大成月添利理财债券型证券投资基金

2018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：2019年1月19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2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成月添利理财债券		
基金主代码	090021		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年9月20日		
报告期末基金份额总额	14,263,568,832.57份		
投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四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	七天通知存款税后利率。		
风险收益特征	本基金为债券型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
下属分级基金的交易代码	090021	091021	001497
报告期末下属分级基金的份额总额	189,854,088.69份	14,053,448,932.74份	20,265,811.14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2018年10月1日－2018年12月31日		
	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
1.本期已实现收益	1,104,621.39	119,213,548.09	156,858.89
2.本期利润	1,104,621.39	119,213,548.09	156,858.89
3.期末基金资产净值	189,854,088.69	14,053,448,932.74	20,265,811.14

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

大成月添利债券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	0.7897%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.4494%	0.0006%

大成月添利债券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	0.8630%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.5227%	0.0006%

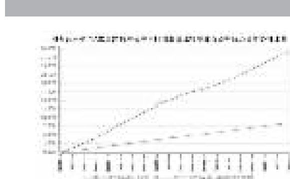
大成月添利债券E

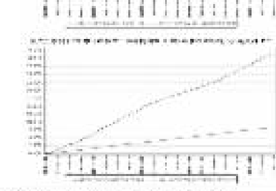
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7894%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.4491%	0.0006%

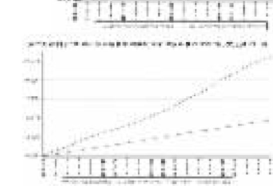
注：1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

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：1、本基金于2015年6月16日起增加E类份额。

2、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		
陈会荣	本基金基金经理	2017年3月22日	－	11年	经济学学士。2007年10月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部基金经理。2016年8月6日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理，2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月22日起担任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利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。2018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不存在同日反向交易；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

2018年四季度，市场对于经济增速的趋缓已经形成了一致预期，在看到融资增速明显改善之前，不会出现明显的收紧，央行为促进社融增速的提高，维持了货币流动性的充裕，年末等时点因素对资金面形成了短期扰动。纵观四季度，隔夜回购利率均值约为2.31%，较上季度下降4BP，14天回购加权利率均值约为3.05%，较上季度上升了9BP。1年期金融债收益率下行约33bp，1年AAA短期融资券下行约10bp，1年AA+短融品种下行约14bp。

本基金将以流动性为第一前提，根据组合特点在合理期限范围内配置组合资产，努力提高组合静态收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月添利债券A基金份额净值收益率为0.7897%，本报告期大成月添利债券B基金份额净值收益率为0.8630%，本报告期大成月添利债券E基金份额净值收益率为0.7894%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	6,504,249,265.86	37.57
	其中：债券	6,504,249,265.86	37.57
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	10,729,802,533.96	61.98
4	其他资产	78,537,859.31	0.45
5	合计	17,312,589,659.13	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		9.79
	其中：买断式回购融资		－
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,018,271,392.58	21.16
	其中：买断式回购融资	－	－

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定："本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"。本报告期内，本基金未发生超标情况。

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	137
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	140
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

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150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	0.22	21.16
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天（含）—60天	0.70	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天（含）—90天	45.56	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天（含）—120天	4.55	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	120天（含）—397天（含）	69.80	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
	合计	120.83	21.16

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

无。

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	5,992,891.50	0.04
2	央行票据	－	－
3	金融债券	760,128,680.20	5.33
	其中：政策性金融债	760,128,680.20	5.33
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	同业存单	5,738,127,694.16	40.23
8	其他	－	－
9	合计	6,504,249,265.86	45.60
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

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	111872114	18徽商银行CD200	5,000,000	491,988,202.88	3.45
2	180407	18农发07	4,170,000	418,547,419.65	2.93
3	111821294	18渤海银行CD294	3,000,000	298,139,067.24	2.09
4	111872183	18徽商银行CD205	3,000,000	297,746,878.52	2.09
5	111819458	18恒丰银行CD458	2,500,000	246,796,298.67	1.73
6	111821279	18渤海银行CD279	2,400,000	236,639,293.78	1.66
7	140422	14农发22	2,200,000	221,214,824.85	1.55
8	111819509	18恒丰银行CD509	2,000,000	198,627,479.45	1.39
9	111809276	18浦发银行CD276	2,000,000	198,624,032.15	1.39
10	111884252	18南京银行CD107	2,000,000	197,065,753.74	1.38

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	0.0297%
报告期内偏离度的最低值	-0.0250%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0190%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

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十名资产支持证券投资明细

无。

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、处罚的情形。

1、本基金投资的前十名证券之一18渤海银行CD294（111821294.IB）的发行主体渤海银行股份有限公司于2018年11月9日因理财及自营投资资金违规用于缴交土地款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）9号）。本基金认为，对渤海银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一18渤海银行CD279（111821279.IB）的发行主体渤海银行股份有限公司于2018年11月9日因理财及自营投资资金违规用于缴交土地款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）9号）。本基金认为，对渤海银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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	78,537,859.31
4	应收申购款	－
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	78,537,859.31

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	大成月添利债券A	大成月添利债券B	大成月添利债券E
报告期期初基金份额总额	136,948,971.96	14,289,815,000.96	21,286,012.64
报告期期间基金总申购份额	117,161,487.04	2,317,103,327.94	7,773,897.16
报告期期间基金总赎回份额	64,256,370.31	2,553,469,396.16	8,794,098.66
报告期期末基金份额总额	189,854,088.69	14,053,448,932.74	20,265,811.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利发放	2018-12-24	643,605.00	643,605.00	－
合计			643,605.00	643,605.00	

注：红利发放为期间合计数。本基金为短期理财基金，故申购、赎回费率均为0.00%。

§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	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（%）	
1	20181001-20181231	3,529,765,165.65	31,184,514.62	－	3,560,949,680.27	24.97	
2	20181001-20181231	3,082,886,574.86	26,642,479.96	－	3,109,529,054.82	21.80	
－	－	－	－	－	－	－	

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。

§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月添利理财债券型证券投资基金的文件；

2、《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》；

3、《大成月添利理财债券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

本季度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
2019年1月19日

大成债券投资基金

2018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：2019年1月19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2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成债券	
基金主代码	090002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年6月12日	
报告期末基金份额总额	1,960,917,416.59份	
投资目标	在力保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定增值	
投资策略	通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理，以实现投资目标。类属资产部分按照修正的均值－方差模型在交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间实行最优配置。	
业绩比较基准	中国债券总指数	
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。	
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	大成债券A/B	大成债券C
下属分级基金的交易代码	090002	092002
下属分级基金的前端交易代码	090002	－
下属分级基金的后端交易代码	091002	－
报告期末下属分级基金的份额总额	1,427,020,878.30份	533,896,538.29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(2018年10月1日－2018年12月31日)	
1.本期已实现收益	7,526,121.06	3,027,899.51
2.本期利润	10,664,179.14	4,602,697.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0150	0.0155
4.期末基金资产净值	1,574,639,526.00	591,845,461.46
5.期末基金份额净值	1.1034	1.1085

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

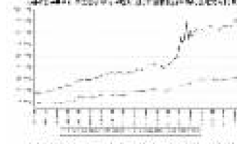
大成债券A/B

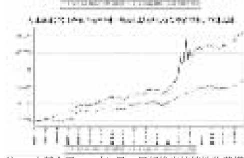
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.44%	0.06%	3.43%	0.09%	-1.99%	-0.03%

大成债券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	1.37%	0.06%	3.43%	0.09%	-2.06%	-0.03%

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、本基金于2006年4月24日起推出持续性收费模式，将前端收费模式定义为A类收费模式，后端收费模式定义为B类收费模式，二者对应的基金份额简称"大成债券A/B"；将持续性收费模式定义为C类收费模式，对应的基金份额简称"大成债券C"。

2、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		
王立	本基金基金经理，固定收益总部总监	2009年5月23日	－	16年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司，曾任大成货币市场基金基金经理助理。2007年1月12日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009年5月23日起任大成债券投资基金基金经理。2012年11月20日至2014年4月4日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年2月1日至2015年5月25日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013年7月23日至2015年5月25日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日至2016年11月23日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年2月3日至2018年4月2日任大成慧成货币市场基金基金经理。现任固定收益总部总监。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。2018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不存在同日反向交易；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

2018年4季度，经济下行压力进一步增大，针对民营企业的"三支箭"收效仍需时间，短期信用收缩仍然没有得到根本缓解，社融增速仍处于下行通道中，表内信贷平稳，表外融资继续收缩；此外，三季度的抢出口效应消退后，从11月开始出口增速快速滑落，而房地产销售四季度也出现了持续的负增长，房地产产业链进入下行阶段，这都预示着经济仍然处于寻底阶段。货币政策方面，由于经济和融资仍然没有根本性好转，因此维持相对宽松的货币政策仍然是必要的，此外监管机构努力改善民营企业融资环境，但实际效果有待进一步观察。通胀方面，4季度的通胀预期显著回落，CPI整体保持稳定，PPI回落明显，特别是在油价大幅回落，环保限产放松，以及较高的基数下，市场对于PPI通缩的担忧又起。

由于信用收缩没有根本改善，叠加三季度通胀预期转变为通缩预期，再加上4季度地方债的供给压力较小，因此市场收益率下行明显，10年国开债收益率4季度下行56BP，是2018年收益率下行幅度最大的一个季度。具体到市场指数方面，4季度中债综合指数上涨2.67%，中债金融债券总指数上涨3.13%，中债信用债总指数上涨1.92%。权益方面，4季度股债跷跷板仍然存在，股市继续下行没有根本性好转，上证综指下跌11.61%，深圳成指下跌13.82%，创业板指下跌11.39%，中证转债指数下跌1.62%。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。2018年4季度本基金主动管理组合大类资产配置，积极持有长久期利率债，同时我们严控信用风险，增持高等级信用债。转债投资则控制在5%以内的小仓位，精选个券，控制波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成债券A/B基金份额净值为1.1034元，本报告期基金份额净值增长率为1.44%，截至本报告期末大成债券C基金份额净值为1.1085元，本报告期基金份额净值增长率为1.37%，同期业绩比较基准收益率为3.43%。

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	3,097,212.48	0.14
	其中：股票	3,097,212.48	0.14
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	1,651,636,684.87	74.99
	其中：债券	1,651,636,684.87	74.99
	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	340,117,270.18	15.44
	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	7,155,631.64	0.32
8	其他资产	200,571,075.53	9.11
9	合计	2,202,577,874.70	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	－	－
C	制造业	－	－
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	－	－
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	3,097,212.48	0.14
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	－	－
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	3,097,212.48	0.14

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	601128	常熟银行	504,432	3,097,212.48	0.14

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	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	482,753,406.80	22.28
	其中：政策性金融债	482,753,406.80	22.28
4	企业债券	364,051,630.80	16.80
5	企业短期融资券	260,671,000.00	12.03
6	中期票据	466,460,000.00	21.53
7	可转债（可交换债）	58,420,647.27	2.70
8	同业存单	19,280,000.00	0.89
9	其他	－	－
10	合计	1,651,636,684.87	76.24

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	180205	18国开05	2,100,000	228,816,000.00	10.56
2	160215	16国开15	600,000	59,856,000.00	2.76
3	101801323	18国新控股MTN003	500,000	50,260,000.00	2.32
4	101800581	18保利房产MTN002	400,000	41,084,000.00	1.90
5	170209	17国开09	400,000	40,620,000.00	1.87

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、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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	16,670.33
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	34,242,329.97
5	应收申购款	166,312,075.23
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	200,571,075.53

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	132005	15国资EB	6,706,540.00	0.31
2	113011	光大转债	5,256,000.00	0.24
3	123006	东财转债	4,639,600.00	0.21
4	128027	崇达转债	3,603,283.45	0.17
5	110043	无锡转债	2,907,300.00	0.13
6	113015	隆基转债	2,803,977.80	0.13
7	113504	艾华转债	2,702,960.00	0.12
8	110032	三一转债	2,622,840.00	0.12
9	113014	林洋转债	2,358,061.20	0.11
10	128016	雨虹转债	1,980,000.00	0.09
11	132004	15国盛EB	1,935,400.00	0.09
12	132013	17宝武EB	1,414,316.80	0.07
13	113507	天马转债	1,115,623.90	0.05
14	110038	济川转债	1,058,500.00	0.05
15	128035	大族转债	1,012,441.22	0.05
16	110041	蒙电转债	777,675.60	0.04
17	128015	久其转债	572,140.80	0.03
18	113019	玲珑转债	497,500.00	0.02
19	110040	生益转债	205,920.00	0.01
20	110034	九州转债	202,480.00	0.01
21	113508	新凤转债	192,680.00	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	大成债券A/B	大成债券C
报告期期初基金份额总额	400,519,589.65	279,367,007.24
报告期期间基金总申购份额	1,136,050,703.27	429,848,638.09
减：报告期期间基金总赎回份额	109,549,414.62	175,319,107.04
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	1,427,020,878.30	533,896,538.29

§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

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

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

无。

§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债券投资基金的文件；

2、《大成债券投资基金基金合同》；

3、《大成债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
2019年1月19日

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金

2018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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2019年1月19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2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成中证100ETF
场内简称	100ETF
基金主代码	159923
交易代码	159923
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月7日
报告期末基金份额总额	25,285,812.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证100指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月1日－2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-692,295.47
2.本期利润	-4,960,384.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1962
4.期末基金资产净值	33,195,106.18
5.期末基金份额净值	1.313

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

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	-12.99%	1.59%	-12.50%	1.61%	-0.49%	-0.02%

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有关约定。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		
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监	2013年2月7日	－	14年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2018年6月26日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。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。2018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不存在同日反向交易；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，宏观经济也逐渐步入寒冬，内外矛盾重重。中美贸易摩擦固然构成了一定的冲击，然而，国内经济更深层次的症结还是在于内在运行机制存在弊端。尽管政府陆续公布经济刺激政策，货币环境也保持宽松，但政策生效尚需时日，货币传导也不甚通畅，民间信用扩张意愿较弱，流动性并未有效流入实体经济。同时，四季度海外证券市场以及大宗商品价格均大幅下行，加剧了全球经济景气周期下行的预期。

本季度股票市场震荡剧烈，季初便在诸多因素的共同作用下急速下跌，之后监管层及时应对救市，股市随之急剧反弹，之后又再缓步下行至年底。本季度市场基准沪深300指数大幅下跌12.45%，个股表现产生一定的分化。市值因子依然是区分度最为显著的因子，大部分市值较小的股票在季初下跌时实现了局部出清，在之后的超跌反弹行情中也涨幅较高，而大盘蓝筹则在季末因为行业利空消息的缘故表现较差。在行业方面，受经济周期影响较小的农林牧渔、综合等板块表现较好，而强周期行业如钢铁、煤炭等行业则表现不佳，医药行业因为带量采购的影响也跌幅较深。

本基金标的指数中证100指数下跌12.50%，跌幅略高于大盘。四季度，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。本季年化跟踪误差0.61%，日均偏离度0.03%，各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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1.313元；本报告期基金份额净值增长率为-12.99%，业绩比较基准收益率为-12.50%。

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	32,875,595.38	98.53
	其中：股票	32,875,595.38	98.53
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	489,417.00	1.47
8	其他资产	316.80	0.00
9	合计	33,365,329.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,204,902.37	3.63
C	制造业	10,364,690.60	31.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	945,941.36	2.85
E	建筑业	1,468,598.13	4.42
F	批发和零售业	340,033.85	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	933,386.38	2.81
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	510,634.17	1.54
J	金融业	14,738,749.64	44.40
K	房地产业	1,675,052.18	5.05
L	租赁和商务服务业	472,665.44	1.42
M	科学研究和技术服务业	104,804.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	－	－
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	32,759,458.12	98.69

5.2.2 报告期末积极投资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	－	－
C	制造业	116,137.26	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	－	－
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	－	－
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	－	－
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	116,137.26	0.35

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	55,088	3,090,436.80	9.31
2	600519	贵州茅台	2,605	1,536,976.05	4.63
3	600036	招商银行	55,161	1,390,057.20	4.19
4	601166	兴业银行	66,678	996,169.32	3.00
5	601328	交通银行	165,485	958,158.15	2.89
6	000651	格力电器	24,484	873,833.96	2.63
7	000333	美的集团	23,617	870,522.62	2.62
8	601288	农业银行	230,733	830,638.80	2.50
9	600016	民生银行	132,746	760,634.58	2.29
10	600887	伊利股份	30,942	707,952.96	2.13

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600485	信威集团	13,473	116,137.26	0.35

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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、处罚的情形。

1、本基金投资的前十名证券之一兴业银行（601166.SH）的发行主体兴业银行股份有限公司于2018年4月19日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）1号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2、本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328.SH）的发行主体交通银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018）1号），于2018年11月9日因不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）12号、银保监银罚决字（2018）13号）。交通银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

3、本基金投资的前十名证券之一招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行业监督管理委员会处罚（银监罚决字（2018）1号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

4、本基金投资的前十名证券之一民生银行（600016.SH）的发行主体中国民生银行股份有限公司于2018年11月9日因贷款业务严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）5号、银保监银罚决字（2018）8号）。民生银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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。

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	218.60
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	98.20
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	316.80

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	600485	信威集团	116,137.26	0.35	重大事项

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	25,285,812.00
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	25,285,812.00

§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

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

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

无。

§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100交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成中证100交易型开放式指数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

本季度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
2019年1月19日