

信息披露

大成定增灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

和新增供给加大的双重压力下,市盈率持续降低,大量无增长性及无缺点的公司出现流动性过剩。中国经济人入稳定发展阶段,传统行业去库存存,龙头公司市占率持续提升至有定价权,加之宏观经济回暖,市场长期资金入市,形成正向共振。2018年以来长期被压制的大市值蓝筹白马公司重新受到重视,并演绎了前所未有的业绩+估值双提升行情。

本季度,基金组合进一步向各行业核心公司聚焦,同时也在次新股中甄别细分类成长标的,在投资做减法的同时,努力在研究层面做加法,我们为未来一段时间,市场仍是积极可为的,主动管理能持续创造增值。

截至本报告期末本基金份额净值为1.000元;本报告期基金份额净值增长率为-0.10%,业绩比较基准收益率为2.88%。

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	785,440,701.68	77.03
2	其中:股票	785,440,701.68	77.03
3	债券投资	-	0.00
3.1	国债逆回购	-	0.00
4	资产支持证券	-	0.00
4.1	资产支持证券	-	0.00
5	贵金属投资	-	0.00
6	金融衍生品投资	-	0.00
6.1	买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	222,241,790.60	22.05
8	其他资产	153,149.44	0.02
9	合计	1,007,832,621.72	100.00

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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	539,069,344.67	52.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,240,689.77	2.21
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	31,321,077.12	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	149,591,091.13	14.57
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.06	0.00
J	金融业	1,960.72	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	49,216,415.69	4.85
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		785,440,701.68	77.03

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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	002662	顺丰控股	2,273,272	103,336,167.68	10.27
2	000013	顺络电子	1,317,980	84,211,527.00	8.32
3	002126	银禧股份	8,708,027	89,709,700.40	8.86
4	601689	拓普集团	5,229,277	71,569,744.68	7.11
5	002976	新宙邦	5,096,173	59,439,152.77	5.91
6	002888	好莱客	1,833,776	51,493,261.20	5.12
7	000035	中信证券	7,727,272	49,184,052.49	4.89
8	600897	伊力股份	1,497,549	47,240,492.31	4.70
9	601000	鹏润	9,615,385	43,173,076.43	4.29
10	002021	中电广通	2,765,398	38,046,811.44	3.84

5.4 报告期末按债券品种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
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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	107,066.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,594.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,149.44

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	241,817.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,767.19
5	应收申购款	886.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,549.66

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	237,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	227,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	227,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	227,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	227,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	227,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	227,346.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,763.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,110.06

5.14 报告期末按资产组合分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细
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贵金属投资明细
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.12 本基金投资的前十名股票