大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金 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、准确性和完整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同意,并由董事长签发。

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3月28日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

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	大成趋势回报灵活配置混合
基金主代码	002383
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月22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
报告期末基金份额总额	87,610,906.81份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,扩展大类资产配置空间,把握市场运行趋势,在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略主要体现在两个方面:一方面对权益类资产及固定收益类资产等不同类别资产的大类配置上,另一方面体现在对单个投资品种的选择上。本基金强调趋势投资,具体可以概括为: 本基金根据对宏观趋势的分析实施大类资产的配置,本基金将在权益类证券投资方面,将对市场趋势进行研判,同时通过对行业发展趋势、公司成长趋势以及股票价格趋势的研究精选个股进行投资;在固定收益类证券投资方面,本基金将通过综合分析市场利率趋势、证券市场走势、资金供求关系流动性风险信用和有政策法规等因素,研判各类属固定收益资产的风险趋势与收益预期,精选个券进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型和货币市场基金,低于股票型基金,属证券投资基金中的中高风险品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 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 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年03月22日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-9,812,368.49	2,692,478.97	-16,644,321.55
本期利润	-10,590,504.34	5,899,893.66	-21,417,166.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1130	0.0360	-0.0752
本期基金份额净值增长率	-13.20%	3.50%	-8.50%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1778	-0.0532	-0.0848
期末基金资产净值	72,034,732.72	104,408,681.01	200,193,155.20
期末基金份额净值	0.822	0.947	0.915

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。

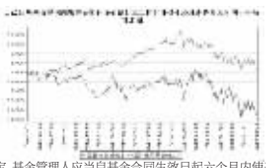
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数。

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

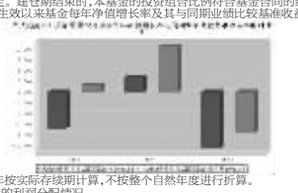
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.07%	1.55%	-5.04%	0.82%	-4.03%	0.73%
过去六个月	-9.47%	1.39%	-5.26%	0.74%	-4.21%	0.65%
过去一年	-13.20%	1.28%	-9.62%	0.67%	-3.58%	0.61%
自基金合同生效起至今	-17.80%	0.92%	1.62%	0.50%	-19.42%	0.42%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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。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 自基金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:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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,是中国证监会批准成立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(60%)、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,是全国同时具有独内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一。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公司具备OFII、RQFII及QFLP等资格。

历经二十年的磨砺和沉淀,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职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(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏庆国	本基金基金经理	2016年3月22日	-	8	经济学硕士,2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员。2012年至2013年任职于平安大华基金研究部,2013年6月加入大成基金管理有限公司,曾担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理,2015年4月7日起任大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金经理(更名前为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF))。2015年4月7日至2016年8月19日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日至2016年8月19日任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2016年3月22日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具,对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内,3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,因投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但结合交易价差专项统计分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要。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%的情形;主动投资组合间债券交易存在3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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

企业盈利预期在2018年面临压力,地产和基建为代表的周期类板块长期的债务扩张驱动投资的模式面临高杠杆的约束,在泛消费板块因为财富缩水效应也逐步感受到压力,在技术创新驱动的板块移动互联网的红利耗尽处于青黄不接。从风险偏好看,外部的贸易战和国内的政策导致风险事件频出,典型的如光伏和医药,但是市场期盼的减税和市场化转型却迟迟没有落地。因此全年上证、创业板和中小板都大幅下跌。 本年度继续完善整体投资框架,明确了处于复杂经济形势下的组合投资目标、超额收益来源(选股、交易和风险控制)。从超额收益率来源看,选择长期创造价值的优质企业获取企业盈利增长的收益,从中长期通过权衡风险收益比利用交易策略获取A股高波动性的收益。

4.4.2 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0.822元;本报告期基金份额净值增长率为-13.20%,业绩比较基准收益率为-9.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,在技术创新驱动的板块方面,相对看好5G产业链、新能源汽车产业链、风电光伏等领域。在泛消费领域依然看好医疗器械、创新药产业链、调味品等,关注景气和估值双底部的汽车股。在价格驱动的周期板块,关注规模化养殖等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会,公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员中包括千名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况,协助反馈其市场交易信息;基金运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值调整事项;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,投资组合经理作为估值小组成员,对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据,由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实,准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2018年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	22,255,598.05	59,349,011.67
结算备付金	356,216.04	44,593.52
存出保证金	70,105.93	94,532.00
交易性金融资产	49,494,436.96	46,373,271.07
其中:股票投资	49,494,436.96	46,373,271.07
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	580,762.18	-
应收利息	4,938.47	11,447.77
应收股利	-	-
应收申购款	2,788.62	306.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	72,764,846.25	105,873,162.86
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	146,120.77	950,192.60
应付管理人报酬	94,563.01	137,182.31
应付托管费	15,760.49	22,863.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	223,669.26	103,895.74
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	250,000.00	250,356.50
负债合计	730,113.53	1,464,481.85
所有者权益:		
实收基金	87,610,906.81	110,272,140.44
未分配利润	-15,576,174.09	-5,863,459.43
所有者权益合计	72,034,732.72	104,408,681.01
负债和所有者权益总计	72,764,846.25	105,873,162.86

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.822元,基金份额总额87,610,906.81份。

7.2 利润表

会计主体:大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-6,458,881.30	10,706,728.30
1.利息收入	196,128.54	551,303.47
其中:存款利息收入	196,128.54	551,303.47
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-5,886,841.12	6,923,948.16
其中:股票投资收益	-6,329,024.48	6,318,082.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	442,183.36	605,866.16
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-778,135.85	3,207,414.69
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	9,967.13	24,061.98
减:二、费用	4,131,623.04	4,806,834.64
1. 管理人报酬	1,293,275.38	2,314,735.05
2. 托管费	215,545.93	385,789.19
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,256,743.44	1,746,358.72
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	367,058.29	359,951.68
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-10,590,504.34	5,899,893.66
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-10,590,504.34	5,899,893.66

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	110,272,140.44	-5,863,459.43	104,408,681.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,590,504.34	-10,590,504.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-22,661,233.63	877,789.68	-21,783,443.95
其中:1.基金申购款	7,904,863.76	-372,260.19	7,532,603.57
2.基金赎回款	-30,566,097.39	1,250,049.87	-29,316,047.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	87,610,906.81	-15,576,174.09	72,034,732.72
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	218,739,680.20	-18,546,525.00	200,193,155.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,899,893.66	5,899,893.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-108,467,539.76	6,783,171.91	-101,684,367.85
其中:1.基金申购款	2,296,296.28	-155,304.76	2,130,991.52
2.基金赎回款	-110,753,836.04	6,938,476.67	-103,815,359.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	110,272,140.44	-5,863,459.43	104,408,681.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1	至7.4财务报表由下列负责人签署:

罗登攀 周立新 刘业林

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

7.4.6.1印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3个人所得税

个人所得税税率为20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司("大成基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司("大成国际")	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司("大成创新资本")	基金管理人的合营企业

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
光大证券	9,742,983.80	0.65	-	-

7.4.4.1.2 债券交易

无。

7.4.4.1.3 债券回购交易

无。

7.4.4.1.4 权证交易

无。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总额的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
光大证券	8,879.52	0.65	8,879.52	3.97
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总额的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
光大证券	-	-	-	-

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,293,275.38	2,314,735.05
其中:支付销售机构的客户维护费	509,856.66	941,404.16

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	215,545.93	385,789.19

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管人的基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	22,255,598.05	184,812.79	59,349,011.67	540,306.29

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,494,436.96	68.02
	其中:股票	49,494,436.96	68.02
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	22,611,814.09	31.08
8	其他各项资产	658,595.20	0.91
9	合计	72,764,846.25	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	42,481,186.96	58.97
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	4,291,125.00	5.96
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	2,722,125.00	3.78
S	综合	-	-
	合计	49,494,436.96	68.71

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

金额单位:人民币元

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	600498	烽火通信	151,400	4,310,358.00	5.98
2	300395	菲利华	258,300	3,706,605.00	5.15
3	300078	思创医惠	306,580	3,047,405.20	4.23
4	002672	东江环保	253,700	2,902,328.00	4.03
5	300496	中科创达	128,400	2,837,640.00	3.94
6	300144	宋城演艺	127,500	2,722,125.00	3.78
7	002202	金风科技	271,900	2,716,281.00	3.77
8	600030	中直股份	71,570	2,673,855.20	3.71
9	603659	璞泰来	54,200	2,569,080.00	3.57
10	600809	山西汾酒	70,700	2,478,035.00	3.44

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(http://www.dcfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	23,279,079.40	22.30
2	000858	五 粮 液	21,203,694.71	20.31
3	600048	保利地产	20,309,613.87	19.45
4	300373	扬杰科技	18,134,160.87	17.37
5	600884	杉杉股份	15,842,155.00	15.17
6	603799	华友钴业	13,766,191.30	13.18
7	002262	恩华药业	13,438,236.36	12.87
8	000333	美的集团	11,182,668.00	10.71
9	600498	烽火通信	11,164,883.00	10.69
10	601398	工商银行	11,058,722.78	10.59
11	002202	金风科技	10,298,349.74	9.86
12	000960	锡业股份	9,880,715.45	9.46
13	002138	顺络电子	9,433,438.13	9.04
14	000661	长春高新	9,080,486.20	8.70
15	300369	绿盟科技	8,967,974.00	8.59
16	600036	招商银行	7,824,536.74	7.49
17	300166	东方国信	7,732,111.93	7.41
18	300377	赢时胜	7,558,481.00	7.24
19	000910	大亚圣象	7,491,803.99	7.18
20	002007	华兰生物	7,351,260.96	7.04
21	300078	思创医惠	7,275,614.96	6.97
22	601939	建设银行	7,192,313.00	6.89
23	000651	格力电器	7,153,291.00	6.85
24	300633	开立医疗	7,014,263.00	6.72
25	600038	中直股份	6,965,218.08	6.67
26	600703	三安光电	6,951,634.31	6.66
27	300323	华