

大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

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;投资组合虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析并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

2017年第四季度股票市场表现为震荡调整的格局,上证指数跌1.25%,中小板综指跌3.89%,创业板综指跌0.45%,上证50指数最稳,本季度继续上涨,涨幅达7.04%,市场风格还是以大盘蓝筹占优。从行业板块来看,食品饮料、家电、医药生物、银行在本季度表现较好,尤其是食品饮料和家电,涨幅都在9%以上。同时综合、计算机、国防军工、有色等跌幅在9%以上。本基金在第四季度增持了保险、钢铁、地产行业,调减了食品饮料和银行,由于个股还是以大盘蓝筹为主,所以整体收益还不错。

债券方面,今年四季度经济增长稳中趋缓,消费品价格上涨,工业品价格整体上涨。货币政策中性,执行的货币政策工具进一步丰富,前峰填谷的操作特征更明显,四季度资金价格基本持平三季度。具体到市场方面,由于本报告期内债预期的更为积极,金融监管的趋势明确,监管政策持续落地,债券收益率中权在四季度进一步上升,曲线维持平坦。以中债综合财富指数衡量,四季度下跌了0.43%,属年内四季度末组合久期基本保持稳定,组合仍以信用债息票类为主。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报投资者。

4.5 报告期内基金的投资业绩和净值

截至本报告期末大成景鹏灵活配置混合A基金份额净值为1.244元,本报告期末基金份额净值增长率为4.98%,同期业绩比较基准收益率为1.07%;截至本报告期末大成景鹏灵活配置混合C基金份额净值为1.221元,本报告期末基金份额净值增长率为4.81%,同期业绩比较基准收益率为1.16%。

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

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	61,306,294.20	62.04
2	固定收益	61,306,294.20	62.04
3	银行存款	6,001,203.20	6.09
4	买入返售金融资产	6,001,203.20	6.09
5	应收利息	6,001,203.20	6.09
6	其他资产	6,001,203.20	6.09
7	资产支持证券	27,000,000.00	27.48
8	其他	2,266,166.60	2.30
9	合计	108,252,000.40	109.00

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	农、林、牧、渔业	3,629,162.00	3.70
B	采矿业	12,601,602.00	12.80
C	制造业	759,000.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,301,420.00	4.39
E	建筑业	1,684,166.00	1.71
F	批发和零售业	92,222.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	36,400,000.00	36.11
H	信息传输、软件和信息技术服务业	3,027,472.00	3.07
I	金融业	61,306,294.20	62.04
J	房地产业	2,266,166.60	2.30
K	其他	61,306,294.20	62.04

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	3,629,162.00	3.70
B	采矿业	12,601,602.00	12.80
C	制造业	759,000.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,301,420.00	4.39
E	建筑业	1,684,166.00	1.71
F	批发和零售业	92,222.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	36,400,000.00	36.11
H	信息传输、软件和信息技术服务业	3,027,472.00	3.07
I	金融业	61,306,294.20	62.04
J	房地产业	2,266,166.60	2.30
K	其他	61,306,294.20	62.04

大成景阳领先混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

截至本报告期末本基金份额净值为1.052元;本报告期基金份额净值增长率为11.91%,业绩比较基准收益率为3.98%。

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

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	1,905,798,210.41	69.60
2	固定收益	1,905,798,210.41	69.60
3	银行存款	3,138,897.00	0.11
4	买入返售金融资产	3,138,897.00	0.11
5	应收利息	3,138,897.00	0.11
6	其他资产	3,138,897.00	0.11
7	资产支持证券	150,000,000.00	5.32
8	其他	3,697,723.00	0.13
9	合计	3,697,723.00	0.13

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	61,306,294.20	0.22
B	采矿业	1,166,000,000.00	4.14
C	制造业	759,000.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,301,420.00	0.01
E	建筑业	117,400.00	0.00
F	批发和零售业	92,222.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	64,000,000.00	0.22
H	信息传输、软件和信息技术服务业	361,340.00	0.00
I	金融业	96,251,234.50	0.34
J	房地产业	261,000,000.00	0.92
K	其他	146,000,000.00	0.52
M	科学仪器、软件和信息技术服务	746,260.17	0.00
N	软件和信息技术服务业	76,000,000.00	0.27
O	其他	1,684,166.00	0.00
P	文化、体育和娱乐业	130,000,000.00	0.46
Q	其他	1,684,166.00	0.00
R	合计	1,684,166.00	0.00

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	3,629,162.00	3.70
B	采矿业	12,601,602.00	12.80
C	制造业	759,000.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,301,420.00	4.39
E	建筑业	1,684,166.00	1.71
F	批发和零售业	92,222.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	36,400,000.00	36.11
H	信息传输、软件和信息技术服务业	3,027,472.00	3.07
I	金融业	61,306,294.20	62.04
J	房地产业	2,266,166.60	2.30
K	其他	61,306,294.20	62.04

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

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	000284	辽河油田	3,760,000	100,770,760.00	41.00
2	000262	京东方A	6,090,000	100,000,000.00	39.99
3	000166	申通快递	1,000,000	100,000,000.00	39.99
4	000009	招商局A	3,010,000	100,000,000.00	39.99
5	000136	顺鑫农业	1,364,200	88,777,000.00	34.97
6	000284	辽河油田	10,700,000	88,000,000.00	34.80
7	000001	平安银行	4,888,000	76,000,000.00	30.00
8	000003	五粮液	4,000,000	72,000,000.00	28.00
9	000007	招商局A	1,000,000	72,000,000.00	28.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	30,000,782.00	10.00
2	央行票据	30,000,782.00	10.00
3	金融债券	30,000,782.00	10.00
4	企业债券	30,000,782.00	10.00
5	其他	30,000,782.00	10.00
6	其他	30,000,782.00	10.00
7	其他	30,000,782.00	10.00
8	其他	30,000,782.00	10.00
9	其他	30,000,782.00	10.00
10	其他	30,000,782.00	10.00

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债券投资

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	000030	中信证券	55,700	3,887,880.00	9.95
2	000039	浦发银行	402,700	3,783,900.00	9.79
3	000036	招商银行	122,070	3,568,580.00	9.29
4	000398	中国银行	848,700	3,300,330.00	8.70
5	000288	包钢股份	878,200	3,303,900.00	8.70
6	000026	中国石化	107,200	3,264,360.00	8.59
7	000120	格力电器	504,000	3,133,560.00	8.20
8	000199	金隅股份	53,200	381,300.00	0.98
9	000166	中国铝业	21,700	368,000.00	0.95
10	000018	华联控股	41,700	368,000.00	0.95

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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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股指期货投资

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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国债期货

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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权证投资

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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权证投资

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.15 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.16 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.17 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.18 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.19 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.20 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.21 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.22 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.23 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.24 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.25 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.26 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.27 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.28 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.29 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.30 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.31 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32

5.32 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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	150,000,000.00	5.32