

大成恒生指数证券投资基金(LOF)

2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年03月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、董监高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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告公告经三分之一以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

本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2019年3月28日复核了本基金报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，确认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。

本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及其更新。

本基金年度报告摘要经摘要报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。请投资者注意阅读。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成恒生指数LOF-LOF
场内简称	恒指LOF
基金代码	160024
交易代码	160024
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2017年01月01日

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

报告期末基金份额总额 27,154,433.07份

基金合同存续期 不定期

基金合同终止的原由 上市规则的终止

基金合同终止的日期 深圳证券交易所

上市日期 2017年08月20日

交易场所 深圳证券交易所

2.2 基金产品说明

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 本基金在严格遵守基金合同约定的资产配置比例及授权基金经理投资决策组合，开闸和适时地调整其持有的组合比例及组合的构成，但不因此而改变其投资风格。但因特殊情况下(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律限制的限制无法投资该股票时，基金经理将根据基金合同约定的指数投资组合比例调整基金资产组合，达到预期的被动式指数化投资目标。

业绩比较基准 创始期收益率×90%+人民币存款利率(税后)×5%

风险收益特征 本基金为股票基金，其长期平均风险和预期收益水平高于货币基金、债券基金及货币市场基金。本基金为指数基金，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同的风格和风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 大成基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

姓名 赵峰 郭明

信息披露义务人 0755-33183388 010-66105799

电子邮箱 office@fundchina.com custody@icbc.com

客户服务电话 4000885656 95588

传真 0755-82199688 010-66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

无。

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 www.dcfund.com.cn

基金年度报告备置地点 基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据	2018年		2017年08月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	年初至报告期期末	报告期	年初至报告期期末	报告期
本期实现收益	14,203,494.06		763,641.44	
本期利润	1,427,364.17		12,102,432.43	
加权平均基金份额本期利润	0.0384		0.0463	
本期基金份额净值增长率	-9.73%		4.80%	
3.1.2 期末数据	2018年末	2017年末		
期末基金资产净值	25,688,139.76		210,924,022.87	
期末基金份额净值	0.946		1.048	

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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期初公允价值变动收益。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于不计费用的水平。

3.基金净值表现

3.2.1 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

金额单位:人民币元

阶段	申购(赎回)费率		赎回(转换)费率		申购(赎回)基准收益率	赎回(转换)基准收益率	①-③	②-④
	申购(赎回)金额	申购(赎回)金额	赎回(转换)金额	赎回(转换)金额				
过去三个月	-7.80%	1.49%	-6.62%	1.55%	-1.18%	-0.10%		
过去六个月	-7.16%	1.21%	-10.18%	1.27%	-3.02%	-0.06%		
过去一年	-7.23%	1.18%	-12.88%	1.22%	-3.16%	-0.04%		
自基金合同生效之日起至今	-5.40%	1.06%	-6.43%	1.12%	-1.03%	-0.07%		

3.2.2 基金自合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由三家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全,是全国同时具有境内、境外社会资金管理资格和人民币养老金管理资格的公司之一,全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务,旗下大成国际资产管理体系OPII、OPIII以及OPLP等资质。

历经二十一年的风雨沉浮,大成基金形成了以长期投资理念为核心,以核心竞争优势,打造了一支具有良好专业素养和丰富经验的管理团队,目前已形成公募、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队,全面覆盖各类型投资领域。截至2018年12月31日,公司管理公募基金产品数量共81只。

4.1.2 基金经理简介

姓名 职务 任期 说明

赵峰 基金经理 2018年1月1日至今 金融学硕士,2003年7月起就职于中国银河证券研究部,任研究员。2004年6月至2006年9月就职于中国银河证券研究所,任高级研究员。2006年9月加入大成基金管理有限公司,任基金经理。2009年1月起任大成基金管理有限公司任基金经理,负责大成基金的指数基金、量化基金、商品基金、境外基金、大类资产配置等产品的投资管理工作。

郭明 基金经理 2017年8月20日至今 金融学硕士,2003年7月起就职于中国银河证券研究部,任研究员。2004年6月至2006年9月就职于中国银河证券研究所,任高级研究员。2006年9月加入大成基金管理有限公司,任基金经理。2009年1月起任大成基金管理有限公司任基金经理,负责大成基金的指数基金、量化基金、商品基金、境外基金、大类资产配置等产品的投资管理工作。

4.2 基金管理人对本基金提供投资建议的主要人员简介

姓名 职务 任期 说明

赵峰 基金经理 2018年1月1日至今 金融学硕士,2003年7月起就职于中国银河证券研究部,任研究员。2004年6月至2006年9月就职于中国银河证券研究所,任高级研究员。2006年9月加入大成基金管理有限公司,任基金经理。2009年1月起任大成基金管理有限公司任基金经理,负责大成基金的指数基金、量化基金、商品基金、境外基金、大类资产配置等产品的投资管理工作。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对本基金年度报告真实性的声明

本人声明:我保证本年度报告所披露的信息真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

赵峰

大成基金管理有限公司

4.5 基金管理人对本基金年度报告的签章

赵峰

大成基金管理有限公司

4.6 基金管理人对本基金年度报告的复核意见

本人声明:我保证本年度报告所披露的信息真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

郭明

大成基金管理有限公司

4.7 基金管理人对本基金年度报告的签章

郭明

大成基金管理有限公司

4.8 基金管理人对本基金年度报告的复核意见

本人声明:我保证本年度报告所披露的信息真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

赵峰

大成基金管理有限公司

4.9 基金管理人对本基金年度报告的签章

赵峰

大成基金管理有限公司

4.10 基金管理人对本基金年度报告的复核意见

本人声明:我保证本年度报告所披露的信息真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

郭明

大成基金管理有限公司

4.11 基金管理人对本基金年度报告的签章

郭明

大成基金管理有限公司

4.12 基金管理人对本基金年度报告的复核意见

本人声明:我保证本年度报告所披露的信息真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

赵峰

大成基金管理有限公司

4.13 基金管理人对本基金年度报告的签章

赵峰

大成基金管理有限公司

4.14 基金管理人