

## 大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)

### 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;投资组合虽然存在反向交易行为,但组合交易价差分析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

本年的资本市场是蓝筹股及周期股估值回归的过程,可以看成是前两年极端行情的对称反跌。截止目前,已经较难发现系统性低估的品种。本基金当季季度突出部分估值合理未来转型升级中具备不确定性的制造业公司,买入部分竞争格局稳定定价能力较强的消费品公司。其他持仓保持不变。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.190元;本报告期基金份额净值增长率为9.68%,业绩比较基准收益率为3.29%。

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	2,177,262,977.01	90.30
2	其中:股票	2,177,262,977.01	90.30
3	固定收益投资	-	0.00
4	其中:债券	-	0.00
5	资产支持证券	-	0.00
6	贵金属投资	-	0.00
7	金融衍生品投资	-	0.00
8	买入返售金融资产	-	0.00
9	其他资产	-	0.00
10	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	0.00
11	银行间同业拆借和债券合计	233,203,403.06	9.69
12	其他负债	689,227.08	0.03
13	合计	2,411,266,707.14	100.00

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	-	0.00
B	采矿业	63,892,879.00	2.66
C	制造业	1,408,306,300.25	63.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,143.20	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	69,360.35	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	54,262,483.52	2.28
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	367,200.03	0.01
J	金融业	385,729,519.93	12.96
K	房地产业	49,366,269.23	2.08
L	租赁和商务服务业	49,618,947.74	2.07
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	23,469,816.96	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	147,729,946.26	6.16
R	文化、体育和娱乐业	147,729,946.26	6.16
S	综合	-	0.00
合计		2,177,262,977.01	90.30

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	-	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		-	0.00

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	002128	融信股份	18,391,216	177,634,133.89	7.20
2	002640	万润股份	9,254,347	171,386,022.79	7.13
3	000072	中航电子	9,000,747	161,064,495.72	6.67
4	300344	朗科信息	7,800,301	146,164,795.26	6.07
5	600741	华域汽车	4,852,088	143,464,432.73	5.98
6	601138	中国平安	2,006,863	140,436,073.04	5.85
7	000032	苏泊尔	3,238,091	134,762,114.58	5.62
8	002584	创世纪	2,423,338	109,319,727.41	4.56
9	000010	大众交通	4,660,504	106,725,543.60	4.46
10	002037	美尚股份	1,547,000	100,394,406.22	4.18

5.2.4 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明细

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.5 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资产支持证券投资明细

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.6 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贵金属投资明细

序号	债券品种	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.11 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期权投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	债券品种	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,438	343,900.00	0.11
2	金融债	520	54,728.20	0.02
3	企业债	275	27,260.00	0.04

5.2.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

投资操作上,权益资产将继续注重自下而上挖掘投资机会,选取符合政策、盈利确定向好、估值具备安全边际的品种进行重点配置。适度提高杠杆,