大成慧成货币市场基金

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:上海银行股份有限公司
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。

基金托管人上海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	大成慧成货币		
基金主代码	002200		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年2月3日		
报告期末基金份额总额	209,214,080.79份		
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。		
投资策略	1、利率趋势评估策略通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。2、类属配置策略本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。3、组合平均剩余期限配置策略本基金根据对未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期短期利率下降时,提高组合久期,以获得资本利得或锁定较高的利率水平。4、银行协议存款和大额存单投资策略银行协议存款和大额存单是本基金的主要投资对象。5、流动性管理策略在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注申购与赎回资金变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	上海银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成慧成货币A	大成慧成货币B	大成慧成货币E
下属分级基金的交易代码	002200	002201	002202
报告期末下属分级基金的份额总额	10,827,950.49份	196,642,254.80份	1,743,875.50份

§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		
	大成慧成货币A	大成慧成货币B	大成慧成货币E
1.本期已实现收益	45,773.61	1,949,076.83	15,924.87
2.本期利润	45,773.61	1,949,076.83	15,924.87
3.期末基金资产净值	10,827,950.49	196,642,254.80	1,743,875.50

注: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,由于本基金采用摊余成本核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成慧成货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5795%	0.0054%	0.0882%	0.0000%	0.4913%	0.0054%

大成慧成货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6404%	0.0054%	0.0882%	0.0000%	0.5522%	0.0054%

大成慧成货币E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5789%	0.0054%	0.0882%	0.0000%	0.4907%	0.0054%

注:本基金于2016年2月3日起增加E类份额,于2016年9月6日起E类份额有申购。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、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。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		
方孝成	本基金基金经理	2018年3月23日	–	12年	经济学硕士。2000年7月至2001年12月任新华社参编部编辑。2002年1月至2005年12月任J.D. Power (MacGraw Hill 集团成员) 市场研究部分析师。2006年1月至2009年1月任大公国际资信评估有限公司金融机构部副总经理。2009年2月至2011年1月任合众人寿保险股份有限公司风险管理部信用评级室主任。2011年2月至2015年9月任合众资产管理股份有限公司固定收益投资部投资经理。2015年9月至2017年7月任光大永明资产管理股份有限公司固定收益投资部执行总经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司。2017年11月8日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年1月23日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2018年3月23日起任大成慧成货币市场基金基金经理。2018年8月28日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍:中国
陈会荣	本基金基金经理	2017年3月22日	–	11年	经济学学士。2007年10月加入大成基金管理有限公司。历任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部基金经理。2016年8月6日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理,2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月22日起担任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。具备基金从业资格。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

三季度经济下行压力有所加大,基建投资进一步回落,带动固定资产投资累计同比增速从上半年的6.0%回落至8月份的5.5%,但房地产开发投资和制造业投资保持了较好的韧性,截止8月两者的累计同比增速分别为10.1%和7.5%。外贸方面,出口额(以美元计)同比增速8月回落至9.8%,后续随着中美贸易摩擦的负面影响逐步体现,出口增速可能进一步回落。新增社会融资延续下降趋势,但速度放缓,得益于新增信贷有所放量,而非标融资快速下滑的势头也有所收敛,截止8月社会融资规模存量同比增速下降至10.14%,较半年末低0.3个百分点。

主要受食品价格上行的影响,三季度CPI有所回升,8月CPI同比涨幅达到2.3%,处在近一年来的较高水平。受基数走高的影响,三季度PPI有所回落,8月份同比涨幅为4.1%。整体来看通胀压力有所上升,但仍处在温和区间。

7月初央行年内第三次下调存款准备金率,释放资金约7000亿元,使得三季度资金面进一步宽松。

市场表现方面,三季度银行间质押式回购隔夜加权平均利率约为2.35%,较二季度下降约38BP,7天质押式回购加权平均利率约为2.67%, 比二季度下降72BP。3个月、6个月和1年的AAA级金融债收益率收于2.85%、3.29%和3.55%,分别下行78BP、67BP和69BP。

三季度本基金以保障流动性为前提,并选择在收益率相对高点适度配置偏长期限的资产,增厚收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成慧成货币A基金份额净值收益率为0.5795%,本报告期大成慧成货币B基金份额净值收益率为0.6404%,本报告期大成慧成货币E基金份额净值收益率为0.5789%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

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	固定收益投资	70,020,180.46	33.40
	其中:债券	70,020,180.46	33.40
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	57,860,406.79	27.60
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	80,730,643.63	38.51
4	其他资产	1,033,123.63	0.49
5	合计	209,644,354.51	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.50	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	36
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	20

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	85.35	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	14.36	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	99.71	–

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	30,046,799.59	14.36
	其中:政策性金融债	30,046,799.59	14.36
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	20,000,526.61	9.56
6	中期票据	–	–
7	同业存单	19,972,854.26	9.55
8	其他	–	–
9	合计	70,020,180.46	33.47
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011801762	18中电投SCP027	200,000	20,000,526.61	9.56
2	160402	16农发02	200,000	19,976,698.91	9.55
3	111786794	17杭州银行CD210	200,000	19,972,854.26	9.55
4	140202	14国开02	100,000	10,070,100.68	4.81

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0962%
报告期内偏离度的最低值	0.0186%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0485%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

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十名资产支持证券投资明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	1,020,017.50
4	应收申购款	13,106.13
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	1,033,123.63

5.9.4 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

项目	大成慧成货币A	大成慧成货币B	大成慧成货币E
报告期期初基金份额总额	7,159,420.59	129,857,668.40	4,160,681.08
报告期期间基金总申购份额	15,847,564.11	574,933,165.66	4,038,910.31
报告期期间基金总赎回份额	12,179,034.21	508,148,579.26	6,455,715.89
报告期期末基金份额总额	10,827,950.49	196,642,254.80	1,743,875.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2018-09-06	5,000,000.00	5,000,000.00	–
2	赎回	2018-09-12	5,000,000.00	-5,000,000.00	–
3	红利发放	2018-09-28	1,819.53	1,819.53	–
合计			10,001,819.53	10,001,819.53	

注:1、申购或者购买基金份额的,金额为正;赎回或者卖出基金份额的,金额为负。

2、合计数以绝对值填列。

3、红利发放为期间合计数。

§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

投资者类别	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(%)
机构	1	20180703-20180930	–	50,300,393.25	–	50,300,393.25	24.04
	2	20180701-20180930	102,202,975.25	538,898.40	24,000,000.00	78,741,873.65	37.64
	3	20180727-20180829	582,003.74	130,282,292.85	130,000,000.00	864,296.59	0.41
	4	20180830-20180930	–	55,175,847.55	–	55,175,847.55	26.37
	5	20180705-20180722	–	179,247,325.93	179,247,325.93	0.00	0.00
	6	20180723-20180802	–	100,156,982.83	100,156,982.83	0.00	0.00
个人	–	–	–	–	–	–	–
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 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慧成货币市场基金的文件;

2、《大成慧成货币市场证券投资基金基金合同》;

3、《大成慧成货币市场证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司营业执照、法人许可证及公司章程;

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

大成景丰债券型证券投资基金(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	大成景丰债券(LOF)
场内简称	大成景丰
基金主代码	160915
交易代码	160915
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年10月16日
报告期末基金份额总额	132,182,530.65份
投资目标	在严格控制投资风险、保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获得高于业绩比较基准的投资业绩,使基金份额持有人获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究和投资管理优势,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,在资产配置、类属配置、个券选择和交易策略层面实施积极管理策略;在严格控制风险的前提下,实现基金组合风险和收益的最优配比。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券基金,风险收益水平高于货币市场基金,低于混合基金和股票基金。
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

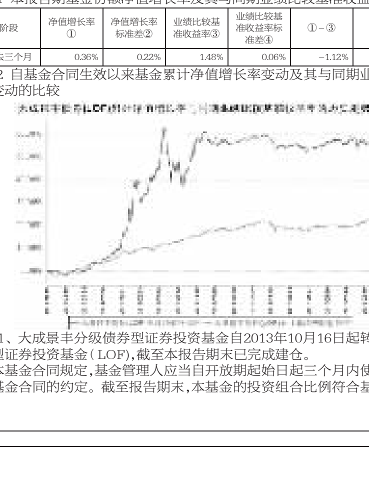
主要财务指标	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	537,821.32
2.本期利润	470,028.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0035
4.期末基金资产净值	145,740,070.05
5.期末基金份额净值	1.103

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	0.36%	0.22%	1.48%	0.06%	-1.12%	0.16%

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、大成景丰分级债券型证券投资基金自2013年10月16日起转型为大成景丰债券型证券投资基金(LOF),截至本报告期末已完成建仓。

2、本基金合同规定,基金管理人应当自开放期起始日起三个月内使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

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		
李富强	本基金基金经理	2018年7月16日	–	4年	经济学硕士。2009年7月至2013年12月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014年1月至2017年7月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司,任职于固定收益总部。2018年7月16日起任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景利混合型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国。
赵世宏	本基金基金经理	2016年3月26日	2018年7月20日	7年	经济学硕士。2011年3月至2012年9月任中银基金管理有限公司研究员。2012年9月至2015年9月任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2015年9月加入大成基金管理有限公司,任职于固定收益总部。2016年3月26日至2018年7月20日起担任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成景利混合型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金和大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年3月26日至2018年6月25日担任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2016年11月8日至2018年7月20日担任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年2月16日至2018年7月20日任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月18日至2018年7月20日担任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年5月15日至2018年7月20日担任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月6日至2018年7月20日担任大成惠明定期开放纯债债券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

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年三季度,投资和消费增速均下行,其中基建投资受制于资金来源和项目减少出现震荡,地产投资在低库存的背景下保持较高增速,制造业投资低位回升,但企业经营出现分化,下游、民营企业经营困难为后续制造业带来不确定性。由于居民杠杆较高导致消费被挤出,消费仍然缺乏支撑。整体看后续经济增长点一是基建投资的回升,二是制造业投资能否延续。近期通胀担忧逐步抬升,猪肉价格在经历2年下行周期后低位回升,会推动后续CPI上行,但在总体需求回落的环境下,价格上涨不可持续,预计不会对货币政策产生很大影响。国外方面,一是贸易摩擦不断升级,虽然我国对出口依赖度已经降低,但出口作为2017年经济边际改善的重要原因,对后续经济走势影响仍然较大;二是外围经济持续向好带动货币政策收紧,与我国国内经济下行形成反差,人民币汇率有贬值压力。7月中美贸易摩擦升级,三季度央行货币政策进一步放松,定向降准实施,MLF超额投放。国常会提出维持流动性合理充裕,积极财政政策更加积极,理财新规细则也有所放松,"宽货币+宽信用"格局和稳杠杆基调确立。资金价格中枢整体较二季度大幅下行。稳杠杆措施有所收效,金融机构信用扩张整体平稳,社融新增有所回升,但信贷质量依然欠佳。三季度股市弱势盘整,债市在7月明显上涨后,窄幅波动。

组合操作上,本基金根据市场变化灵活调整权益仓位,个股向有政策支持、有利润支撑的行业转化。债券操作方面,个券投资集中于中高等级信用券和利率债,充分利用当前融资成本较低的市场环境,适当使用杠杆。

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1.103元;本报告期基金份额净值增长率为0.36%,业绩比较基准收益率为1.48%。

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	20,686,906.47	11.38
	其中:股票	20,686,906.47	11.38
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	155,902,636.00	85.76
	其中:债券	155,902,636.00	85.76
	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	2,392,331.12	1.32
8	其他资产	2,801,866.58	1.54
9	合计	181,783,740.17	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	3,367,900.00	2.31
C	制造业	14,825,162.47	10.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	–	–
J	金融业	1,739,900.00	1.19
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	753,944.00	0.52
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	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	20,686,906.47	14.19

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	000661	长春高新	7,400	1,753,800.00	1.20
2	601225	陕西煤业	200,000	1,740,000.00	1.19
3	601318	中国平安	25,400	1,739,900.00	1.19
4	300122	智飞生物	33,300	1,630,368.00	1.12
5	300661	圣邦股份	16,120	1,528,176.00	1.05
6	600028	中国石化	200,000	1,424,000.00	0.98
7	000960	锡业股份	131,138	1,378,260.38	0.95
8	600104	上汽集团	40,000	1,331,200.00	0.91
9	600887	伊利股份	48,811	1,253,466.48	0.86
10	603515	欧普照明	39,390	1,145,067.30	0.79

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	85,701,636.00	58.80
	其中:政策性金融债	85,701,636.00	58.80
4	企业债券	29,869,000.00	20.49
5	企业短期融资券	10,104,000.00	6.93
6	中期票据	30,228,000.00	20.74
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	155,902,636.00	106.97

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	018005	国开1701	251,060	25,256,636.00	17.33
2	180204	18国开04	200,000	20,582,000.00	14.12
3	180210	18国开10	200,000	19,746,000.00	13.55
4	101558004	15陕延油MTN001	100,000	10,169,000.00	6.98
5	041758034	17常高新CP001	100,000	10,104,000.00	6.93

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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。

5.10.2 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。

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	34,641.55
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,767,225.03
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,801,866.58

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	134,978,902.50
报告期期间基金总申购份额	7,239.72
减:报告期期间基金总赎回份额	2,803,611.57
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	132,182,530.65

§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

投资者类别	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(%)
机构	1	20180701-20180930	93,223,741.44	–	–	93,223,741.44	70.53
个人	–	–	–	–	–	–	–
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 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景丰分级债券型证券投资基金的文件;

2、《大成景丰债券型证券投资基金基金合同》;

3、《大成景丰债券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

大成新锐产业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	大成新锐产业混合
基金主代码	090018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月20日
报告期末基金份额总额	32,860,911.86份
投资目标	投资于新锐产业中的优质上市公司,分享中国经济增长新锐力量的成长收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下、自下而上相结合的积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础,通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析,实施大类资产配置;分析中国经济结构转型背景下社会意识(可持续发展观等)、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响,研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景,结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量,实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业的竞争优势进行细致分析(包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面),结合股票基本面指标分析(包括成长性指标、估值水平),精选优质上市公司股票,力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
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	1,087,513.36
2.本期利润	-5,077,863.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1544
4.期末基金资产净值	49,698,062.58
5.期末基金份额净值	1.512

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。

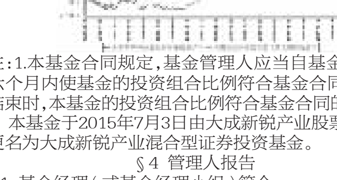
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-9.30%	1.41%	-1.29%	1.09%	-8.01%	0.32%

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。

2. 本基金于2015年7月3日由大成新锐产业股票型证券投资基金更名为大成新锐产业混合型证券投资基金。

§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		
侯春燕	本基金基金经理	2017年12月1日	–	8年	经济学硕士。2010年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2015年12月9日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2017年1月18日起任大成消费主题混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年12月1日起任大成新锐产业混合型证券投资基金基金经理。2018年9月7日起任大成策略回报混合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

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

在货币收紧、去杠杆的背景下,经济数据显示实体经济走弱。A股市场在持续下跌至9月中旬,之后开始反弹,上证综指在3季度微跌,主要是石油石化和金融板块表现相对较强,其他板块跌幅仍然较大。本基金在三季度维持仓位的稳定,对持仓个股做了微幅调整,减持了涨幅过高的个股,对于部分因短期因素干扰下跌较多但长期空间大、竞争力强的个股进行了增持。

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1.512元;本报告期基金份额净值增长率为-9.30%,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

本基金在本报告期内,曾出现了连续20个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§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	45,769,008.24	90.84
	其中:股票	45,769,008.24	90.84
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	4,603,089.10	9.14
8	其他资产	14,361.62	0.03
9	合计	50,386,458.96	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	–	–
C	制造业	26,630,106.04	53.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	2,842,500.00	5.72
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	2,687,214.00	5.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,484,282.00	2.99
J	金融业	2,713,248.00	5.46
K	房地产业	3,333,511.00	6.71
L	租赁和商务服务业	1,284,159.00	2.58
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	–	–
R	文化、体育和娱乐业	4,793,988.20	9.65
S	综合	–	–
	合计	45,769,008.24	92.09

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	300144	宋城演艺	184,900	4,114,025.00	8.28
2	002126	银轮股份	396,166	3,026,708.24	6.09
3	600998	九州通	187,500	2,842,500.00	5.72
4	600340	华夏幸福	100,800	2,553,264.00	5.14
5	300298	三诺生物	150,300	2,224,440.00	4.48
6	300408	三环集团	106,300	2,209,977.00	4.45
7	000869	张裕A	53,600	1,962,832.00	3.95
8	601966	玲珑轮胎	117,700	1,847,890.00	3.72
9	603556	海兴电力	136,620	1,799,285.40	3.62
10	002583	海能达	214,400	1,728,064.00	3.48

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

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。

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没有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。

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	8,328.66
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	823.60
5	应收申购款	5,209.36
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	14,361.62

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	32,911,241.75
报告期期间基金总申购份额	996,153.49
减:报告期期间基金总赎回份额	1,046,483.38
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	32,860,911.86

§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

投资者类别	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(%)
机构	1	20180701-20180930	10,000,400.00	–	–	10,000,400.00	30.43
个人	–	–	–	–	–	–	–
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 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新锐产业股票型证券投资基金的文件;

2、《大成新锐产业股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型以及修订基金合同部分条款的公告》;

3、《大成新锐产业混合型证券投资基金基金合同》;

4、《大成新锐产业混合型证券投资基金托管协议》;

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。

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