

大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第三季度报告

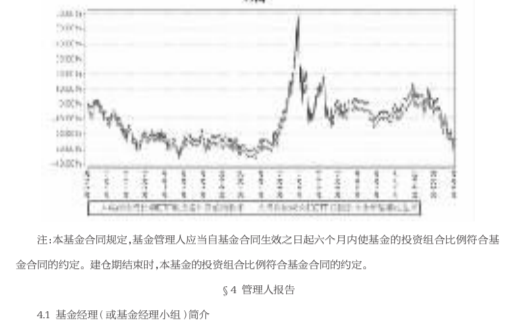
基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期末2018年9月30日-2018年9月30日
1.本期已实现收益 -89,446,652
2.本期利润 -19,142,466.26
3.加权平均基金份额本期利润 -0.1391
4.期末基金份额净值 106.191,798.00
5.期末基金份额总额 9,762

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their qualifications.

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。
3.2. 基金经理在报告期内未发生任何违法违规及违反职业道德的行为。

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 超额收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -18.43% 1.47% -14.24% 1.65% -1.19% -0.12%



大成深证成长40ETF(交易型)净值增长率与业绩比较基准收益率年度走势对比图

大成添利宝货币市场基金

2018年第三季度报告

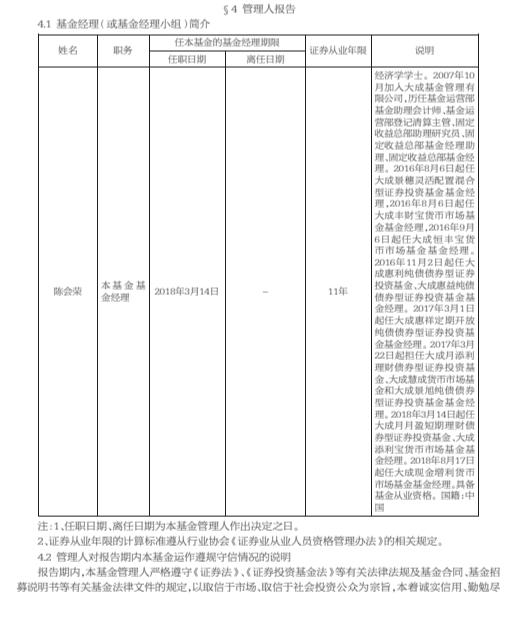
基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期末2018年9月30日-2018年9月30日
1.本期已实现收益 222,117.26
2.本期利润 229,718,168.07
3.加权平均基金份额本期利润 0.000094
4.期末基金份额净值 117.127,146.89
5.期末基金份额总额 34,339,133,976.63

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their qualifications.

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。
3.2. 基金经理在报告期内未发生任何违法违规及违反职业道德的行为。

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 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 超额收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 0.9213% 0.0009% 0.0882% 0.0000% 0.7639% 0.0009%



大成添利宝货币市场基金净值增长率与业绩比较基准收益率年度走势对比图

大成添益交易型货币市场基金

2018年第三季度报告

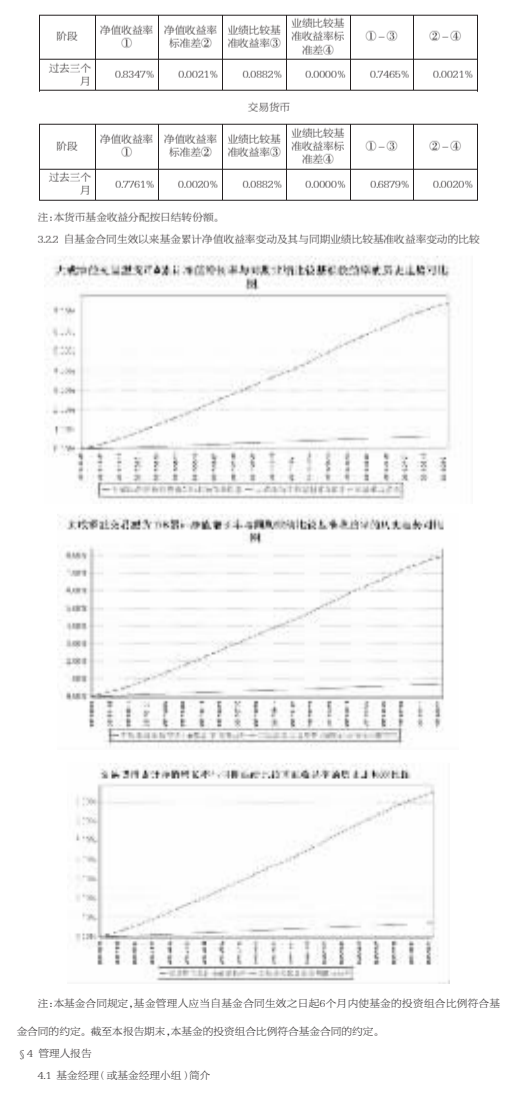
基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日
重要提示:基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期末2018年9月30日-2018年9月30日
1.本期已实现收益 174,296.86
2.本期利润 127,097.71
3.加权平均基金份额本期利润 0.00273
4.期末基金份额净值 106.47311
5.期末基金份额总额 4,931,324,096.63

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their qualifications.

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。
3.2. 基金经理在报告期内未发生任何违法违规及违反职业道德的行为。

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 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 超额收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 0.7956% 0.0029% 0.0882% 0.0000% 0.6853% 0.0029%



大成添益交易型货币市场基金净值增长率与业绩比较基准收益率年度走势对比图

3.1.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
3.1.1.1 本报告期没有股指期货交易
3.1.1.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
3.1.1.3 本报告期没有股指期货交易
3.1.2 报告期末本基金投资的国债期货情况说明
3.1.2.1 本报告期没有国债期货交易
3.1.2.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
3.1.2.3 本报告期没有国债期货交易

3.2 投资组合报告
3.2.1 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 96,570,000.00 91.67%
其中:股票 96,570,000.00 91.67%
2 固定收益投资 -
其中:债券 -
3 金融衍生品投资 -
4 买入返售金融资产 -
5 其他资产 -
6 银行存款和结算备付金合计 8,870,147.97 8.41%
7 其他资产 26,130.36 0.02%
8 合计 105,466,278.33 100.00%

3.3 报告期末投资组合平均余额明细表
3.3.1 报告期末投资组合平均余额明细表
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 国债 1,396,787,168.00 3.36%
2 央行票据 -
3 金融债券 701,112,088.29 1.68%
其中:政策性金融债 701,112,088.29 1.68%
4 企业债券 -
5 企业短期融资券 1,675,177,511.25 4.02%
6 中期票据 -
7 同业存单 9,308,611,211.96 22.33%
8 其他 -
9 合计 13,081,108,979.09 31.39%