

信息披露 Disclosure

大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

投资组合比例符合基金合同的约定。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。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure Start, Tenure End, and Remarks. Lists fund managers like 李博 and 李博.

注1:任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守诚信情况的说明

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,以诚信于市场,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《大成基金资产管理人公平交易制度》、《大成基金资产管理人公平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、业绩评估等投资管理活动各个环节,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,通过各部门的协作互控,保证了公平交易的可执行,可稽核和可支持。

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,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不存在报告期后反向交易,但不存在参与交易公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该交易日成交5%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易,原因为投资策略不同;投资组合间相向交易同日反向交易的市场成交比例、成交价格等交易结果数据表明该类交易不会对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同日反向交易,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 报告期内基金投资策略和运作分析
站在目前的时点看未来,整体经济仍存在不确定性,微观层面看很多行业都已经或多或少受到了经济波动的影响,本基金投资思路仍是选择相对比较确定的行业,持有有望受到超预期优秀的公司,以公司的卓越能力来抵御风险,主要配置行业为食品饮料、医药以及低估值的银行、地产等。

4.5 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金份额净值为0.9389元;本报告期基金份额净值增长率为-4.16%,业绩比较基准收益率为-0.87%。

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

Table with columns: No., Item, Amount (元), and Proportion of Assets (%). Lists portfolio items like 1 权益投资, 2 其中:股票, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: No., Industry, Amount (元), and Proportion of Assets (%). Lists industry investments like 1 农林、牧、渔, 2 采矿业, etc.

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: No., Stock Name, Quantity (股), Fair Value (元), and Proportion of Assets (%). Lists top 10 stocks like 1 贵州茅台, 2 五粮液, etc.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with columns: No., Bond Name, Quantity (张), Fair Value (元), and Proportion of Assets (%). Lists bond investments like 1 国债债券, 2 央行票据, etc.

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

Table with columns: No., Bond Name, Quantity (张), Fair Value (元), and Proportion of Assets (%). Lists top 10 bonds like 1 113011 光大转债, 2 120006 东财转债, etc.

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: No., Asset Name, Quantity (元), Fair Value (元), and Proportion of Assets (%). Lists asset-backed investments like 1 应收账款融资, 2 信贷资产支持证券, etc.

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: No., Precious Metal Name, Quantity (克), Fair Value (元), and Proportion of Assets (%). Lists precious metal investments like 1 国家债券, 2 央行票据, etc.

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: No., Warrant Name, Quantity (份), Fair Value (元), and Proportion of Assets (%). Lists warrant investments like 1 光大转债, 2 120006 东财转债, etc.

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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
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、处罚的情况。
无。

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。
无。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: No., Name, Amount (元), and Proportion of Assets (%). Lists other assets like 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

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,分账之和与合计可能有尾差。

5.6 开放式基金份额变动

Table with columns: Item,大成内需求增长混合A,大成内需求增长混合H. Lists share changes for periods like 报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额, etc.

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H

大成内需求增长混合A 大成内需求增长混合H