大成竞争优势混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成竞争优势混合
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月22日
报告期末基金份额总额	988,709,318.81份
投资目标	主要投资于具有持续竞争优势的企业,追求基金资产长期增值。
投资策略	通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素"自上而下"的定量和定性分析,评估各类资产的投资价值,研究各类资产价值的变化趋势,确定组合中股票、债券等各类资产的投资比例。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中债综合指数
风险收益特征	本混合型基金预期风险收益水平低于股票基金,高于债券基金和货币市场基金。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-5,878,283.08
2.本期利润	36,977,577.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0358
4.期末基金资产净值	1,039,198,328.54
5.期末基金份额净值	1.051

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。

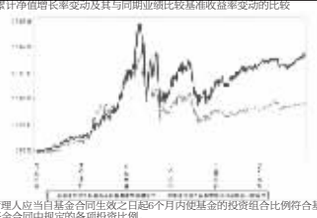
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.00%	0.46%	3.22%	0.39%	1.78%	0.07%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐彦先生	本基金基金经理	2014年4月25日	-	11年	管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部,2007年加入大成基金研究部,曾任中游制造行业研究主管,2011年7月29日至2012年10月27日曾任景顺证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2012年10月31日至2015年7月21日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理,2015年7月22日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2015年7月21日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理,2015年7月22日起任大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。2015年2月3日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2015年9月15日起任大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

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,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,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

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具,对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,组投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但组合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。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股当日成交量5%的情形;主动投资组合间债券交易存在4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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年1季度,经济运行比预期强劲,尤其制造业出现回暖,显示实体经济在自然出清和供给侧改革作用下出现阶段性好转。货币政策转向中性偏紧状态,无风险利率抬升,但由于整体流动性仍比较宽裕,资产价格并未出现显著回调。

市场方面,债市整体平担化上行,一月份调整较多,二三月份相对平稳,产业债较城投债表现更好。权益市场在1月份经历可观上涨,后窄幅波动。

转债市场分别受股债市场的影响,个券仓位进一步逐渐,走势分化明显。

组合操作上,本基金根据市场变化灵活调整了转债及权益仓位。

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1.138元;本报告期基金份额净值增长率为-0.70%,业绩比较基准收益率为-0.07%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,346,949.94	16.13
	其中:股票	8,346,949.94	16.13
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	40,547,020.15	78.36
	其中:债券	40,547,020.15	78.36
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	767,513.00	1.48
8	其他资产	2,083,551.16	4.03
9	合计	51,745,034.25	100.00

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

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	-	0.00
B	采矿业	846.07	0.00
C	制造业	375,423,769.49	36.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	184,295.39	0.02
E	建筑业	285,813.30	0.03
F	批发和零售业	84,370,270.04	8.12
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.01
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	460,507.78	0.04
J	金融业	2,028.48	0.00
K	房地产业	217,225,460.71	20.90
L	租赁和商务服务业	7,813,505.20	0.75
M	科学研究和技术服务业	18,633.92	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	137,439.79	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	80,911,844.02	7.79
S	综合	-	0.00
	合计	766,965,729.08	73.80

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	002285	世联行	10,877,886	85,500,183.96	8.23
2	600340	华夏幸福	3,033,904	82,704,223.04	7.96
3	300144	宋城演艺	4,143,556	80,882,213.12	7.78
4	603556	海兴电力	1,634,037	79,185,433.02	7.62
5	002050	三花智控	6,816,539	73,141,463.47	7.04
6	600297	广汇汽车	7,751,772	71,316,302.40	6.86
7	000538	云南白药	761,649	64,831,562.88	6.24
8	300408	三环集团	2,598,151	51,469,371.31	4.95
9	600325	华发股份	3,619,103	49,002,654.62	4.72
10	600285	羚锐制药	3,206,850	37,744,624.50	3.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债(可交换债)	448,568.10	0.04
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	448,568.10	0.04

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	2,970	358,568.10	0.03
2	113012	骆驼转债	900	90,000.00	0.01

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证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内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的,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 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股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	488,987.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,403.26
5	应收申购款	153,359.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	699,749.79

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	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	358,568.10	0.03

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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002050	三花智控	73,141,463.47	7.04	重大事项

5.11.6 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,615,377,275.15
报告期期间基金总申购份额	252,175,989.68
减:报告期期间基金总赎回份额	878,843,946.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	988,709,318.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	20170210-20170331	0.00	244,138,281.69	0.00		244,138,281.69	24.69
	2	20170123-20170209	149,999,500.00	0.00	0.00		149,999,500.00	15.17
	3	20170101-20170331	483,364,051.74	0.00	22,000,000.00		461,364,051.74	46.66
	4	20170101-20170122	667,208,515.87	0.00	667,208,515.87		0.00	0.00
个人	-	-	-	-	-		-	0.00
产品特有风险								
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险,甚至有可能引起基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。								

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于2017年2月18日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议(以下简称"董事会")审议通过,陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成保本混合型证券投资基金的文件;

2、《大成竞争优势混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成竞争优势混合型证券投资基金托管协议》;

4、《大成竞争优势股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》;

5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

6、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司

2017年4月21日

大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

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2017年4月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成绝对收益策略混合型发起式	
交易代码	001791	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年9月23日	
报告期末基金份额总额	35,499,772.51份	
投资目标	灵活配置股票和债券等各类资产的比例,优选量化投资策略进行投资,在有效控制风险的基础上,运用股指期货等工具对冲市场风险,寻求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采用多种绝对收益策略,剥离系统性风险,力争实现稳定的绝对回报。 1、Alpha对冲策略 本基金通过持续、科学、系统、深入的研究构建多头股票组合,并匹配合适的空头工具,剥离系统性风险。 2、其他绝对收益策略 本基金主要采用事件驱动、股指期货套利的对冲策略来捕捉绝对收益机会。同时,本基金根据市场情况的变化,灵活运用其他绝对收益策略(如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等)策略提高资本的利用率,从而提高绝对收益,达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)	
风险收益特征	本基金具有低波动率、低下方风险的特点,并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险,其预期收益及风险水平低于股票型基金,但高于债券型基金,属于中低风险水平的基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	大成绝对收益混合发起A	大成绝对收益混合发起C
下属分级基金的交易代码	001791	001792
报告期末下属分级基金的份额总额	29,362,486.18份	6,137,286.33份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	大成绝对收益混合发起A	大成绝对收益混合发起C
1. 本期已实现收益	47,044.88	132.24
2. 本期利润	-207,329.06	-89,275.68
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.0121
4. 期末基金资产净值	28,700,932.50	5,905,761.98
5. 期末基金份额净值	0.977	0.962

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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。

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

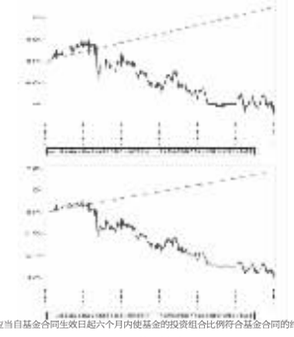
大成绝对收益混合发起A

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.71%	0.12%	0.36%	0.00%	-1.07%	0.12%

大成绝对收益混合发起C

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.93%	0.12%	0.36%	0.00%	-1.29%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石国武先生	本基金基金经理,专户投资类资产配置部总监	2015年9月23日	2017年3月18日	15年	工学硕士。2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司,历任系统分析员、股票投资部投资经理助理、特定资产部投资经理。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年4月18日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014年8月23日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2015年7月22日至2016年3月8日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年4月18日至2015年7月23日担任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年7月24日至2016年5月25日任大成优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年9月23日至2017年3月18日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年8月19日起任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月20日起任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。现任大类资产配置部总监。具有基金从业资格。国籍:中国
黎新平先生	本基金基金经理,与指数投资部总监	2017年3月18日	-	9年	黎新平先生,经济学博士。2008年7月至2015年6月历任Aristotle capital量化投资部资深策略师、投资经理。2015年7月加入大成基金管理有限公司。现任数量与指数投资部总监。自2016年9月20日起担任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。自2017年3月18日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

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,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,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

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具,对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,组投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但组合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。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股当日成交量5%的情形;主动投资组合间债券交易存在4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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年1季度,经济运行比预期强劲,尤其制造业出现回暖,显示实体经济在自然出清和供给侧改革作用下出现阶段性好转。货币政策转向中性偏紧状态,无风险利率抬升,但由于整体流动性仍比较宽裕,资产价格并未出现显著回调。

市场方面,债市整体平担化上行,一月份调整较多,二三月份相对平稳,产业债较城投债表现更好。权益市场在1月份经历可观上涨,后窄幅波动。

转债市场分别受股债市场的影响,个券仓位进一步逐渐,走势分化明显。

组合操作上,本基金根据市场变化灵活调整了转债及权益仓位。

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1.138元;本报告期基金份额净值增长率为-0.70%,业绩比较基准收益率为-0.07%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	21,523,880.93	61.85
	其中:股票	21,523,880.93	61.85
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	8,786,511.41	25.25
8	其他资产	4,489,850.34	12.90
9	合计	34,800,242.68	100.00

注:金融衍生品投资项下的股指期货投资净额为0,在当日无负债结算制度下,结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益,则金融衍生品投资项下的股指期货投资与相关的期货职业账户的持仓损益之间按抵销后的净额为0。

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

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	564,400.00	1.63
B	采矿业	215,930.00	0.62
C	制造业	8,541,638.00	24.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,445,878.00	4.18
E	建筑业	279,749.00	0.81
F	批发和零售业	2,323,545.93	6.71
G	交通运输、仓储和邮政业	1,689,994.00	4.88
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,511,050.00	4.37
J	金融业	3,087,720.00	8.92
K	房地产业	953,488.00	2.76
L	租赁和商务服务业	67,617.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	67,968.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	706,539.00	2.04
S	综合	68,364.00	0.20
	合计	21,523,880.93	62.20

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	002085	万丰奥威	28,700	644,315.00	1.86
2	000963	华东医药	6,600	611,490.00	1.77
3	000027	深圳能源	84,200	599,504.00	1.73
4	600582	天地科技	104,400	590,904.00	1.71
5	601258	庞大集团	204,200	588,096.00	1.70
6	600873	梅花生物	79,700	583,404.00	1.69
7	600252	中恒集团	129,200	580,108.00	1.68
8	000623	吉林敖东	19,000	578,930.00	1.67
9	600221	海南航空	167,300	577,185.00	1.67
10	000876	新希望	71,500	575,575.00	1.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持债券。

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证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1704	IC1704	-2	-2,548,320.00	20,920.00	-
IC1709	IC1709	-2	-2,471,040.00	-21,840.00	-
IF1704	IF1704	-3	-3,101,760.00	-57,780.00	-
IF1705	IF1705	-3	-3,086,100.00	4,500.00	-
IF1706	IF1706	-1	-1,022,220.00	-14,940.00	-
IF1709	IF1709	-7	-7,018,200.00	-96,300.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-165,440.00
股指期货投资本期收益(元)					-194,940.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-154,880.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示,单位为手。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态测算与调算,并进行适时适度调整。同时,结合各个月份期货合约之间的价差关系,在当时以及将来时段,在各个月份期货合约之间进行动态配置,通过空头部分的优化创造额外收益。随着监管的放开及其他上具流动性增强,我们会优选空头工具,采用最优的多头系统性风险剥离方式。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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未出现本期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股票中,没有投资于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	4,047,385.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,461.27
5	应收申购款	440,003.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,489,850.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	大成绝对收益混合发起A	大成绝对收益混合发起C
报告期期初基金份额总额	32,078,594.64	8,560,832.21
报告期期间基金总申购份额	41,692.20	40,963,741.52
减:报告期期间基金总赎回份额	2,757,800.66	43,377,287.40
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	29,362,486.18	6,137,286.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

	大成绝对收益混合发起A	大成绝对收益混合发起C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,777.95	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,777.95	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	28.17	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,777.95	28.17	10,001,777.95	28.17	3年
基金管理人高级管理人员	-	0.00	-	0.00	-
基金经理等人员	1,000.62	0.00	-	0.00	-
基金管理人股东	-	0.00	-	0.00	-
其他	-	0.00	-	0.00	-
合计	10,002,778.57	28.18	10,001,777.95	28.17	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20170101-20170331	10,001,777.95	-	-	10,001,777.95