景宏证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月23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10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成景宏封闭
交易代码	184691
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年5月4日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
投资目标	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金分别在资产配置、行业配置、个股选择三个层次上采取积极主动的策略进行投资。根据宏观经济状况和市场未来趋势进行资产配置;依据对行业景气的判断进行行业权重配置;在个股方面,选择治理结构完善、管理有方、信息透明、行业竞争力强、财务状况良好而且其内在价值被市场低估的上市公司进行投资。
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"基金景宏"。

§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7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	20,504,869.51
2.本期利润	170,757,271.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0854
4.期末基金资产净值	1,920,101,355.09
5.期末基金份额净值	0.9601

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	9.76%	1.64%	-	-	-	-

3.2.2 目基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月向为建仓期。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		
刘安田先生	本基金基金经理	2013年3月8日	-	9年	金融学硕士。曾任职于中国证券研究设计中心、友邦华泰基金管理公司、工银瑞信基金管理公司。曾担任行业研究员、宏观经济及策略研究员、基金经理助理。2008年8月加入大成基金,曾任大成基金管理有限公司研究部总监助理。2012年3月20日至2013年7月17日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。2010年4月7日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2013年3月8日起任景宏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》、《景宏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,基金景宏的投资范围、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3季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在1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,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超过该股当日成交量5%的仅有1笔,原因为投资策略需要;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,但结合交易价差分布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

三季度美国经济整体上仍然处于复苏的通道中,但出现一些不利因素,8月份零售增长和新增非农就业人数均低于预期,同时消费者信心指数环比回落;8月份个人消费支出(PEC)价格指数同比增长1.2%,低于美联储2%的通胀目标。市场原本预期三季度末QE将退出,但9月份的FOMC会议却超预期的继续维持量化宽松政策,也反映出美联储对经济复苏能否保持强劲势头的担忧。道琼斯指数三季度涨幅上涨2.34%,纳斯达克指数上涨11.12%。

欧元区的经济增长在今年二季度结束了连续6个季度的下滑,出现环比回升。三季度欧元区综合PMI连续3个月持续回升,其中德国和法国9月综合PMI初值分别创8个月和19个月的新高,居民消费回升是欧洲经济企稳复苏的主要推动力。但政府支出受制于债务压力将持续紧缩,金融机构的信贷投放仍在下降,失业率也暂未出现明显好转。欧洲经济在四季度能否保持复苏势头仍存在较大的不确定性。德国DAX指数三季度上涨8.82%,法国CAC40指数三季度上涨11.98%。

中国经济在二季度大幅下滑之后,三季度出现明显反弹,预计三季度GDP环比增速在8%以上。经济反弹主要动力来自于基建投资和出口,消费和房地产投资较为平稳。"调结构、促转型、深化改革"是新一届政府的首要任务,中央政府力排众议推行上海自贸区试点。在此背景下三季度上证综指上涨9.88%,创业板指数上涨35.21%,而自贸区概念指数上涨131%。

本基金在年初以来净值上涨6.68%,跑赢沪深300指数11.2个百分点,超额收益主要来自我们在食品、环保、TMT等行业的个股选择。本基金在整个三季度基本保持中性仓位,我们在此期间减持了上半年超额收益较多传媒和医药,增持了金融和电子。虽然三季度我们跑赢基准,但由于在三季度涨幅较大的传媒、商贸零售、计算机板块配置较少,导致超额收益幅度有限。

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0.9601元,本报告期基金份额净值增长率为9.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来资本市场对于宏观层面上"调结构、促转型、深化改革"的大趋势反应得淋漓尽致,在宏观经济较为平淡的背景下,年初以来中小板指数上涨23.5%,创业板指数上涨85%。今年前三季度A股有几条主要的投资主线:一是消费升级,包括文娱、电子产品、信息消费、医疗健康等;二是改革深化,包括反腐力度加强、鼓励金融创新、推行上海自贸区试点、加快国企改革、设立民营银行;三是强调经济增长质量,主要体现在环保的相关政策逐渐落地;四是传统行业的企业开始寻求转型;例如零售企业开始从线下走向移动终端,传统商业银行和互联网企业合作等。中国经济潜在增速中枢下移已经成为市场共识,宏观经济出现快速下滑是主要的系统性风险。我们预计四季度宏观经济增长要弱于三季度,但投资、消费和出口大幅向下的概率较低。展望四季度,A股有望延续前三季度的几条主要投资逻辑。

现阶段部分新兴产业的公司估值水平过高,需要较长时间来消化市场过于乐观的预期,在四季度我们会适度降低此类股票的持仓。但总体上我们的核心配置仍然集中在医药、信息服务和信息设备、电子元器件以及制造业中的部分细分子行业上,选择有核心竞争力、管理层优异、企业战略符合行业长期趋势的优质公司。

§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	1,490,443,310.92	77.20
	其中:股票	1,490,443,310.92	77.20
2	固定收益投资	396,868,326.50	20.56
	其中:债券	396,868,326.50	20.56
	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	22,872,659.58	1.18
6	其他资产	20,399,120.04	1.06
7	合计	1,930,583,417.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	36,351,106.56	1.89
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	878,144,088.96	45.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	37,480,814.60	1.95
F	批发和零售业	13,659,568.10	0.71
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	84,339,205.17	4.39
J	金融业	207,849,132.32	10.82
K	房地产业	111,152,593.46	5.79
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	18,592,252.29	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	52,312,500.00	2.72
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	50,562,049.46	2.63
S	综合	-	0.00
	合计	1,490,443,310.92	77.62

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	002570	贝因美	1,874,890	77,995,424.00	4.06
2	002415	海康威视	2,899,428	76,544,899.20	3.99
3	600837	海通证券	5,999,958	75,059,474.58	3.91
4	300124	汇川技术	1,076,840	53,702,010.80	2.80
5	000002	万 科A	5,800,000	52,954,000.00	2.76
6	000826	桑德环境	1,550,000	52,312,500.00	2.72
7	600690	青岛海尔	3,799,850	50,614,002.00	2.64
8	300133	华策影视	1,248,754	50,562,049.46	2.63
9	300273	和佳股份	1,949,902	46,758,649.96	2.44
10	000625	长安汽车	4,499,915	46,349,124.50	2.41

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	18,814,326.50	0.98
2	央行票据	20,016,000.00	1.04
3	金融债券	358,038,000.00	18.65
	其中:政策性金融债	358,038,000.00	18.65
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	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	396,868,326.50	20.67

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	130227	13国开27	900,000	89,595,000.00	4.67
2	090209	09国开09	700,000	69,398,000.00	3.61
3	130214	13国开14	600,000	59,808,000.00	3.11
4	130218	13国开18	500,000	49,665,000.00	2.59
5	110317	11进出17	400,000	39,800,000.00	2.07

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
本基金本报告期末投资股指期货。
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末投资股指期货。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资国债期货。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末投资国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 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。
5.10.2 本基金的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	468,341.17
2	应收证券清算款	14,630,818.12
3	应收股利	-
4	应收利息	5,299,960.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,399,120.04

5.10.4 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。
5.10.5 报告期末前十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	600690	青岛海尔	50,614,002.00	2.64	重大事项停牌,已于2013年10月8日复牌。

5.10.6 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	12,000,000.00
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	12,000,000.00
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.60

§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宏证券投资基金的文件;
2、《景宏证券投资基金基金合同》;
3、《景宏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10月23日

景福证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月23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10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7月1日起至9月30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7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	38,240,761.95
2.本期利润	218,975,253.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0730
4.期末基金资产净值	3,092,822,254.96
5.期末基金份额净值	1.0309

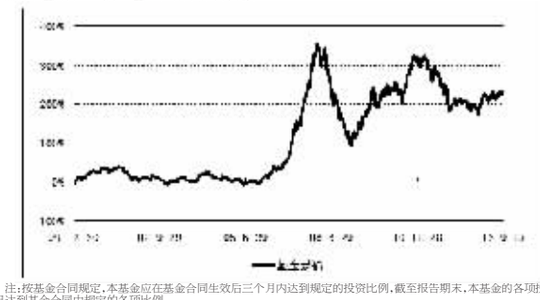
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.62%	1.60%	-	-	-	-

3.2.2 目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,截至报告期末,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。2011年6月14日至2013年7月17日任大成均衡增长股票型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。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,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3季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在1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,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超过该股当日成交量5%的仅有1笔,原因为投资策略需要;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,但结合交易价差分布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

三季度沪深300指数上涨9.47%,在银行等大盘股保持相对稳定的背景下,一些热点行业和板块轮番上涨。但从结构上看,板块涨幅分化依然明显。

三季度经济数据较上半年有所好转。7、8月份工业增加值出现大幅回升,PMI指数表明经济处于持续扩张阶段,9月份数据表现仍较为平稳。三季度流动性略微偏紧,但也没有出现二季度本市场预期的流动性特别紧张的情况。总体政策基调保持稳定,调整经济结构,提升增长效率仍是主要论调。海外市场无大的事件发生,美国经济复苏态势仍良好,只是QE退出的预期在一定程度上影响了股票市场走势。

A股市场结构分化的格局依旧延续。新的技术及应用快速渗透到各行各业,比如,移动互联网的兴起推动OTO市场快速发展,4G投资开始启动,斯诺登事件倒逼信息技术领域国产化,互联网金融的快速发展等等。三季度传媒、商贸零售、计算机、餐饮旅游、通信等行业涨幅超过30%,而石油石化、建筑、白酒、电力、煤炭等传统行业涨幅低于10%。

本基金在三季度增持了商贸零售、电子元器件、农林牧渔等行业,减持了家电、白酒等行业,仓位保持相对平稳,变化不大。

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1.0309元,本报告期基金份额净值增长率为7.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,四季度宏观经济总体仍保持相对平稳的态势,货币政策保持中性,因此A股市场很难出现趋势性投资机会,但结构性的投资机会仍层出不穷。

对大的投资方向我们维持之前的看法,资源要素价格改革、大众消费以及新技术推动的行业将是未来中长期坚持的投资方向。四季度我们会更加关注个股业绩情况,对于涨幅过高且业绩不达预期的个股会保持警惕,而对于一些业绩超预期的个股会加强研究,如有必要会及时加入组合。

§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	2,421,493,417.54	77.58
	其中:股票	2,421,493,417.54	77.58
2	固定收益投资	638,897,353.00	20.47
	其中:债券	638,897,353.00	20.47
	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	35,455,947.35	1.14
6	其他资产	25,510,891.99	0.82
7	合计	3,121,357,609.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 按报告期末按照各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	772,386,014.05	24.97
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	114,483,295.52	3.70
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	65,600,000.00	2.12
J	金融业	222,543,541.16	7.20
K	房地产业	33,711,066.90	1.09
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	1,208,723,917.63	39.08

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	44,991,626.98	1.45
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	725,774,880.34	23.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	199,758,201.41	6.46
F	批发和零售业	142,096,458.18	4.59
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	57,144,000.00	1.85
J	金融业	31,045,230.00	1.00
K	房地产业	11,959,103.00	0.39
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	1,212,769,499.91	39.21

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	000063	中兴通讯	13,927,108	231,189,992.80	7.48
2	600887	伊利股份	4,959,390	221,585,545.20	7.16
3	600518	康美药业	10,830,885	202,862,476.05	6.56
4	000333	美的集团	2,700,000	116,748,000.00	3.77
5	600859	王府井	5,364,728	114,483,295.52	3.70
6	600016	民生银行	9,999,958	95,599,598.48	3.09
7	000001	平安银行	6,999,911	83,158,942.68	2.69
8	600050	中国联通	20,000,000	65,600,000.00	2.12
9	600837	海通证券	3,500,000	43,785,000.00	1.42
10	600383	金地集团	5,599,845	33,711,066.90	1.09

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	002570	贝因美	3,200,000	133,120,000.00	4.30
2	002106	莱宝高科	8,939,964	129,987,076.56	4.20
3	600073	上海梅林	9,880,685	106,118,556.90	3.43
4	002081	金螳螂	4,560,271	99,961,140.32	3.23
5	002230	科大讯飞	1,200,000	57,144,000.00	1.85

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	78,189,679.00	2.53
2	央行票据	10,018,000.00	0.32
3	金融债券	546,944,000.00	17.68
	其中:政策性金融债	546,944,000.00	17.68
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	3,745,674.00	0.12
8	其他	-	0.00
9	合计	638,897,353.00	20.66

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	130201	13国开01	1,300,000	129,675,000.00	4.19
2	090209	09国开09	800,000	79,312,000.00	2.56
3	010107	21国债(7)	653,810	67,407,811.00	2.18
4	130236	13国开36	600,000	59,922,000.00	1.94
5	130227	13国开27	600,000	59,730,000.00	1.93

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
本基金本报告期末投资股指期货。
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末投资股指期货。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资国债期货。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末投资国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	765,953.84
2	应收证券清算款	15,985,175.45
3	应收股利	-
4	应收利息	8,759,762.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,510,891.99

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	3,745,674.00	0.12

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.10.5.1 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。
5.10.5.2 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
本基金本报告期末积极投资前五名股票中无流通受限情况。
5.10.6 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