大成优选股票型证券投资基金（LOF）

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2013年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成优选股票（LOF）
交易代码	160916
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2012年7月27日
报告期末基金份额总额	2,082,167,085.02份
投资目标	在有效控制风险的基础上，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将在全球视野下，基于宏观经济研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，主要采用优选个股的主动投资策略，获取超额收益。优选个股是指积极、深入、全面地了解上市公司基本面，动态评估公司价值，当股价低于合理价值区域时，买入并持有；在股价回复到合理价值的过程中，分享股价提升带来的超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险收益特征的开放式基金。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“优选LOF”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年1月1日－2013年3月31日）
1.本期已实现收益	32,234,879.35
2.本期利润	89,978,365.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0420
4.期末基金资产净值	2,346,504,264.92
5.期末基金份额净值	1.127

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

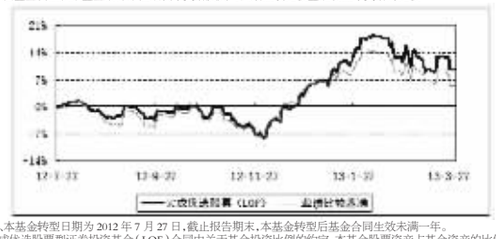
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.58%	1.45%	-0.51%	1.24%	4.09%	0.21%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.本基金转型日期为2012年7月27日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2.大成优选股票型证券投资基金（LOF）合同中关于基金投资比例的约定：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%；现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的建仓期为6个月，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明先生	本基金基金经理、助理总经理	2012年7月27日	-	20年	硕士。曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理、厦门产权交易中心副总经理及香港时富金融服务集团投资经理，2004年3月加盟大成基金管理有限公司，2004年10月22日-2008年1月12日曾任景宏证券投资基金基金经理，2007年8月1日至2012年7月26日担任大成优选股票型证券投资基金基金经理，2012年7月27日起任大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金，现同时任大成基金管理有限公司助理总经理、股票投资决策委员会主席。具有基金从业资格。国籍：中国
汤义峰先生	本基金基金经理、数量投资部总监	2012年11月26日	-	7年	中国科学院管理学博士。曾就职于博时基金管理有限公司，历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票型证券投资基金及裕泽证券投资基金的基金经理助理。2010年3月12日至2012年6月11日曾任博时裕富沪深300指数证券投资基金基金经理及博时特许价值股票型证券投资基金基金经理。2012年11月26日起任大成优选股票型证券投资基金基金经理，2013年3月8日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理，现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

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。2013年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量5%；投资组合间不存在债券同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结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间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年一季度，银行间流动性维持宽松，表内、表外融资保持较快增长，但经济复苏的力度低于预期，1-2月工业增加值同比仅增长9.9%，3月电网口径发电量也显示经济增长较为疲软。另一方面，在食品价格的带动下，2月份CPI同比快速反弹至3.2%。房地产市场量价齐升，通胀压力显现。3月份国五条、银监会8号文陆续出台，边际上逆转市场的政策预期，市场风险偏好下降。

2013年第一季度，A股市场再度出现了转型期的特征，代表大盘蓝筹的沪深300指数收益为负，而中小板指数和创业板指数涨势喜人，尤其是创业板指，涨幅超过了20%，A股市场不同行业，不同规模之间的股票估值差异达到了历史新高。市场明显陷入割裂的状态，一部分股票被认定为终将灭迹的“恐龙”，当期不错，认定下期肯定不行；一部分股票被认定为朝阳，当前不行，投资者又寄望于下一期成长空间更大。

大成优选第一季度重点持有了 银行、家电、保险等估值较低、盈利能力强的重点个股，组合净值较好的战胜了业绩比较基准，相对于同业，表现一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为1.127元。本报告期基金份额净值增长率为3.58%，同期业绩比较基准收益率为-0.51%，高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度，大成优选将继续着力于在估值合理的标的中寻找盈利能力强的标的，我们认为，这种类型的标的具有更好的风险抵御能力，而且也能分享市场的上涨。

§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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,867,865,008.98	79.06
	其中：股票	1,867,865,008.98	79.06
2	固定收益投资	19,220,243.20	0.81
	其中：债券	19,220,243.20	0.81
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	467,568,146.34	19.79
6	其他资产	8,010,401.81	0.34
7	合计	2,362,663,800.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	24,298,813.44	1.04
C	制造业	910,892,825.72	38.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,310,000.00	0.14
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	5,830,000.00	0.25
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	3,607,000.00	0.15
J	金融业	747,031,842.34	31.84
K	房地产业	156,018,687.28	6.65
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	3,519,001.00	0.15
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	1,750,000.00	0.07
S	综合	11,606,839.20	0.49
	合计	1,867,865,008.98	79.60

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	600016	民生银行	18,000,000	173,520,000.00	7.39
2	601318	中国平安	4,000,000	167,080,000.00	7.12
3	000002	万 科A	14,499,878	156,018,687.28	6.65
4	000651	格力电器	5,000,000	142,850,000.00	6.09
5	601166	兴业银行	7,499,975	129,749,567.50	5.53
6	600000	浦发银行	12,574,918	127,383,919.34	5.43
7	600690	青岛海尔	9,999,937	127,299,198.01	5.43
8	600036	招商银行	10,000,000	126,300,000.00	5.38
9	600518	康美药业	7,000,000	122,780,000.00	5.23
10	600066	宇通客车	4,000,000	114,440,000.00	4.88

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	19,220,243.20	0.82
8	其他	-	0.00
9	合计	19,220,243.20	0.82

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	181,460	19,220,243.20	0.82

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

单位：元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					0.00
股指期货投资本期收益					3,902,100.00
股指期货投资本期公允价值变动					0.00

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。报告期内，本基金股指期货交易的交易次数、交易金额及投资损益均未对基金总体风险产生重大影响，股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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、处罚的情行。

5.9.2 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股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	848,129.17
2	应收证券清算款	7,068,742.50
3	应收股利	-
4	应收利息	84,431.49
5	应收申购款	9,098.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,010,401.81

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情形。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2,277,127,966.38
本报告期基金总申购份额	156,878,961.51
减：本报告期基金总赎回份额	351,839,842.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,082,167,085.02

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人设立专门的业绩风险准备金，每月从已提取的基金管理费中计提10%作为业绩风险准备金，用于在净值增长率低于业绩比较基准增长率超过5%时弥补持有人损失。本期期初业绩风险准备金人民币1,631,304.58元，本期划入人民币762,238.16元，期末业绩风险准备金账户结余人民币2,393,542.74元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成优选股票型证券投资基金（LOF）的文件；

2、《大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《大成优选股票型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

8.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2013年4月22日

景福证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2013年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景福封闭
交易代码	184701
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年12月30日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
投资目标	通过指数化投资和积极投资的有机结合，实现投资风险和收益的优化平衡，力求使基金取得超过市场的投资收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的指数投资部分采用分层抽样法，选择代表上证A股市场整体特征的股票构建投资组合；积极投资部分则投资于高成长行业或价值低估行业的股票。整体投资力求超越基准指数表现。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“基金景福”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年1月1日－2013年3月31日）
1.本期已实现收益	-25,648,321.10
2.本期利润	73,155,614.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0244
4.期末基金资产净值	2,880,805,374.40
5.期末基金份额净值	0.9603

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

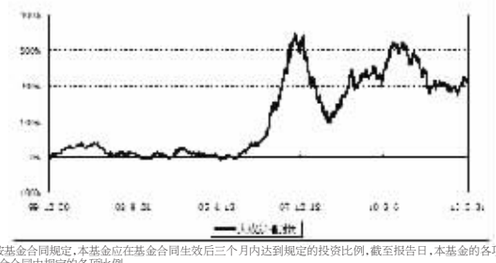
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.61%	2.37%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率走势图



注：按基金合同规定，本基金应在基金合同生效后三个月内达到规定的投资比例，截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨丹先生	本基金基金经理	2008年8月23日	-	12年	理学硕士。2001年加入大成基金管理有限公司，先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部、股票投资部。2006年5月27日至2011年6月14日曾任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2008年8月23日开始担任景福证券投资基金基金经理。2011年6月14日开始兼任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《景福证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金景福的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

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。2013年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量5%；投资组合间不存在债券同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结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间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度中小盘和大盘指数出现明显分化，沪深300下跌1.10%，而中小板指数上涨8.92%，创业板指数上涨21.38%。与此同时，主题投资板块表现较为活跃。

2012年四季度中国经济出现明显复苏，市场普遍预计2013年上半年将延续弱复苏的势头。从跟踪的月度工业增加值数据看，经济确在缓慢回升。但2月份CPI指数超预期达到3.2%，由于非食品项中的服务项上升较为明显，使得市场对货币政策提前收紧的预期增强。从微观情况看，水泥、工程机械、钢铁等与投资相关的行业需求复苏幅度低于往年的旺季水平。由于经济前景不明朗，政策风险逐步积聚，市场总体表现得相当纠结，板块表现分化严重，医药、军工、大众食品、电子元器件、通信表现很好，但传统的煤炭、有色、建材、机械、白酒则表现很差。一季度政策层面利空消息偏多，一是央行表明货币政策重心仍然是抗通胀，二是国务院房地产调控的政策加码，三是银监会“8号文”对理财产品的监管升级。海外市场美国表现一枝独秀，由于其经济复苏超预期，道琼斯指数达创新高。而欧洲债务危机的风险仍未解除，不断有小国爆出新的危机，整体经济也表现疲弱。

本基金在一季度降低了白酒、非银行金融、房地产的配置比例，增加了电子元器件、通信、大众食品和银行的配置权重。权益类资产仓位有小幅下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.9603元，本报告期基金份额净值增长率为2.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年的经济是一个不断寻求平衡点的过程。由于潜在经济增速下滑，2012年下半年以来的经济运行出现一种现象，就是一旦放松货币，经济增速起来但通胀也随之而来，而一旦压货币，经济增速又开始下行。中国经济开始去杠杆，经济增速将告别过去20年快速增长的阶段。

我们对中国长期经济增长前景仍然充满信心，但是在产能出清的过程中，传统行业会经历一个相对痛苦的过程。一些新兴的行业，如环保、医药等行业将得到政策扶持，消费电子、通信将受益于居民收入提高和产业升级浪潮，水电气运将在资源价格市场化的趋势中提升盈利能力，因此，未来我们将集中精力在上述行业中寻找投资机会。

§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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,065,781,720.24	71.52
	其中：股票	2,065,781,720.24	71.52
2	固定收益投资	602,019,880.60	20.84
	其中：债券	602,019,880.60	20.84
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	209,407,991.67	7.25
6	其他资产	11,248,254.94	0.39
7	合计	2,888,457,847.45	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	490,020,798.54	17.01
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	63,539,936.46	2.21
J	金融业	393,241,314.41	13.65
K	房地产业	56,466,165.61	1.96
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	1,003,268,215.02	34.83

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	859,582,661.67	29.84
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	101,276,191.76	3.52
J	金融业	45,750,000.00	1.59
K	房地产业	13,139,651.79	0.46
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	42,765,000.00	1.48
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	1,062,513,505.22	36.88

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

5.3.1 报告期末按积极投资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	600518	康美药业	12,437,411	218,152,188.94	7.57
2	000063	中兴通讯	11,527,108	129,103,609.60	4.48
3	601318	中国平安	2,390,091	99,834,101.07	3.47
4	600519	贵州茅台	500,000	84,430,000.00	2.93
5	601601	中国太保	3,934,700	71,965,663.00	2.50
6	600050	中国联通	17,999,982	63,539,936.46	2.21
7	600016	民生银行	5,999,958	57,839,595.12	2.01
8	601166	兴业银行	3,199,912	55,358,477.60	1.92
9	601628	中国人寿	3,140,276	53,855,733.40	1.87
10	000568	泸州老窖	2,000,000	51,000,000.00	1.77

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002106	莱宝高科	8,888,164	220,959,757.04	7.67
2	000527	美的电器	11,737,597	119,840,865.37	4.16
3	002230	科大讯飞	2,807,768	101,276,191.76	3.52
4	002570	贝因美	1,899,812	74,130,664.24	2.57
5	000100	TCL集团	25,769,644	67,516,467.28	2.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	107,107,312.60	3.72
2	央行票据	120,063,000.00	4.17
3	金融债券	371,100,000.00	12.88
	其中：政策性金融债	371,100,000.00	12.88
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	3,749,568.00	0.13
8	其他	-	0.00
9	合计	602,019,880.60	20.90

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21国债(7)	763,810	80,154,221.40	2.78
2	090209	09国开09	800,000	79,960,000.00	2.78
3	080215	08国开15	600,000	60,384,000.00	2.10
4	110302	11进出02	500,000	50,255,000.00	1.74
5	080210	08国开10	500,000	50,220,000.00	1.74

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

5.8.2 本基金的指数投资前十名股票与积极投资前五名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	711,608.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,536,645.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,248,254.94

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000527	美的电器	119,840,865.37	4.16	重大事项停牌

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	7,500,000.00
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	7,500,000.00
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	0.25

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立景福证券投资基金的文件；

2、《景福证券投资基金基金合同》；

3、《景福证券投资基金托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

8.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.