

大成灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

之不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或较多

的单向交易金额超过该当日成交总金额的5%的交易情形;投资组合中债券交易存在1

笔同日反向交易,原因为投资策略调整;投资组合中反向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

交易;投资组合虽然存在同日交易行为,但结合交易价差分析统计分析和套利利

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 报告期内本基金投资策略和运作分析

2018第二季度,受国内经济存在一定的下行压力,以及中美贸易战的冲击,国内

的A股市场继续呈现震荡的态势。除了银行、军工等少数几个行业外,其他行业,

包括前期表现较好的医药生物、家电、食品饮料等行业均出现一定幅度的跌

幅。1-9季度末,受国内出台一系列提升经济活力,鼓励消费和科技创新等政策

的刺激,市场有所反弹。

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1.567元;本报告期基金份额净值增值率

为-6.34%,业绩比较基准收益率为1.21%。

4.6 报告期内基金持有人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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	100,413,003.16	70.50
2	基金投资	89,413,808.19	62.83
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	43,889,917.62	31.06
11	其他资产	4,201,497.62	2.99
12	合计	208,564,416.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,136,274.00	3.28
B	制造业	94,488,779.17	60.31
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	899.00	0.00
F	批发和零售业	5,489,161.11	3.49
G	交通运输、仓储和邮政业	9,408,848.19	6.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	134,420.76	0.07
J	金融业	13,860,499.42	8.97
K	房地产业	3,263,248.08	2.10
L	租赁和商务服务业	24,504,472.00	15.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	13,260,000.00	8.48
Q	综合	-	-
合计		180,413,003.16	77.62

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,200,000	12,000,000.00	7.71
2	000002	万科A	1,000,000	10,000,000.00	6.48
3	000003	招商银行	800,000	8,000,000.00	5.17
4	000025	广生堂	400,000	4,000,000.00	2.59
5	000004	比亚迪	300,000	3,000,000.00	1.93
6	000005	格力电器	200,000	2,000,000.00	1.29
7	000006	中兴通讯	150,000	1,500,000.00	0.96
8	000007	中国宝安	100,000	1,000,000.00	0.64
9	000008	五粮液	50,000	500,000.00	0.32
10	000009	金城医药	50,000	500,000.00	0.32

5.3.1 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

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	30,496,772.60	6.21
2	金融债	30,496,772.60	6.21
3	企业债	30,496,772.60	6.21
4	可转债	-	-
5	其他固定收益品种	-	-
6	合计	91,490,317.80	20.62

5.3.2 报告期末按摊余成本法计算的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	30,496,772.60	6.21
2	金融债	30,496,772.60	6.21
3	企业债	30,496,772.60	6.21
4	可转债	-	-
5	其他固定收益品种	-	-
6	合计	91,490,317.80	20.62

5.3.3 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资产支持

序号	资产支持证券名称	持仓数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0118000791	300,000	30,000,251.40	6.20
2	0118000122	300,000	30,000,152.41	6.20
3	170413	170,000	17,000,308.80	4.17
4	160223	100,000	10,000,792.20	2.04
5	1118001010	100,000	9,984,184.01	2.03

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%以内的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0062%
报告期内偏离度的最低值	0.0062%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的平均值	0.0272%

5.8 报告期末按摊余成本法计算的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	60,967,403.81	1.87
2	金融债	130,434,786.23	3.63
3	企业债	130,434,786.23	3.63
4	可转债	-	-
5	其他固定收益品种	10,454,044.67	2.22
6	合计	331,836,980.94	20.35
7	资产支持证券	791,440,206.11	20.90
8	其他	-	-
9	合计	1,023,277,187.04	26.42

5.9 报告期末按摊余成本法计算的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	11180006	1,000,000	96,576,517.04	2.77
2	11180003	1,000,000	96,576,517.04	2.77
3	11180001	800,000	79,603,981.18	2.31
4	11180002	800,000	79,566,207.51	2.21
5	11180011	700,000	67,867,872.22	1.89
6	11180027	600,000	49,784,184.28	1.38
7	11180117	500,000	49,412,152.13	1.37
8	11180131	500,000	49,412,152.13	1.37
9	11180038	500,000	49,329,013.53	1.37
10	11180346	500,000	49,184,882.63	1.37
11	11180229	500,000	48,764,762.34	1.36
12	000003	400,000	40,069,423.00	1.11

5.10 报告期末按摊余成本法计算的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	11180006	1,000,000	96,576,517.04	2.77
2	11180003	1,000,000	96,576,517.04	2.77
3	11180001	800,000	79,603,981.18	2.31
4	11180002	800,000	79,566,207.51	2.21
5	11180011	700,000	67,867,872.22	1.89
6	11180027	600,000	49,784,184.28	1.38
7	11180117	500,000	49,412,152.13	1.37
8	11180131	500,000	49,412,152.13	1.37
9	11180038	500,000	49,329,013.53	1.37
10	11180346	500,000	49,184,882.63	1.37
11	11180229	500,000	48,764,762.34	1.36
12	000003	400,000	40,069,423.00	1.11

5.11 报告期末按摊余成本法计算的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	11180006	1,000,000	96,576,517.04	2.77
2	11180003	1,000,000	96,576,517.04	2.77
3	11180001	800,000	79,603,981.18	2.31
4	11180002	800,000	79,566,207.51	2.21
5	11180011	700,000	67,867,872.22	1.89
6	11180027	600,000	49,784,184.28	1.38
7	11180117	500,000	49,412,152.13	1.37
8	11180131	500,000	49,412,152.13	1.37
9	11180038	500,000	49,329,013.53	1.37
10	11180346	500,000	49,184,882.63	1.37
11	11180229	500,000	48,764,762.34	1.36
12	000003	400,000	40,069,423.00	1.11

5.12 报告期末按摊余成本法计算的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	11180006	1,000,000	96,576,517.04	2.77
2	11180003	1,000,000	96,576,517.04	2.77
3	11180001	800,000	79,603,981.18	2.31
4	11180002	800,000	79,566,207.51	2.21
5	11180011	700,000	67,867,872.22	1.89
6	11180027	600,000	49,784,184.28	1.38
7	11180117	500,000	49,412,152.13	1.37
8	11180131	500,000	49,412,152.13	1.37
9	11180038	500,000	49,329,013.53	1.37
10	11180346	500,000	49,184,882.63	1.37
11	11180229	500,000	48,764,762.34	1.36
12	000003	400,000	40,069,423.00	1.11

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

5.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告中不存在虚假记载、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法律责任。

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

基金的一定盈利。

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	大成灵活配置混合
基金代码	000002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年01月27日
报告期末基金份额总额	131,001,134.32份

投资目标 本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,积极发掘市场上涨空间,在

控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值,在控制风险的前提下为投资者

提供长期稳定的投资回报。

投资策略 本基金通过宏观经济分析、行业分析、公司研究等多种方法,对宏观经济、

行业景气度、公司盈利能力和成长性进行综合研判,在严格控制风险的前提下,

积极配置于具有良好成长性的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、

期权、结构化产品等金融工具,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 年化收益率3%

风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债

券基金,低于股票型基金、属中高风险收益特征的基金。

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

基金销售机构 大成基金管理有限公司

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

基金的一定盈利。

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	大成现金宝货币市场基金
基金代码	010002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年01月27日
报告期末基金份额总额	131,001,134.32份

投资目标 本基金通过投资于具有良好流动性的金融工具,在严格控制风险的前

提下,力争实现基金资产的长期增值,在控制风险的前提下为投资者提供长期

稳定的投资回报。

投资策略 本基金通过宏观经济分析、行业分析、公司研究等多种方法,对宏观

经济、行业景气度、公司盈利能力和成长性进行综合研判,在严格控制风险

的前提下,积极配置于具有良好成长性的股票、债券、货币市场工具、权证、

股指期货、期权、结构化产品等金融工具,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 年化收益率3%

风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金

和债券基金,低于股票型基金、属中高风险收益特征的基金。