

大成高新技术产业股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

注：1.任日期,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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明 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,以诚信于市场、取信于社会投资者公众为宗旨,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《证券投资基金管理人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决策支持,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双向交易、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日成交总量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 前三季度市场整体受宏观经济和贸易等不确定性因素影响偏弱,经过调整,一些优质公司估值逐步进入合理区域,自然存在后期盈利预期上调的避险。该类公司商业模式成熟,竞争力清晰,长期看仍然值得配置。新兴产业整体继续处于高位估值。

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1.502元;本报告基金份额净值增长率为-5.06%,业绩比较基准收益率为-6.29%。

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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 无。

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。

大成货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

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总量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。

二季度经济下行压力有所加大,基建投资逐步回落,带动固定资产投资增速较上季度的6.0%回落至5.9%,但房地产开发投资和制造业投资保持了较好的韧性,且从两者的累计同比增速分别为10.1%和7.5%。外贸方面,出口(以美元计)同比增长5.9%,后随着中美贸易摩擦负面影响逐步体现,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,高于新增信贷有所放慢,而非标融资快速下滑的势头也有所收敛,截止8月社会融资存量同比增速下降至10.14%,较年初低0.3个百分点。

7月央行年内第三次下调存款准备金率,释放资金约7000亿元,使得三季度流动性进一步宽松。

市场交易方面,三季度银行间质押式回购隔夜加权平均利率约为2.25%,较二季度下降约3BP;7天质押式回购加权平均利率为2.67%,比二季度低12BP;91天、181天和1年期的AA级国债收益率较二季度分别下降3.65%、分别下行7BP、67BP和8BP。

二季度本基金以保障流动性为前提,并选择在收益相对较高点适度配置中长期限的资产,增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现 本报告期末大成货币A 基金份额净值收益率为0.7774%,本报告期末货币B 基金份额净值收益率为0.8382%,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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

5.8 报告期内公允价值持续偏离度绝对值超过0.25%的情况说明

报告期内公允价值持续偏离度绝对值超过0.25%情况说明 无。

5.9 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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金投资采用摊余成本法估值,即估值对象以深入或买入式,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价,在其剩余存续期内按摊余成本法每日计提损益。本基金通过每日计算其收益并分配的方式,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、处罚的情况 无。

5.9.3 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体无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、处罚的情况 无。

大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

注：1.任日期,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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明 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,以诚信于市场、取信于社会投资者公众为宗旨,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《证券投资基金管理人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决策支持,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双向交易、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总量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 前三季度市场整体受宏观经济和贸易等不确定性因素影响偏弱,经过调整,一些优质公司估值逐步进入合理区域,自然存在后期盈利预期上调的避险。该类公司商业模式成熟,竞争力清晰,长期看仍然值得配置。新兴产业整体继续处于高位估值。

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1.502元;本报告基金份额净值增长率为-5.06%,业绩比较基准收益率为-6.29%。

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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 无。

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 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 无。

大成基金管理人: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

重要提示: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,业绩并不表示其未来表现。投资者有风险,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。本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称:大成高新技术产业股票型证券投资基金

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年11月23日

报告期末基金份额总额:2,791,479,398.29份

投资目标:本基金主要投资于符合国家产业政策、上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略:本基金的投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略、风险控制策略、组合调整策略、衍生品投资策略等。

业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%

风险收益特征:本基金为股票型基金,其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。本基金主要投资于高新技术产业,具有较高风险。

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

主要财务指标 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日

1.本期应计提收益 -3,820,139.36

2.本期利润 -19,966,807.79

3.加权平均基金份额本期利润 -0.00729

4.期末基金资产净值 414,867,295.29

5.期末基金份额净值 1.502

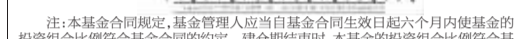
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益为零。

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同约定,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,建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4 基金管理人(或基金经小组)简介

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

重要提示: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,业绩并不表示其未来表现。投资者有风险,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。本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称:大成货币市场证券投资基金

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年11月23日

报告期末基金份额总额:363,828,634.45份

投资目标:本基金主要投资于符合法律法规、流动性强、风险低、收益稳定的货币市场工具,通过分散投资,力求为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略:本基金的投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略、风险控制策略、组合调整策略、衍生品投资策略等。

业绩比较基准:一年期定期存款利率(税后)+中债综合指数收益率*50%

风险收益特征:本基金为货币型基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金主要投资于货币市场工具,具有低风险。

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

主要财务指标 报告期末2018年7月1日至2018年9月30日

1.本期应计提收益 2,296,761.40

2.本期利润 2,296,761.40

3.加权平均基金份额本期利润 0.00625

4.期末基金资产净值 363,828,634.45

5.期末基金份额净值 1.000

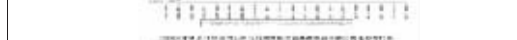
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益为零。

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同约定,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,建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4 基金管理人(或基金经小组)简介

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

重要提示: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,业绩并不表示其未来表现。投资者有风险,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。本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

注：1.任日期,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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明 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,以诚信于市场、取信于社会投资者公众为宗旨,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《证券投资基金管理人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决策支持,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双向交易、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总量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 前三季度市场整体受宏观经济和贸易等不确定性因素影响偏弱,经过调整,一些优质公司估值逐步进入合理区域,自然存在后期盈利预期上调的避险。该类公司商业模式成熟,竞争力清晰,长期看仍然值得配置。新兴产业整体继续处于高位估值。

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1.502元;本报告基金份额净值增长率为-5.06%,业绩比较基准收益率为-6.29%。

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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 无。

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 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 无。

大成货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

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总量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。

二季度经济下行压力有所加大,基建投资逐步回落,带动固定资产投资增速较上季度的6.0%回落至5.9%,但房地产开发投资和制造业投资保持了较好的韧性,且从两者的累计同比增速分别为10.1%和7.5%。外贸方面,出口(以美元计)同比增长5.9%,后随着中美贸易摩擦负面影响逐步体现,出口