大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

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1月20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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成睿景灵活配置混合
交易代码	001300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月26日
报告期末基金份额总额	1,644,063,626.35份
投资目标	把握中国经济转型期的成长股投资机会,本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,在控制风险前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析,研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段,综合评价各类资产市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%＋中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金,属于风险水平中高的基金。
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
下属分级基金的基金简称	大成睿景灵活配置混合A / 大成睿景灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001300 / 001301
报告期末下属分级基金的份额总额	1,059,645,088.22份 / 584,418,538.13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10月1日 - 2017年12月31日）	
	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	-9,319,424.53	-5,943,529.40
2. 本期利润	24,519,214.58	11,700,400.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0220	0.0193
4. 期末基金资产净值	839,960,187.24	453,212,293.46
5. 期末基金份额净值	0.793	0.775

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

大成睿景灵活配置混合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	2.72%	1.00%	-3.34%	0.59%	6.06%	0.41%

大成睿景灵活配置混合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	2.51%	1.01%	-3.34%	0.59%	5.85%	0.42%

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。截至本报告期末,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		
李本刚先生	本基金经理、股票投资部总监	2015年9月18日	-	16年	管理学硕士。证券从业年限16年。2001年至2010年先后就职于西南证券股份有限公司、中天村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员。2010年8月加入大成基金管理有限公司,历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012年9月4日至2015年7月1日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理,2015年7月2日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2014年4月16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日起至2015年10月21日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理。2014年5月14日至2015年5月25日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年9月18日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月13日起任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年9月12日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2017年12月20日起担任大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部总监。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

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、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2017年4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股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在5笔同日反向交易,原因为投资策略;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;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

回顾2017年,我们开始逐渐看到经济的新局面,同时也经历了A股市场风格分化的剧烈演绎。在经济增长部分,从2016年中启动的全球经济周期性恢复在2017年延续整年。受益于此,中国出口对中国经济增速提供了较大的正贡献。同时,由于供给侧改革的作用,经济增长率表现相对稳健。这两大因素推高了工业品价格,改善了企业盈利。而我们预计全球经济改善仍可持续,我国经济的外部环境扭转了过去7年的不利情况。去杠杆是2017年经济调控的主线;经过房地产的三年调整,存货去化的较大进展消除了内需乏力、金融风险聚集的这一关键风险因素,其对经济的支持作用预计也将逐步显现。

在企业盈利方面,周期性行业销售利润率改善最为显著,也带动部分中下游行业的企业资产周转率进入上升通道,部分中游企业利润率也开始逐步修复。

而A股市场出现刚烈的风格分化,在周期性恢复的经济背景下,大小企业的基本面出现分化,加上金融去杠杆导致的流动性紧缩,17年A股市场的一九分化现象显著,也较大程度上决定了我们2017年全年的投资决策。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿景灵活配置混合A基金份额净值为0.793元，本报告期基金份额净值增长率为2.72%;截至本报告期末大成睿景灵活配置混合C基金份额净值为0.775元,本报告期基金份额净值增长率为2.51%;同期业绩比较基准收益率为-3.34%。

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	1,168,848,292.72	90.04
	其中:股票	1,168,848,292.72	90.04
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	119,347,052.47	9.19
8	其他资产	9,971,730.47	0.77
9	合计	1,298,167,075.66	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	7,596,963.24	0.59
C	制造业	764,062,652.00	59.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	727,038.89	0.06
E	建筑业	108,362,373.87	8.38
F	批发和零售业	331,049.73	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	376,012.96	0.03
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,593,198.50	2.21
J	金融业	103,961,257.36	8.04
K	房地产业	118,389,588.90	9.15
L	租赁和商务服务业	35,351,332.40	2.73
M	科学研究和技术服务业	260,669.37	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	163,463.13	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	87,393.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	585,298.68	0.05
S	综合	-	0.00
	合计	1,168,848,292.72	90.39

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600477	杭萧钢构	10,135,724	108,148,175.08	8.36
2	600985	雷鸣科化	5,610,792	72,828,080.16	5.63
3	000651	格力电器	1,665,944	72,801,752.80	5.63
4	000858	五粮液	754,936	60,304,287.68	4.66
5	600196	复星医药	1,232,800	54,859,600.00	4.24
6	601939	建设银行	7,066,700	54,272,256.00	4.20
7	000402	金融街	4,736,313	52,620,437.43	4.07
8	603008	喜临门	2,792,520	51,633,694.80	3.99
9	000786	北新建材	2,218,120	49,907,700.00	3.86
10	002244	滨江集团	6,256,347	49,737,958.65	3.85

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。

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。

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

本基金本报告期未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险,如预期大额申购赎回、大量分红等。

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 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	1,118,118.88
2	应收证券清算款	8,771,696.70
3	应收股利	-
4	应收利息	25,848.31
5	应收申购款	56,066.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,971,730.47

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

项目	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	1,200,851,094.22	626,786,153.26
报告期期间基金总申购份额	2,700,531.43	7,942,368.01
减:报告期期间基金总赎回份额	143,906,537.43	50,309,983.14
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	1,059,645,088.22	584,418,538.13

§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内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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§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睿景灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2、《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

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

本定期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
2018年1月20日

大成现金宝场内实时申赎货币市场基金

2017年第四季度报告

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1月20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2018年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成现金宝货币
交易代码	519898
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月27日
报告期末基金份额总额	56,941,108,594.00份
投资目标	安全性和流动性优先,在此基础上追求适度收益。
投资策略	本基金通过结构化投资策略、分散化投资策略、利率趋势评估策略、滚动配置策略和相对价值评估策略多个层次进行投资管理,以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
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
下属分级基金的基金简称	现金宝A / 现金宝B
下属分级基金的交易代码	519898 / 519899
报告期末下属分级基金的份额总额	37,795,434,616.00份 / 19,145,673,978.00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10月1日 - 2017年12月31日）	
	现金宝A	现金宝B
1. 本期已实现收益	3,775,959.58	2,187,860.64
2. 本期利润	3,775,959.58	2,187,860.64
3. 期末基金资产净值	377,954,346.16	191,456,739.78

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

现金宝A

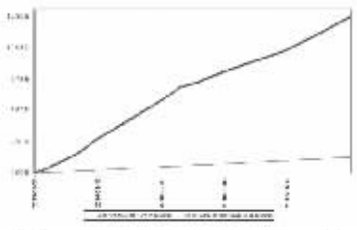
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8476%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7594%	0.0008%

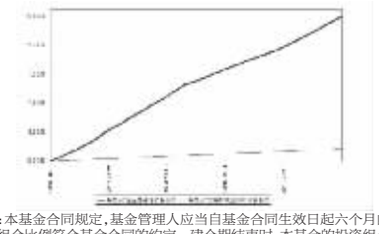
现金宝B

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	0.9979%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.9097%	0.0008%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

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		
朱哲先生	本基金基金经理	2016年8月29日	-	7年	中国社会科学院工商管理硕士，中国人民大学经济学学士,拥有7年固定收益市场从业经验,6年证券市场从业经验。2009年7月至2010年9月任中国银行金融市场总部助理投资经理。2010年10月至2013年5月任嘉实基金交易部交易员,2013年5月至2015年7月任银华基金固定收益部基金经理。2015年8月加入大成基金管理有限公司,任固定收益总部基金经理。2016年8月29日起担任大成货币市场证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金和大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年10月12日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。具备基金从业资格。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

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、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2017年4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股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在5笔同日反向交易,原因为投资策略;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;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

四季度全球经济出现共振向上的态势,欧美日数据屡创近几年以来新高。同时,国内经济数据也表现出很强的韧性,市场预期的经济下行再次落空。资金方面,整个四季度资金面都不宽松,特别是年底市场资金面紧张程度创近3年之最。债券市场从国庆后便开始下跌,但是信用利差依旧维持在低位。

本组合在做好流动性管理基础上,灵活调整组合比例和结构,及时缩短组合久期,抓住有利时机建仓,提高组合静态收益,为持有人创造了一定的持有期回报。同时注重风险控制,保证了组合的安全。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期现金宝A的基金份额净值收益率为0.8476%，本报告期现金宝B的基金份额净值收益率为0.9979%,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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	129,744,115.07	22.07
	其中:债券	129,744,115.07	22.07
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	33,954,145.43	5.78
	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	401,229,864.28	68.25
4	其他资产	22,983,328.90	3.91
5	合计	587,911,453.68	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	1.40	
	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	-	0.00
	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

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

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	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

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120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	17.49	1.40
	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	13.87	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	60.81	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	0.00	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）	7.11	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		99.28	1.40

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

本基金本报告期内未发生投资组合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	14,996,414.68	2.63
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	19,996,316.62	3.51
	其中:政策性金融债	19,996,316.62	3.51
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	25,501,702.75	4.48
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	69,249,681.02	12.16
8	其他	-	0.00
9	合计	129,744,115.07	22.79
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	111709506	17浦发银行CD506	700,000	69,249,681.02	12.16
2	011758075	17华电股SCP001	225,000	22,502,123.77	3.95
3	120326	12进出26	200,000	19,996,316.62	3.51
4	170009	17附息国债09	150,000	14,996,414.68	2.63
5	011751076	17联通SCP006	30,000	2,999,578.98	0.53

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	0.0023%
报告期内偏离度的最低值	-0.0128%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0040%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内均未达到负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内均未达到正偏离度的绝对值达到0.5%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损益。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0.01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	394,819.76
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,000,824.47
4	应收申购款	19,587,684.67
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,983,328.90

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	现金宝A	现金宝B
报告期期初基金份额总额	43,426,962,352.00	24,285,002,815.00
报告期期间基金总申购份额	109,942,393,333.00	13,517,544,137.00
报告期期间基金总赎回份额	115,573,921,069.00	18,656,872,974.00
报告期期末基金份额总额	37,795,434,616.00	19,145,673,978.00

§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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§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宝场内实时申赎货币市场基金的文件;

2、《大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》;

3、《大成现金宝场内实时申赎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

备查文件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
2018年1月20日

大成现金增利货币市场基金

2017年第四季度报告

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1月20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2018年1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10月1日起至12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	2,315,059,217.21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
下属分级基金的基金简称	大成现金增利货币A / 大成现金增利货币B
下属分级基金的交易代码	090022 / 091022
报告期末下属分级基金的份额总额	2,065,064,168.20份 / 249,995,049.01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10月1日 - 2017年12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	20,300,178.12	2,128,498.32
2. 本期利润	20,300,178.12	2,128,498.32
3. 期末基金资产净值	2,065,064,168.20	249,995,049.01

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