

大成积极成长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。

投资组合报告
报告期末基金资产组合情况
权益投资: 2,436,738.78
债券投资: 606,125,975.13
基金投资: 428,309,765.04

少数单边交易超过或接近当日成交5%的申购赎回,投资组合债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要,投资组合相向交易同日反向交易的市场成交比例、成交价均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,投资组合虽然存在同向交易行为,但结合成交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不存在利益输送的可能性。

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance). Rows include 本报告期净利润 (Net Income for the Period), 本期利润总额 (Total Profit for the Period), 本期基金份额净值增长率 (Fund Net Value Growth Rate) etc.

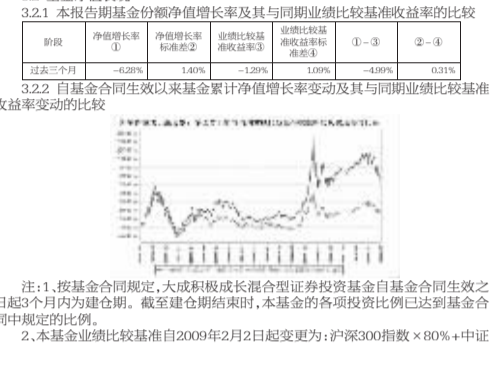
Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 李刚
职务: 基金经理
任本基金的基金经理时间: 2018年01月01日至今

Table 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance) with unit: 人民币元 (RMB Yuan).

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,以诚实守信、取信于社会投资者为宗旨,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。

Table 5.1 报告期末基金资产组合情况 (5.1 Fund Asset Composition at the End of the Reporting Period). Columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金总资产比例(%) (Percentage of Total Assets).



注:1、按基金合同规定,大成积极成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起6个月内建仓。截至建仓期结束时,本基金的各项投资比例已达基金合同中规定的比例。
2、本基金业绩比较基准自2009年02月12日起变更为:沪深300指数×80%+中证

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
A 农林、牧、渔业 20,622,400.00 2.86
B 零售业 58,477,203.23 8.06
C 制造业 23,704,200.00 3.33

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
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。

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance) with unit: 人民币元 (RMB Yuan).

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance) with unit: 人民币元 (RMB Yuan).

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance) with unit: 人民币元 (RMB Yuan).

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

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。

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance) with unit: 人民币元 (RMB Yuan).

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Value Performance) with unit: 人民币元 (RMB Yuan).

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

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的股票。
5.11.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存在保证金 324,120.00
2 应收证券清算款 14,200,404.43
3 应收利息 33,548.56
4 应收申购款 20,004.02
5 其他应收款 2,698,532.64
6 应付利息 1,759,427.75
7 预提费用 1,759,427.75
8 其他 17,274,700.84
9 合计 17,274,700.84

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。
5.16 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。

Table 6 开放式基金份额变动 (6 Open-ended Fund Share Changes) with unit: 份 (Shares). Columns: 项目 (Item), 大成睿景灵活配置混合型证券投资基金 (Dacheng Ruijing Flexible Configuration Hybrid Fund), 大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金 (Dacheng Shengshi Selected Flexible Configuration Hybrid Fund).

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
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。

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (5.2 Stock Investment Portfolio by Industry at the End of the Reporting Period).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (5.2 Stock Investment Portfolio by Industry at the End of the Reporting Period).

Table 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (5.2 Stock Investment Portfolio by Industry at the End of the Reporting Period).

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
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。

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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 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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (4.1 Introduction of the Fund Manager(s)). Columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure as Fund Manager), 曾任基金经理 (Former Fund Managers), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Notes).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (5.2 Stock Investment Portfolio by Industry at the End of the Reporting Period).

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、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资策略研究支持,投资部负责投资决策,交易管理部负责实施交易并及时监控、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。

Table 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (5.2 Stock Investment Portfolio by Industry at the End of the Reporting Period).

Table 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (5.2 Stock Investment Portfolio by Industry at the End of the Reporting Period).