

大成财富管理2020生命周期证券投资基金

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
重要提示:基金管理人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...

基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2018年7月1日-2018年9月30日), 单位:人民币元

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...

注:2.本基金业绩指标不包括持有买入返售金融资产的各项费用,计入费用后实际收益水平低于所列数字...

注:3.本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变动的比较



注:按基金合同约定,本基金各个时间段的资产配置比例如下:

Table with columns: 类别, 比例

注:1.本基金合同生效6个月内为建仓期,截至报告期末本基金各项投资比例已达成基金合同规定的各项比例...

基金管理人(或基金基金经理)简介

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

重要提示:基金管理人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...

基金管理人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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

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...

Table with columns: 姓名, 职务, 任免日期, 聘任日期, 证券从业资格, 说明

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 管理人对于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...

4.3 公平交易专项说明

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》...

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》...

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向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析...

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,受国内经济存在一定下行压力,以及中美贸易战的冲击,国内A股市场继续呈现波动态势...

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0.684元;本报告期基金份额净值增长率为-1.57%,业绩比较基准收益率为0.34%...

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 投资组合, 数量(只), 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 序号, 资产代码, 资产名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

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...

5.11.2 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

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12 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

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

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 管理人对于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...

4.3 公平交易专项说明

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》...

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》...

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向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析...

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

第三季度市场整体受到去杠杆和贸易战等不确定性因素影响偏弱,经过调整,一些优质公司估值逐步进入合理区域,但仍存在盈利预测下调的风险...

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0.934元;本报告期基金份额净值增长率为-6.13%,业绩比较基准收益率为-1.02%...

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 投资组合, 数量(只), 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 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(%)

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

Table with columns: 序号, 资产代码, 资产名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

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...

5.11.2 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

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12 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

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,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 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

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12 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

5.12.1 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

5.12.2 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.3 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

5.12.4 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

5.12.5 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.6 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

5.12.7 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

5.12.8 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.9 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

5.12.10 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

5.12.11 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.12 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

5.12.13 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

5.12.14 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.15 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

5.12.16 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

5.12.17 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.18 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

5.12.19 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

5.12.20 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.21 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

5.12.22 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

5.12.23 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.24 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

5.12.25 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

5.12.26 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.27 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

5.12.28 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

5.12.29 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.30 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

5.12.31 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

5.12.32 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.33 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

5.12.34 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

5.12.35 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.36 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

5.12.37 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

5.12.38 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.39 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

5.12.40 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

5.12.41 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.42 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

5.12.43 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

5.12.44 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.45 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

5.12.46 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

5.12.47 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.48 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

5.12.49 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

5.12.50 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.51 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

5.12.52 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

5.12.53 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.54 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

5.12.55 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

5.12.56 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.57 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

5.12.58 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

5.12.59 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.60 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

5.12.61 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

5.12.62 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.12.63 基金