大成现金增利货币市场基金

【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	大成现金增利货币
交易代码	090022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月20日
报告期末基金份额总额	2,139,298,190.83份
投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下,争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法, 对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

§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)	
	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
1. 本期已实现收益	18,712,684.22	1,015,710.76
2. 本期利润	18,712,684.22	1,015,710.76
3. 期末基金资产净值	2,073,843,113.19	65,455,077.64

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

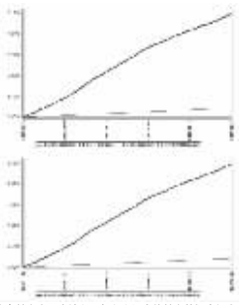
大成现金增利货币A

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8087%	0.0005%	0.0863%	0.0000%	0.7224%	0.0005%

大成现金增利货币B

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9685%	0.0005%	0.0863%	0.0000%	0.7822%	0.0005%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
张文平先生	本基金基金经理	2016年9月6日	-	6年	南京大学管理学硕士,注册会计师,2009年10月至2011年5月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部;2011年起加入大成基金管理有限公司,历任固定收益部助理研究员。2013年11月25日至2015年3月5日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。2015年3月7日至2016年11月18日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015年6月23日起任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月1日至2017年3月18日任长城现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2015年7月1日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015年11月24日起任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月6日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成景安短融债券型证券投资基金和大成现金增利货币市场基金基金经理。2016年9月20日起任大成景辉灵活配置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,即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,但结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

在中央政府稳增长的背景下,一季度经济复苏力度超市场预期,煤炭、有色、工程机械等行业的企业毛利率提升、盈利大幅好转。三四线城市的商品房市场在经历几年的去库存后,复苏的迹象也较为明显,从而带动渠道下沉较好的相关产业链公司(建材、家居、家电等)业绩持续快速增长。与此同时,改革力度也在加大,国企改革、电改、PPP和一带一路均在推进,相关上市公司表现也较为突出。虽然货币政策在一季度出现收紧的迹象,但是在经济复苏趋势确定的背景下,A股市场仍然存在结构性的行情。操作上我们的配置重点仍然在一带一路、PPP、电改和国企改等板块,同时寻找符合产业升级和消费升级的优质标的。

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1.684元;本报告期基金份额净值增长率为-1.06%,业绩比较基准收益率为3.50%。

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	固定收益投资	896,042,817.54	38.60
	其中:债券	896,042,817.54	38.60
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	199,962,819.94	8.61
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,200,330,193.36	51.70
4	其他资产	25,290,044.48	1.09
5	合计	2,321,625,875.32	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.35	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	180,579,169.13	8.44
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过90天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	14.13	8.44
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	14.02	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	61.49	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-120天	13.04	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)-397天(含)	4.67	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		107.34	8.44

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金无平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	115,056,725.73	5.38
	其中:政策性金融债	115,056,725.73	5.38
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	414,813,868.63	19.39
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	366,172,223.18	17.12
8	其他	-	0.00
9	合计	896,042,817.54	41.88
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111710154	17兴业银行CD154	2,000,000	197,854,756.73	9.25
2	011698681	16振华石油SCP005	1,000,000	99,975,544.22	4.67
3	011698465	16平安不动SCP001	800,000	79,992,665.17	3.74
4	011766007	17中电投SCP004	700,000	69,876,591.32	3.27
5	100215	10国开15	650,000	65,049,957.14	3.04
6	160419	16农发19	500,000	50,006,768.59	2.34
7	011698499	16同方SCP004	500,000	49,991,755.68	2.34
8	111710135	17兴业银行CD135	500,000	49,506,677.40	2.31
9	111794863	17盛京银行CD050	500,000	49,451,787.05	2.31
10	111794871	17杭州联合银行CD030	500,000	49,451,690.28	2.31

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(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0222%
报告期内偏离度的最低值	-0.0737%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0376%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期本基金无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期本基金无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提摊销。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	10,926,396.83
4	应收申购款	14,363,647.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	25,290,044.48

5.9.4 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

项目	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
报告期期初基金份额总额	2,691,482,078.41	233,981,084.00
报告期期间基金总申购份额	1,518,149,929.85	313,087,966.33
报告期期间基金总赎回份额	2,135,788,895.07	481,613,972.69
报告期末基金份额总额	2,073,843,113.19	65,455,077.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人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

无。

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,杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议,同意在公司新督察长任职前,由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务,代为履职时间不超过90日。

2、 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现金增利货币市场基金的文件;

2、《大成现金增利货币市场基金基金合同》;

3、《大成现金增利货币市场基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、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

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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

大成消费主题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	大成消费主题混合
交易代码	090016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月25日
报告期末基金份额总额	46,520,163.86份
投资目标	本基金主要投资于消费行业相关的优质上市公司,在严格控制风险的前提下,力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金采用主动投资策略。以宏观经济分析和政策研究为基础,通过分析影响中国证券市场整体运行的内外部因素,实施大类资产配置;分析各个消费子行业在中国经济转型不同阶段行业景气度变化情况和发展趋势,实施行业配置;在各个行业内通过对公司基本面的考量,精选优质上市公司股票,构建投资组合。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数×80%+中证综合债券指数×20%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,风险与收益水平低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

注:根据中国证监会2014 年3月25日下发的《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]179号),大成中证内地消费主题指数证券投资基金自2014年3月25日起变更为大成消费主题股票型证券投资基金,修改基金合同中基金名称、基金类别、投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用等条款,修订后的《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》自2014年3月25日起正式生效。根据中国证监会2014年7月7日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》,自2015年7月3日起本基金名称变更为"大成消费主题混合型证券投资基金";基金简称变更为"大成消费主题混合";基金类别变更为"混合型"。 基金代码保持不变,仍为090016。

§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	1,574,161.54
2.本期利润	149,371.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0031
4.期末基金资产净值	39,355,359.70
5.期末基金份额净值	0.846

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。

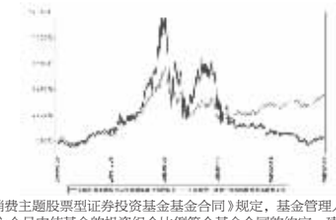
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.36%	0.76%	8.35%	0.59%	-7.99%	0.17%

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:1、按《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》规定, 基金管理人应当自2014 年3月25日(基金合同生效日)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。

2、本基金于2015年7月3日基金名称由大成消费主题股票型证券投资基金变更为大成消费主题混合型证券投资基金。

§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		
张君蘅先生	本基金基金经理	2015年7月3日	2017年1月18日	7年	经济学硕士,2010年7月加入大成基金管理有限公司,历任研究部研究员、基金经理助理。2015年6月24日至2015年7月2日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理,2015年7月3日至2017年1月 18日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理,2016年5月4日至2017年1月18日任大成国家安全主题灵活配置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
侯春燕女士	本基金基金经理	2017年1月18日	-	7年	经济学硕士,2010年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2015年12月9日起担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2017年1月18日起任大成消费主题混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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,即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,但结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

长周期内中国经济的主线是产业升级和消费升级,而经济短周期的波动性在下降。在大制造领域,部分行业和龙头公司在全球范围内都展现出来较强的竞争力,包括电子、工控、安防等。部分企业还在处于国产替代的进程中,包括汽车、医药等。在大消费领域,具有很强品牌力或者产品力的企业仍然较少,一批龙头企业这几年也在加紧修炼内功。本基金重点配置在这两个方向,但一季度所选个股阶段性表现较差,因此跑输比较基准。

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0.846元;本报告期基金份额净值增长率为0.36%,业绩比较基准收益率为8.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内,曾出现了连续60个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§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	35,007,708.21	83.27
	其中:股票	35,007,708.21	83.27
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	6,880,806.86	16.37
8	其他资产	153,592.80	0.37
9	合计	42,042,106.87	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	-	0.00
C	制造业	25,510,421.33	64.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	1,952,951.00	4.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,473,626.88	3.74
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	2,984,597.00	7.58
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	-	0.00
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	3,086,112.00	7.84
S	综合	-	0.00
	合计	35,007,708.21	88.95

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	002563	森马服饰	334,100	3,294,203.00	8.34
2	300144	宋城演艺	158,100	3,086,112.00	7.84
3	300058	蓝色光标	326,900	2,984,597.00	7.58
4	600079	人福医药	129,100	2,548,434.00	6.48
5	002126	银轮股份	258,000	2,311,680.00	5.87
6	300461	田中精机	31,900	2,172,390.00	5.52
7	600998	九州通	100,100	1,952,951.00	4.96
8	603737	XD三棵树	23,443	1,683,441.83	4.28
9	000910	大亚圣象	72,900	1,637,334.00	4.16
10	002311	海大集团	97,900	1,618,287.00	4.11

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债券投资。

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债券投资。

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投资。

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投资。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

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 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,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	60,006.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	916.78
5	应收申购款	92,669.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,592.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	48,341,571.29
报告期期间基金总申购份额	5,117,498.65
减:报告期期间基金总赎回份额	6,938,906.08
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	46,520,163.86

§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

基金管理人本报告期未持有本基金份额

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

无。

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,杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议,同意在公司新督察长任职前,由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务,代为履职时间不超过90日。

2、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中证内地消费主题指数证券投资基金的文件;

2、中国证监会《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》;

3、《大成消费主题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》

4、《大成消费主题混合型证券投资基金基金合同》;

5、《大成消费主题混合型证券投资基金托管协议》;

6、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

7、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

本报告存放在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

大成新锐产业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	大成新锐产业混合
交易代码	090018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月20日
报告期末基金份额总额	56,485,873.57份
投资目标	投资于新锐产业中的优质上市公司,分享中国经济增长新锐力量的成长收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下、自下而上相结合的积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础,通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析,实施大类资产配置;分析中国经济结构转型背景下社会意识(可持续发展观等)、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响,研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景,结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量,实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业的竞争优势进行细致分析(包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面),结合股票基本面指标分析(包括成长性指标、估值水平),精选优质上市公司股票,力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
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

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	1,738,502.20
2.本期利润	-1,319,806.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0204
4.期末基金资产净值	95,132,968.16
5.期末基金份额净值	1.684

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