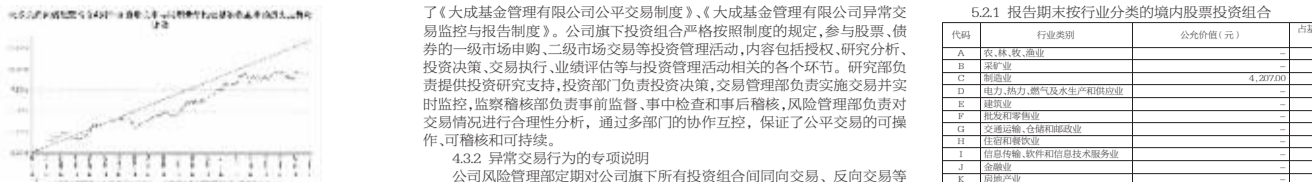


大成景辉灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告



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》、《大成基金管理有限公司旗下主动投资组合旗下主动投资组合股票交易与报告制度》、《大成基金管理有限公司旗下主动投资组合与指数型投资组合之间或指数量投资组合之间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日成交量的5%的交易情形;投资组合内债券交易存在1个工作日内反向交易,原因为投资组合流动性需要;投资组合间反向交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易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不同交易行为,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不存在利益输送的可能性。

4.3 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;主动投资组合与指数型投资组合之间或指数量投资组合之间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日成交量的5%的交易情形;投资组合内债券交易存在1个工作日内反向交易,原因为投资组合流动性需要;投资组合间反向交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易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不同交易行为,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,宏观政策出现了一些调整。财政政策方面,7月的国务院常务会议强调财政政策要更加积极,三季度地方债也确确实实地发了,但目前地方政府财政开支空间有限,货币政策方面,资金面持续宽松,但货币市场利率在8月达到低点后有所反弹,未来进一步下行可能受到汇率和通胀的约束。金融监管政策继续落地,但节奏趋缓。受益于政策的微调,整体利率水平的下降,债市调整速度有所减缓,信用收敛趋缓。

具体到市场方面,三季度债市上涨为主,其中信用债表现较利率债好,以中债综合财富指数指数衡量,三季度上涨了约1.5%,利率债收益率曲线短端陡化,其中,代表性品种10年期国债三季度末上行3bps,10年期国债收益率下行7.5bps,信用债利率略有收敛,中短端的中等等级信用债收益率大幅下行。权益市场方面,主要股指的表现分化,其中上证50指数上涨5.9%,创业板指数下跌12%,操作上,大类资产配置方向主要集中在中长期信用债和蓝筹股。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末大成景辉灵活配置混合A基金份额净值为1.063元,本报告期A类基金份额净值增长率为0.19%,同期业绩比较基准收益率为1.07%。

4.6 报告期内基金持有人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	4,207,000	0.30
2	债券投资	4,207,000	0.30
3	其他资产	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	8,414,000	0.60

5.2 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	63,050,000	10.54
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	信息传输、软件和信息技术服务业	61,252,000	10.07
I	金融业	-	-
K	房地产业	41,400,000	12.89
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	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	156,194,000	46.11
合计		161,246,000	46.11

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	000003	招商银行	100	4,207,000	0.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	招商银行	100	4,207,000	0.11

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	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	招商银行	100	4,207,000	0.11

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贵金属投资明细

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	000003	招商银行	100	4,207,000	0.11

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权证投资明细

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	000003	招商银行	100	4,207,000	0.11

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股指期货投资明细

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	000003	招商银行	100	4,207,000	0.11

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证券是否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	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.7 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.8 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.10 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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.12 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.15 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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.17 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.18 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.20 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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.21 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.22 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.23 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.25 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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.26 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.27 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.28 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.30 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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.31 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.32 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.33 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.35 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	高溢价发行的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	000003	招商银行	6,414,000	2.01	重大资产

5.11.36 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11.37 开放式基金份额变动

项目	大成景辉灵活配置混合A	大成景辉灵活配置混合C
报告期末基金份额总额	47,132,127	208,102,025
报告期基金份额总额	1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)	-1,098,644	16,600
报告期基金份额变动(申购减少/赎回增加)占期初基金份额总额的比例	-10.00%	0.10%

5.11.38 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422,000
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,000
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,452,000

5.11.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	债券名称
----	------	------