卫生和社会工作	169,482,119.3	6.83
B	文化、体育和娱乐业	44,000.00	0.00
9	合计	1,638,797,882.52	67.63

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	600066	中国铝业	8,300	136,536.00	0.42
2	600089	中国神华	9,300	26,011.00	0.09
3	600074	保千里	1,400	39,260.00	0.06
4	600040	中国国航	1,300	14,402.00	0.04
5	600315	上海石化	300	9,477.00	0.03
6	600560	中国医药	200	4,880.00	0.02
7	600528	长城汽车	400	4,930.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种和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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金股指期货投资不包括股指期货。

5.10 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持有国债期货。

5.11 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金国债期货投资不包括国债期货。

5.12 其他衍生品投资

无。

5.13 投资组合报告附注

1.本基金投资前10名股票中未出现基金合同规定的备选股票库。

2. 涉及九名证券发行主体基金合同规定有监管部门立案调查或在本基金编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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	300222	润达医疗	1,349,855	21,722,773.89	6.49
2	000568	泸州老窖	149,000	20,128,640.00	6.08
3	000088	五洲药业	161,000	20,128,640.00	6.08
4	601089	招商局港	672,138	16,431,760.32	4.93
5	300016	荣信股份	679,260	16,162,464.34	4.79
6	000335	安洁科技	249,400	15,231,236.00	4.57
7	000008	中国石化	343,274	14,796,668.88	4.36
8	000001	平安银行	549,000	14,284,300.00	4.28
9	600703	三七互娱	576,500	13,287,762.00	3.91
10	300069	三钢闽光	636,000	13,202,371.00	3.89

5.4 报告期末按债券品种和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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金股指期货投资不包括股指期货。

5.10 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持有国债期货。

5.11 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金国债期货投资不包括国债期货。

5.12 其他衍生品投资

无。

5.13 投资组合报告附注

1.本基金投资前10名股票中未出现基金合同规定的备选股票库。

2. 涉及九名证券发行主体基金合同规定有监管部门立案调查或在本基金编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.2.2 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	14,284,000.00	3.36
B	采矿业	29,763.00	0.01
C	制造业	279,312,776.00	63.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,866,400.00	5.01
E	建筑业	11,869,153.00	2.78
F	批发和零售业	26,385.46	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.91	0.01
H	信息传输、软件和信息技术服务业	8,316,770.03	1.97
I	金融业	29,768,122.00	6.89
J	房地产业	7,779,400.00	1.82
M	水利、环境和公共设施管理业	6,182,000.00	1.43
N	卫生和社会工作	16,297,143.3	3.80
B	文化、体育和娱乐业	44,000.00	0.01
9	合计	396,244,006.06	92.36

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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	300222	润达医疗	1,349,855	21,722,773.89	6.49
2	000568	泸州老窖	149,000	20,128,640.00	6.08
3	000088	五洲药业	161,000	20,128,640.00	6.08
4	601089	招商局港	672,138	16,431,760.32	4.93
5	300016	荣信股份	679,260	16,162,464.34	4.79
6	000335	安洁科技	249,400	15,231,236.00	4.57
7	000008	中国石化	343,274	14,796,668.88	4.36
8	000001	平安银行	549,000	14,284,300.00	4.28
9	600703	三七互娱	576,500	13,287,762.00	3.91
10	300069	三钢闽光	636,000	13,202,371.00	3.89

5.4 报告期末按债券品种和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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金股指期货投资不包括股指期货。

5.10 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持有国债期货。

5.11 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金国债期货投资不包括国债期货。

5.12 其他衍生品投资

无。

5.13 投资组合报告附注

1.本基金投资前10名股票中未出现基金合同规定的备选股票库。

2. 涉及九名证券发行主体基金合同规定有监管部门立案调查或在本基金编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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

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	300222	润达医疗	1,349,855	21,722,773.89	6.49
2	000568	泸州老窖	149,000	20,128,640.00	6.08
3	000088	五洲药业	161,000	20,128,640.00	6.08
4	601089	招商局港	672,138	16,431,760.32	4.93
5	300016	荣信股份	679,260	16,162,464.34	4.79
6	000335	安洁科技	249,400	15,231,236.00	4.57
7	000008	中国石化	343,274	14,796,668.88	4.36
8	000001	平安银行	549,000	14,284,300.00	4.28
9	600703	三七互娱	576,500	13,287,762.00	3.91
10	300069	三钢闽光	636,000	13,202,371.00	3.89

5.4 报告期末按债券品种和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

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金股指期货投资不包括股指期货。

5.10 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持有国债期货。

5.11 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金国债期货投资不包括国债期货。

5.12 其他衍生品投资

无。

5.13 投资组合报告附注

1.本基金投资前10名股票中未出现基金合同规定的备选股票库。

2. 涉及九名证券发行主体基金合同规定有监管部门立案调查或在本基金编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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

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	300222	润达医疗	1,349,855	21,722,773.89	6.49
2	000568	泸州老窖	149,000	20,128,640.00	6.08
3	000088	五洲药业	161,000	20,128,640.00	6.08
4	601089	招商局港	672,		