

## 大成沪深300指数证券投资基金

## 2018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:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:2019年03月29日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金经理曾对中国农业银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2019年3月28日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺以诚实信用、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，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。安永华明会计师事务所(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12月31日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	大成沪深300
基金主代码	130000
基金次级代码	130000
基金简称	大成沪深300
基金合同生效日	2006-04-01
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
基金类型	股票型
基金运作周期	定期开放式
基金合同期限	不固定

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于沪深300指数成份股和非成份股，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资于沪深300指数成份股和非成份股，通过投资于沪深300指数成份股和非成份股，实现基金资产的长期增值。
投资范围	本基金主要投资于沪深300指数成份股和非成份股，通过投资于沪深300指数成份股和非成份股，实现基金资产的长期增值。
投资范围	本基金主要投资于沪深300指数成份股和非成份股，通过投资于沪深300指数成份股和非成份股，实现基金资产的长期增值。
投资范围	本基金主要投资于沪深300指数成份股和非成份股，通过投资于沪深300指数成份股和非成份股，实现基金资产的长期增值。

## 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	中国农业银行股份有限公司
住所	北京市海淀区中关村大街11号院11号楼15层	北京市东城区建国门内大街16号
法定代表人	王宗合	郭鹤年
基金资产总值	1370000	1370000
基金合同生效日	2006-04-01	2006-04-01
基金管理人	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
基金资产净值	1,324,467,442.75	1,324,467,442.75
基金合同生效日	不适用	不适用

## 2.4 信息披露方式

披露方式	披露时间	披露机构
基金半年度报告	基金半年度报告披露的披露时间	http://www.cfund.com.cn
基金年度报告	基金年度报告披露的披露时间	http://www.cfund.com.cn
基金季度报告	基金季度报告披露的披露时间	http://www.cfund.com.cn
基金半年度报告	基金半年度报告披露的披露时间	http://www.cfund.com.cn

## §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

项目	2018年	2017年	2016年
基金总资产	-907,494,44	14,115,640,65	-117,961,638,18
基金总负债	-479,411,11	305,805,443.53	-222,912,76,76
期末所有者权益(基金净值)	-0.263	0.199	-0.199
基金总资产减去总负债后的金额	-23.4%	79.3%	-83.1%
基金可供分配利润	2018年9月30日	2017年12月31日	2016年12月31日
基金可供分配利润	-0.000	0.000	-0.020
期末可供分配利润	1,309,500,003.03	2,040,123,820.00	1,291,621,577.77
期末可供分配利润	0.937	1.502	0.932

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认购或交易基金的费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

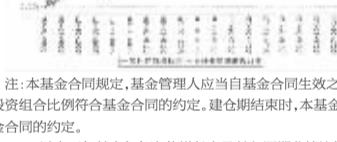
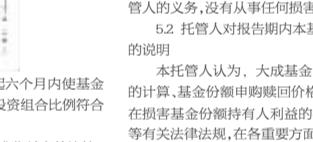
## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 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	份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率②	①-②
过去二个月	-1.9%	1.3%	-1.4%
过去一年	-3.4%	3.2%	-6.6%
过去三年	-17.3%	1.3%	-16.0%
过去五年	33.4%	29.7%	3.7%
自基金合同生效日起至今	139.4%	17.9%	121.5%

注:本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。

3.2.2 过去五年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

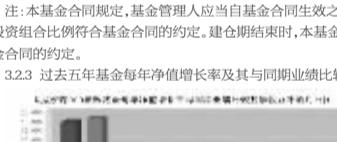
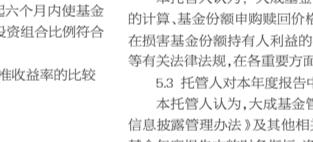



过去五年基金每年净值增长率

同期业绩比较基准收益率

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。

3.2.3 过去五年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

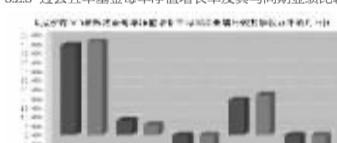
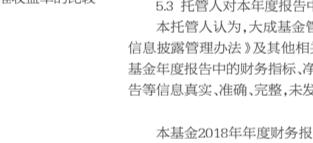



过去五年基金每年净值增长率

同期业绩比较基准收益率

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

过去三年基金的利润分配情况

同期业绩比较基准收益率

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。

3.4 管理人报告

## 3.4.1 基金管理人及基金经理的简介

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1日正式成立,是经中国证监会批准的第二批十家基金管理公司之一,注册资本为人民币亿元,注册地为深圳。目前公司由股东组成,分别为中投信托有限公司(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、境外社会基金托管人资格和基本养老保险基金管理人的资格的四家基金公司之一,同时具备公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资及实业等业务,旗下有大成资产管理公司具备QFII、RQFII以及QDLP等资质。

历经二十一年的朝耕夕耘,大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势,打造了一支具有良好从业素养和丰富经验的资产管理队伍,目前已形成权益、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。

## 3.4.2 基金经理(基金经理助理)/基金经理助简介

基金经理王军,男,1970年1月出生,大学本科学历,中国注册会计师,基金从业经验15年,现任大成基金管理有限公司基金经理。

基金经理王景,男,1970年1月出生,大学本科学历,中国注册会计师,基金从业经验15年,现任大成基金管理有限公司基金经理。

基金经理王鹏,男,1970年1月出生,大学本科学历,基金从业经验15年,现任大成基金管理有限公司基金经理。

基金经理王伟,男,1970年1月出生,大学本科学历,基金从业经验15年,现任大成基金管理有限公司基金经理。

基金经理王景,男,1970年1月出生,大学本科学历,基金从业经验15年,现任大成基金管理有限公司基金经理。

基金经理王景,男,1970年1月出生,大学本科学