

大成多策略灵活配置混合型  
证券投资基金（LOF）  
（原大成定增灵活配置混合型  
证券投资基金转型）  
2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 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。

基金管理人于 2018 年 8 月 16 日发布了《关于大成定增灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）及基金名称变更的公告》，自 2018 年 8 月 18 日起，大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外基金简称变更为“大成多策略混合（LOF）”，场内基金简称变更为“多策略”，基金代码不变，基金代码为“160921”。

大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等条款，相应适用于基金合同中本基金转换为上市开放式（LOF）后的有关约定，详见基金合同。

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 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	大成多策略混合（LOF）
场内简称	多策略
基金主代码	160921
交易代码	160921
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 18 日
报告期末基金份额总额	848,422,069.01 份
投资目标	基金管理人在控制风险和保持资产流动性的基础上，主要采用多策略投资于股票，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究，结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。

业绩比较基准	沪深 300 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	中国银行股份有限公司

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	大成定增灵活配置混合
场内简称	大成定增
基金主代码	160921
交易代码	160921
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 19 日
报告期末基金份额总额	1,005,709,840.88 份
投资目标	在封闭期内，本基金主要参与上市公司股票定向增发，基金管理人在控制风险的前提下，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究，结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深 300 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	中国银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 8 月 18 日 - 2018 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-18,743,544.97
2. 本期利润	-1,457,074.21
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0017
4. 期末基金资产净值	699,778,501.74
5. 期末基金份额净值	0.825

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。

### 3.1 主要财务指标 (转型前)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年8月17日)
1. 本期已实现收益	-105,244,068.26
2. 本期利润	-81,139,496.47
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0807
4. 期末基金资产净值	831,088,669.64
5. 期末基金份额净值	0.826

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。

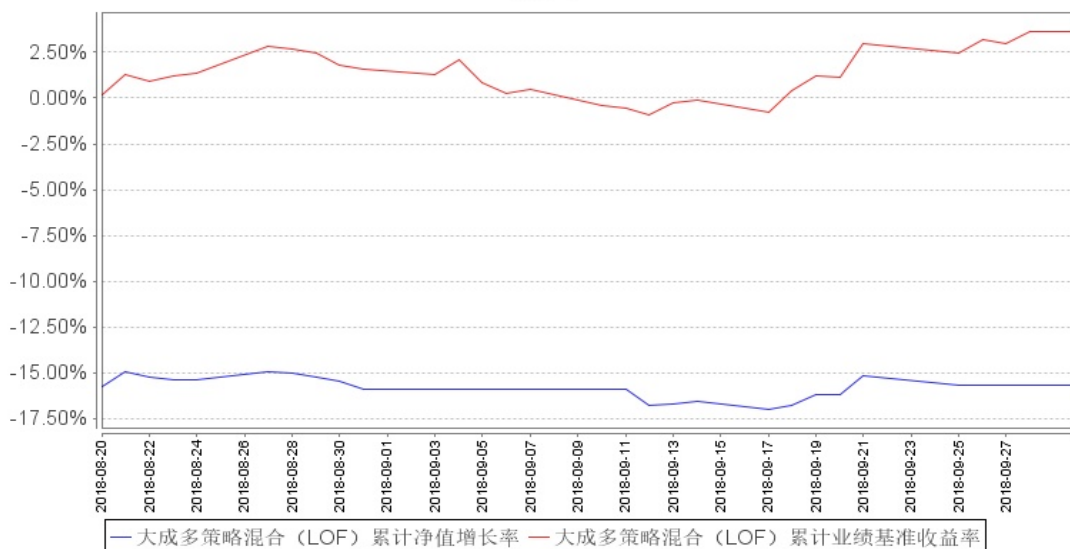
### 3.2 基金净值表现 (转型后)

#### 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
自基金合同 生效起至今	-0.12%	0.45%	4.13%	0.72%	-4.25%	-0.27%

#### 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

大成多策略混合 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金自 2018 年 8 月 18 日起，由大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，截至报告期末本基金转型未满一年。

2. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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	-8.93%	0.79%	-4.46%	0.88%	-4.47%	-0.09%

#### 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

大成定增累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，截至本基金转型前，本基金投资顺丰控股（002352）因定增股票估值方式变更，导致单个股票的投资比例被动超标。除此之外，报告期内本基金的其他各项投资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（转型后）

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		
戴军	本基金基金经理, 研究部副总监	2016 年 8 月 19 日	-	7 年	金融学硕士。2011 年 6 月加入大成基金管理有限公司, 历任研究员、行业研究主管、大成价值增长基金经理助理, 2015 年 5 月 21 日起任大成优选混合型证券投资基金（LOF）（更名前为大成优选股票型证券投资基金）基金经理。2016 年 8 月 19 日起任大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（更名前为大成定增灵活配置混合型证券投资基金）。2017 年 6 月 2 日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任研究部副总监。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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
戴军	本基金基金经理，研究部副总监	2016 年 8 月 19 日	-	7 年	金融学硕士。2011 年 6 月加入大成基金管理有限公司，历任研究员、行业研究主管、大成价值增长基金经理助理。2015 年 5 月 21 日起任大成优选混合型证券投资基金（LOF）（更名前为大成优选股票型证券投资基金）基金经理。2016 年 8 月 19 日至 2018 年 8 月 17 日任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。。2017 年 6 月 2 日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 18 日任大成多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任研究部副总监。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。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股当日成交量 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



经过 2 年的封闭期，大成定增在 8 月中下旬转为开放式基金，同时变更名称为大成多策略。考虑到流动性的需求，本基金管理人按照契约规定逐步减持了定增到期的股票，同时尝试了大宗交易的方式来应对锁定期的延长。过去一个季度，市场在外部不确定性加强的情况下仍处于持续调整中，本基金管理人降低了投资组合中股票的仓位，等待观察更有利于实现较好收益的窗口期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本基金转型前，本基金份额净值为 0.826，基金份额净值增长率为-8.93%，业绩比较基准收益率为-4.46%；转型后至本报告期末，本基金份额净值为 0.825 元，基金份额净值增长率为-0.12%，业绩比较基准收益率为 4.13%。

#### 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（转型后）

#### 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	232,575,055.83	32.77
	其中：股票	232,575,055.83	32.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	476,779,458.40	67.17
8	其他资产	433,997.34	0.06
9	合计	709,788,511.57	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	-	-
B	采矿业	10,053.44	0.00
C	制造业	111,261,422.47	15.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,946,237.74	0.99
E	建筑业	108,232.20	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	68,533,814.55	9.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,838.96	0.00
K	房地产业	29,292,640.86	4.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,420,815.61	2.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	232,575,055.83	33.24

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股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	002352	顺丰控股	1,654,973	68,302,391.21	9.76
2	000513	丽珠集团	1,014,000	34,354,320.00	4.91
3	002146	荣盛发展	3,670,757	29,292,640.86	4.19
4	600535	天士力	1,152,620	26,371,945.60	3.77
5	601689	拓普集团	1,203,600	18,597,933.20	2.66
6	000035	中国天楹	3,863,715	16,420,815.61	2.35
7	603788	宁波高发	515,027	9,764,911.92	1.40
8	601138	工业富联	704,381	8,891,416.90	1.27
9	002705	新宝股份	1,038,287	7,589,877.97	1.08
10	001896	豫能控股	2,150,538	6,946,237.74	0.99

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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 本期国债期货投资评价

无。

## 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是否出现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。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	271,522.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	86,007.64
5	应收申购款	76,467.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	433,997.34

### 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

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	002352	顺丰控股	46,047,190.37	6.58	非公开发行 流通受限
2	601689	拓普集团	17,660,535.20	2.52	非公开发行 流通受限
3	000035	中国天楹	16,420,453.00	2.35	非公开发行 流通受限
4	601138	工业富联	8,872,705.54	1.27	非公开发行 流通受限
5	001896	豫能控股	6,946,237.74	0.99	非公开发行 流通受限

### 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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 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	251,349,342.63	30.20

	其中：股票	251,349,342.63	30.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	580,535,688.99	69.75
8	其他资产	435,540.88	0.05
9	合计	832,320,572.50	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	-	-
B	采矿业	8,937.96	0.00
C	制造业	138,887,374.05	16.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,924,732.36	0.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	90,960,412.93	10.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,656.08	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,566,229.25	1.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	251,349,342.63	30.24

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股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	002352	顺丰控股	2,273,373	90,730,315.37	10.92
2	000513	丽珠集团	1,014,000	38,177,100.00	4.59
3	002126	银轮股份	4,554,737	31,653,101.29	3.81
4	603788	宁波高发	1,454,167	24,400,922.84	2.94
5	601689	拓普集团	1,203,600	19,408,322.04	2.34
6	000035	中国天楹	3,863,715	14,566,229.25	1.75
7	002705	新宝股份	1,341,787	11,700,382.64	1.41
8	601138	工业富联	704,381	9,123,941.47	1.10
9	001896	豫能控股	2,150,538	6,924,732.36	0.83
10	002250	联化科技	479,699	3,458,629.79	0.42

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 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 本期国债期货投资评价

无。

## 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是否出现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。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	41,348.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	394,192.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	435,540.88

### 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

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	002352	顺丰控股	90,730,315.37	10.92	非公开发行 流通受限
2	000513	丽珠集团	38,177,100.00	4.59	非公开发行 流通受限
3	002126	银轮股份	30,381,244.74	3.66	非公开发行 流通受限
4	601689	拓普集团	18,428,883.16	2.22	非公开发行 流通受限
5	000035	中国天楹	14,565,907.72	1.75	非公开发行 流通受限
6	603788	宁波高发	11,778,744.60	1.42	非公开发行 流通受限
7	601138	工业富联	9,104,717.65	1.10	非公开发行 流通受限
8	001896	豫能控股	6,924,732.36	0.83	非公开发行 流通受限
9	002250	联化科技	3,458,629.79	0.42	非公开发行 流通受限

#### 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 (转型后)

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 8 月 18 日) 持有的基金份额	1,005,709,840.88
报告期期间基金总申购份额	600,097.31
减：报告期期间基金总赎回份额	157,887,869.18
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	848,422,069.01

### § 6 开放式基金份额变动 (转型前)

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,005,709,840.88
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,005,709,840.88



## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 (转型后)

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 (转型前)

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息 (转型后)

### 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	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	20180818-20180930	400,017,000.00	0.00	0.00	400,017,000.00	47.15
个人	-	-	-	-	-	-	-
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

无。

## 影响投资者决策的其他重要信息 (转型前)

## 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	20180701-20180817	400,017,000.00	0.00	0.00	400,017,000.00	39.77
个人	-	-	-	-	-	-	-

**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。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成定增灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《关于大成定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）及基金名称变更的提示性公告》；
- 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。

### 10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 10.3 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 10 月 25 日