大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

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:2018年10月25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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成产业升级股票(LOF)
场内简称	大成产业
基金主代码	160919
交易代码	160919
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2014年12月26日
报告期末基金份额总额	174,324,371.61份
投资目标	本基金重点投资于与产业升级主题相关的行业和企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
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	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。
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

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-22,885,828.43
2.本期利润	-18,801,122.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1066
4.期末基金资产净值	180,315,067.94
5.期末基金份额净值	1.034

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。

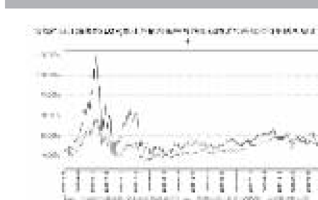
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-9.38%	1.29%	-1.29%	1.09%	-8.09%	0.20%

3.2.2 自基金合同生效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:按基金合同规定,基金管理人应当自基金转型之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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		
李林益	本基金基金经理	2015年7月7日	-	7年	工学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究部研究员、基金经理助理。2015年7月7日起任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年9月12日起任大成价值增长证券投资基金基金经理。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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

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。2018年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要;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 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度,面对国内外出现的新变化、新情况,市场内投资者们在试图探寻宏观、产业和公司未来的演变轨迹。

本基金医药板块配置比重较高,以疫苗事件为催化,医药行业指数自高点回撤30.89%。在高beta的市场环境下,能找到具有超额收益的品种需要勤奋和细致的洞察力。本基金以维护基金份额持有人利益为原则,争取在未来的管理中取得和基金风格相一致的收益。

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1.034元;本报告期基金份额净值增长率为-9.38%,业绩比较基准收益率为-1.29%。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	151,219,003.69	82.80
	其中:股票	151,219,003.69	82.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,459,000.00	5.73
	其中:债券	10,459,000.00	5.73
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,122,701.41	11.02
8	其他资产	827,636.22	0.45
9	合计	182,628,341.32	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	-	-
B	采矿业	28,054,603.75	15.56
C	制造业	85,058,894.07	47.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,074,653.52	3.92
F	批发和零售业	52,160.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,334,280.73	2.96
J	金融业	6,760,712.00	3.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,008,312.60	2.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,572,300.00	4.20
R	文化、体育和娱乐业	6,303,087.02	3.50
S	综合	-	-
	合计	151,219,003.69	83.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	600339	中油工程	2,496,400	14,079,696.00	7.81
2	300122	智飞生物	270,705	13,253,716.80	7.35
3	601857	中国石油	1,240,600	11,376,302.00	6.31
4	603517	绝味食品	266,799	11,178,878.10	6.20
5	002179	中航光电	184,200	8,104,800.00	4.49
6	300015	爱尔眼科	234,800	7,572,300.00	4.20
7	600332	白云山	204,300	7,477,380.00	4.15
8	300487	蓝晓科技	245,400	7,084,698.00	3.93
9	600477	杭萧钢构	1,534,632	7,074,653.52	3.92
10	600346	恒力股份	440,300	7,062,412.00	3.92

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,459,000.00	5.80
	其中:政策性金融债	10,459,000.00	5.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,459,000.00	5.80

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

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	180205	18国开05	100,000	10,459,000.00	5.80

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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本期是否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。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	241,474.86
2	应收证券清算款	269,040.06
3	应收股利	-
4	应收利息	316,921.69
5	应收申购款	199.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	827,636.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	178,696,303.70
报告期期间基金总申购份额	1,268,856.60
减:报告期期间基金总赎回份额	5,640,788.69
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	174,324,371.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)的文件;
2、《大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金合同》;
3、《大成产业升级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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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
2018年10月25日

大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月25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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成动态量化配置混合
基金主代码	003147
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月20日
报告期末基金份额总额	102,786,681.55份
投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资,并通过数学建模的方式根据宏观经济数据以及风险预警指标动态调整资产配置的比例,在有效控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。
投资策略	本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析,确定当前市场环境下的主要投资方向和资产配置比例。同时,量化模型通过持续跟踪宏观经济数据、风险预警指标等,判断不同资产类别在当前市场环境下的风险收益状态,根据市场环境变化时,动态调整投资组合结构,各类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于货币市场基金与债券型基金,属于风险水平中高的基金。
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

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,455,871.18
2.本期利润	-593,044.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0057
4.期末基金资产净值	87,294,276.92
5.期末基金份额净值	0.8493

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	-0.64%	1.31%	-0.15%	0.67%	-0.49%	0.64%

3.2.2 自基金合同生效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:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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		
黎新平	本基金基金经理,数量与指数投资部总监	2016年9月20日	-	10年	经济学博士。2008年7月至2015年6月历任Aristeia capital量化投资部资深策略师、投资经理。2015年7月加入大成基金管理有限公司。2016年9月20日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2017年3月18日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部总监。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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

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。2018年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要;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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度,中美贸易摩擦进一步升级,叠加境内融资环境收紧经济下行的担忧,市场总体表现低迷,股指再创新低,成交大幅萎缩。但个股表现上分化加大,在此期间,上证50上涨5.11%,沪深300下跌2.05%,上证综指下跌0.92%,中证500下跌7.99%,创业板指下跌12.16%。显然,在市场不确定性急剧上升的状态下,大市值、低估值股票成为市场避险行为的选择。

从行业看,三季度表现最好的行业是非银金融,石油石化,银行等低估值大盘权重股;而在中美贸易摩擦加剧环境下,家电、纺织服装、电子元器件等受贸易影响较大板块则大幅回调。从因子表现上看,高估值、成长、反转、次新等因子在三季度继续大幅下滑,反映市场风险偏好的进一步收紧;在避险情绪下,低估值、大市值、高质量等稳健性因子在下跌市场中相对表现良好。

大成动态量化在三季度保持以估值、盈利、质量等基本面因子作为主要的选股因子,在不确定性不断增大的市场环境中,布局低估值、高股息及稳定盈利的中大盘股票,并注意控制高估值、小市值等风险因子的暴露。

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0.8493元;本报告期基金份额净值增长率为-0.64%,业绩比较基准收益率为-0.15%。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	73,468,158.18	83.71
	其中:股票	73,468,158.18	83.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,838,525.19	15.77
8	其他资产	457,059.92	0.52
9	合计	87,763,743.29	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	464,400.00	0.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,844,923.88	43.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	990,336.00	1.13
F	批发和零售业	563,537.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,754,011.50	2.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,238,520.00	2.56
J	金融业	20,436,838.00	23.41
K	房地产业	9,120,110.80	10.45
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	55,481.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	73,468,158.18	84.16

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	000001	平安银行	423,200	4,676,360.00	5.36
2	000932	华菱钢铁	349,946	2,936,046.94	3.36
3	601318	中国平安	41,300	2,829,050.00	3.24
4	600048	保利地产	228,200	2,777,194.00	3.18
5	601988	中国银行	742,000	2,760,240.00	3.16
6	600036	招商银行	87,300	2,679,237.00	3.07
7	600887	伊利股份	101,400	2,603,952.00	2.98
8	000002	万科A	105,700	2,568,510.00	2.94
9	601238	广汽集团	227,040	2,508,792.00	2.87
10	601939	建设银行	346,000	2,505,040.00	2.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1811	IC1811	2	1,910,160.00	-120.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-120.00
股指期货投资本期收益(元)					-
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-120.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货流动性、套保有效等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上力求实现长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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本期是否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。

本基金投资的前十名证券之一平安银行(000001)的发行主体平安银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字〔2018〕2号)。本基金认为,对平安银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字〔2018〕1号)。本基金认为,对招商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	452,213.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,985.91
5	应收申购款	1,860.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	457,059.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	104,179,282.89
报告期期间基金总申购份额	364,701.11
减:报告期期间基金总赎回份额	1,757,302.45
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	102,786,681.55

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成动态量化配置策略混合型证券投资基金的文件;
2、《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》;
3、《大成动态量化配置策略混合型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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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
2018年10月25日

大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

(原大成定增灵活配置混合型证券投资基金转型)

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:2018年10月25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2018年10月24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。

基金管理人于2018年8月16日发布了《关于大成定增灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金(LOF)及基金名称变更的公告》,自2018年8月18日起,大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)",场外基金简称变更为"大成多策略混合(LOF)",场内基金简称变更为"多策略",基金代码不变,基金代码为"160921"。

大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等条款,相应适用于基金合同中本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的有关约定,详见基金合同。

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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	大成多策略混合(LOF)
场内简称	多策略
基金主代码	160921
交易代码	160921
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月18日
报告期末基金份额总额	848,422,069.01份
投资目标	基金管理人在控制风险和保持资产流动性的基础上,主要采用多策略投资于股票,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究,结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于货币市场基金与债券型基金,属于风险水平中高的基金。
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

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	大成定增灵活配置混合
场内简称	大成定增
基金主代码	160921
交易代码	160921
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月19日
报告期末基金份额总额	1,005,709,840.88份
投资目标	在封闭期内,本基金主要参与上市公司股票定向增发,基金管理人在控制风险的前提下,追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究,结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于货币市场基金与债券型基金,属于风险水平中高的基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年8月18日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-18,743,544.97
2.本期利润	-1,457,074.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0017
4.期末基金资产净值	699,778,501.74
5.期末基金份额净值	0.825

注:1、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。

2、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。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年8月17日)
1.本期已实现收益	-105,244,068.26
2.本期利润	-81,139,496.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0807
4.期末基金资产净值	831,088,669.64
5.期末基金份额净值	0.826

注:1、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。

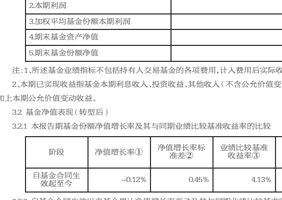
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现(转型后)

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
自基金合同生效起至今	-0.12%	0.45%	4.13%	0.72%	-4.25%	-0.27%

3.2.2 自基金合同生效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.本基金自2018年8月18日起,由大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)",截至报告期末本基金转型未满一年。

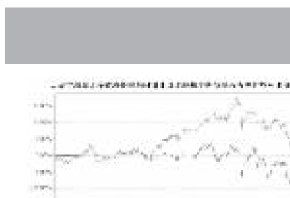
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2 基金净值表现(转型前)

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	-8.93%	0.79%	-4.46%	0.88%	-4.47%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效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:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至本基金转型前,本基金投资顺丰控股(002352)因定增股票估值方式变更,导致单个股票的投资比例被动超标。除此之外,报告期内本基金的其他各项投资比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型后)

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		
戴军	本基金基金经理,研究部副总监	2016年8月19日	-	7年	金融学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、行业研究主管、大成价值增长基金经理助理,2015年5月21日起任大成优选混合型证券投资基金(LOF)(更名前为大成优选股票型证券投资基金)基金经理。2016年8月19日起任大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理(更名前为大成定增灵活配置混合型证券投资基金)。2017年6月2日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任研究部副总监。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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

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		
戴军	本基金基金经理,研究部副总监	2016年8月19日	-	7年	金融学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、行业研究主管、大成价值增长基金经理助理,2015年5月21日起任大成优选混合型证券投资基金(LOF)(更名前为大成优选股票型证券投资基金)基金经理。2016年8月19日至2018年8月17日任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。。2017年6月2日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年8月18日任大成多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。现任研究部副总监。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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

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。2018年3季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要;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 报告期内基金投资策略和运作分析

经过2年的封闭期,大成定增在8月中旬转为开放式基金,同时变更名称为大成多策略。考虑到流动性的需求,本基金管理人按照契约规定逐步减持了定增到期的股票,同时尝试了大宗交易的方式来应对锁定期的延长。过去一个季度,市场在外部不确定性加强的情况下仍处于持续的调整中,本基金管理人降低了投资组合中股票的仓位,等待观察更有利于实现较好收益的窗口期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本基金转型前,本基金份额净值为0.826,基金份额净值增长率为-8.93%,业绩比较基准收益率为-4.46%;转型后至本报告期末,本基金份额净值为0.825元,基金份额净值增长率为-0.12%,业绩比较基准收益率为4.13%。

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(转型后)

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	232,575,055.83	32.77
	其中:股票	232,575,055.83	32.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	476,779,458.40	67.17
8	其他资产	433,997.34	0.06
9	合计	709,788,511.57	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	-	-
B	采矿业	10,053.44	0.00
C	制造业	111,261,422.47	15.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,946,237.74	0.99
E	建筑业	108,232.20	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	68,533,814.55	9.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,838.96	0.00
K	房地产业	29,292,640.86	4.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,420,815.61	2.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	232,575,055.83	33.24

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002352	顺丰控股	1,654,973	68,302,391.21	9.76
2	000513	丽珠集团	1,014,000	34,354,320.00	4.91
3	002146	荣盛发展	3,670,757	29,292,640.86	4.19
4	600535	天士力	1,152,620	26,371,945.60	3.77
5	601689	拓普集团	1,203,600	18,597,933.20	2.66
6	000035	中国天楹	3,863,715	16,420,815.61	2.35
7	603788	宁波高发	515,027	9,764,911.92	1.40
8	601138	工业富联	704,381	8,891,416.90	1.27
9	002705	新宝股份	1,038,287	7,589,877.97	1.08
10	001896	豫能控股	2,150,538	6,946,237.74	0.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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本期是否出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	271,522.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	86,007.64
5	应收申购款	76,467.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	433,997.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 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	2352	顺丰控股	46,047,190.37	6.58	非公开发行流通受限
2	601689	拓普集团	17,660,535.20	2.52	非公开发行流通受限
3	35	中国天楹	16,420,453.00	2.35	非公开发行流通受限
4	601138	工业富联	8,872,705.54	1.27	非公开发行流通受限
5	1896	豫能控股	6,946,237.74	0.99	非公开发行流通受限

5.11.6 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。

§5 投资组合报告(转型前)

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	251,349,342.63	30.20
	其中:股票	251,349,342.63	30.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	580,535,688.99	69.75
8	其他资产	435,540.88	0.05
9	合计	832,320,572.50	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	-	-
B	采矿业	8,937.96	0.00
C	制造业	138,887,374.05	16.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,924,732.36	0.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	90,960,412.93	10.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,656.08	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,566,229.25	1.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	251,349,342.63	30.24

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002352	顺丰控股	2,273,373	90,730,315.37	10.92
2	000513	丽珠集团	1,014,000	38,177,100.00	4.59
3	002126	银轮股份	4,554,737	31,653,101.29	3.81
4	603788	宁波高发	1,454,167	24,400,922.84	2.94
5	601689	拓普集团	1,203,600	19,408,322.04	2.34
6	000035	中国天楹	3,863,715	14,566,229.25	1.75
7	002705	新宝股份	1,341,787	11,700,382.64	1.41
8	601138	工业富联	704,381	9,123,941.47	1.10
9	001896	豫能控股	2,150,538	6,924,732.36	0.83
10	002250	联化科技	479,699	3,458,629.79	0.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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本期是否出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,348.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	394,192.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	435,540.88

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 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	002352	顺丰控股	90,730,315.37	10.92	非公开发行流通受限
2	000513	丽珠集团	38,177,100.00	4.59	非公开发行流通受限
3	002126	银轮股份	30,381,244.74	3.66	非公开发行流通受限
4	601689	拓普集团	18,428,883.16	2.22	非公开发行流通受限
5	000035	中国天楹	14,565,907.72	1.75	非公开发行流通受限
6	603788	宁波高发	11,778,744.60	1.42	非公开发行流通受限
7	601138	工业富联	9,104,717.65	1.10	非公开发行流通受限
8	001896	豫能控股	6,924,732.36	0.83	非公开发行流通受限
9	002250	联化科技	3,458,629.79	0.42	非公开发行流通受限

5.11.6 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(转型后)

单位:份

基金合同生效日(2018年8月18日)持有的基金份额	1,005,709,840.88
报告期期间基金总申购份额	600,097.31
减:报告期期间基金总赎回份额	157,887,869.18
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	848,422,069.01

§6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,005,709,840.88
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,005,709,840.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息(转型后)

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
	1	20180818-20180930	400,017,000.00	0.00	0.00	400,017,000.00	47.15
	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险,甚至有可能引起基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息(转型前)

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
	1	20180701-20180817	400,017,000.00	0.00	0.00	400,017,000.00	39.77
	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险,甚至有可能引起基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成定增灵活配置混合型证券投资基金的文件;
2、《大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《大成定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《关于大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)及基金名称变更的提示性公告》;
5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
6、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

10.3 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
2018年10月25日