大成中证100交易型开放式指数证券投资基金 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。

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。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12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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	25,285,812.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年3月5日

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	本基金为被动式指数基金,采取完全复制法,围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。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如权证以及其他与标的指数成标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以期刚保值为目的,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。
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。

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
本期已实现收益	-2,829,168.07	4,801,640.56	-2,227,955.25
本期利润	-16,820,414.63	12,739,004.97	-3,321,661.16
加权平均基金份额本期利润	-0.5216	0.4178	-0.0851
本期基金份额净值增长率	-21.33%	30.90%	-6.25%
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	0.3128	0.6069	0.2752
期末基金资产净值	33,195,106.18	27,183,442.28	46,270,953.10
期末基金份额净值	1.313	1.669	1.275

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。

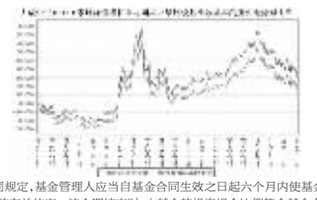
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

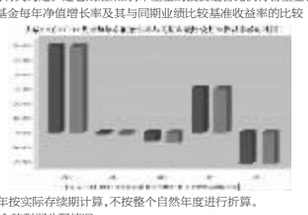
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.99%	1.59%	-12.50%	1.61%	-0.49%	-0.02%
过去六个月	-11.28%	1.48%	-11.53%	1.50%	0.25%	-0.02%
过去一年	-21.33%	1.35%	-21.94%	1.37%	0.61%	-0.02%
过去三年	-3.46%	1.13%	-5.98%	1.14%	2.52%	-0.01%
过去五年	52.67%	1.51%	47.82%	1.53%	4.85%	-0.02%
自基金合同生效起至今	31.30%	1.49%	16.21%	1.52%	15.09%	-0.03%

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。

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



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(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QFII、RQFII以及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达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		
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	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,曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理,现任数量与指数投资部副总监。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。具有基金从业资格。国籍:中国	
刘淼	本基金基金经理助理	2017年9月14日	-	10	工商管理硕士。2008年4月至2011年5月就职于招商基金管理有限公司,任基金核算部基金会计。2011年5月加入大成基金管理有限公司,历任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师。2017年9月14日起任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数联接基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。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 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,即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;主动投资组合同债券交易存在3笔同日反向交易,原因为投资策略需要。投资组合同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。

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

2018年度,整体宏观经济环境出现了较大的变化,在多方面因素的共同作用下,宏观经济下行压力贯穿全年。外部环境方面,中美贸易摩擦是全年影响最大的外生变量,全球政治、经济环境发生剧变,外需拉动作用大大减弱;在国内方面,内在运行机制存在弊端,叠加年初的去杠杆政策,造成民间信用扩张意愿极低。尽管面对剧烈冲击,宏观政策及时调整,去杠杆、金融整肃趋于温和,货币环境保持宽松,财政政策也更加积极,但政策生效尚需时日,货币传导也不甚通畅,流动性并未有效流入实体经济。

在基本面和流动性的双重挤压下,股市2018年度表现较差。年初,大盘蓝筹股延续之前趋势强劲上涨,走出逼空式行情,但行情过度透支,交易极其拥挤,最终由外围股市下跌引发剧烈调整,并单边下行至四季度。在十月上旬暴跌过后,股市企稳反弹,之后又再缓步下行至年底。全年市场基准沪深300指数下跌25.31%。各行业指数均有较大幅度的下跌,从全年来看,休闲服务、银行、食品饮料等行业较为抗跌,大市值的蓝筹股在熊市中表现出了良好的避险属性;而中小盘股票则是下跌的重灾区,表征中小市值股票走势的中证1000指数下跌36.87%,大幅落后于基准。

本基金标的指数中证100指数下跌21.94%,跌幅低于大盘。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。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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1.313元;本报告期基金份额净值增长率为-21.33%,业绩比较基准收益率为-21.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的年度,宏观经济面临较大的挑战。愈演愈烈的中美摩擦是最显而易见的外在影响因素,中美双方在诸多问题上存在较深层次的分歧,短时间内解决争端的可能性极小,这将长时间影响我国经济发展。同时,国内自身也存在税费负担、资源分配等问题,导致民间信心不足,信用扩张意愿极弱,叠加经济下行周期,形势更为严峻。尽管为刺激经济发展,宏观政策已经转向宽松的货币政策和积极的财政政策,但信用传导仍然不畅,政策作用尚不明显。此外,外汇因素将持续对货币政策宽松空间构成制约,非洲猪瘟的蔓延也有可能导致通胀的意外上升。若经济迟迟不见起色,而刺激工具有限,宏观经济环境很有可能走向类似滞涨的局面。

对于明年股市,我们认为将较去年有一定程度的好转,有可能走出先反弹再探底的行情。尽管经济形势非常严峻,但很大程度上已经反映在股票价格中,未来市场的主要矛盾将主要体现为下行现实和刺激预期的对冲。贸易摩擦等利空因素在较长的时间范围内压制经济复苏,而经济刺激政策则可以在短时间内改变投资者的预期和情绪。宏观去杠杆已逐渐演化为稳杠杆,而且一个健康向上的股市符合各方面的诉求,资金面和政策面都对股市较为友好。从估值水平来看,经过去年的下跌,相当多股票处于估值低位,存在估值修复的内在动力。

组合管理上,我们将严格按照基金合同的相关约定,紧密跟踪标的指数,按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合,努力实现跟踪误差的最小化。

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五名投资组合经理。

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算;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

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 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”)在对大成中证100交易型开放式指数证券投资基金(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年年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所(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:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金
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	488,450.73	543,118.28
结算备付金	966.27	5,648.71
存出保证金	218.60	3,450.29
交易性金融资产	32,875,596.38	26,838,315.66
其中:股票投资	32,875,596.38	26,818,815.66
基金投资	-	-
债券投资	-	19,500.00
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	-	-
应收利息	98.20	128.09
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	33,365,329.18	27,390,661.03
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	-	-
应付管理人报酬	14,671.13	11,666.04
应付托管费	2,934.22	2,333.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,617.65	3,219.50
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,000.00	190,000.00
负债合计	170,223.00	207,218.75
所有者权益:		
实收基金	25,285,812.00	16,285,812.00
未分配利润	7,909,294.18	10,897,630.28
所有者权益合计	33,195,106.18	27,183,442.28
负债和所有者权益总计	33,365,329.18	27,390,661.03

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.313元,基金份额总额25,285,812.00份。

7.2 利润表

会计主体:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金
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	-16,106,281.66	13,480,363.41
1.利息收入	5,958.42	5,277.61
其中:存款利息收入	5,957.40	5,275.30
债券利息收入	1.02	2.31
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)	-2,120,495.88	5,530,521.35
其中:股票投资收益	-3,295,879.16	4,431,952.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,380.16	-
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	1,173,003.12	1,098,568.49
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-13,991,246.56	7,937,364.41
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-497.64	7,200.04
减:二、费用	714,132.97	741,358.44
1. 管理人报酬	252,353.64	218,868.35
2. 托管费	50,470.70	43,773.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	20,733.63	27,907.46
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	390,575.00	450,809.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-16,820,414.63	12,739,004.97
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-16,820,414.63	12,739,004.97

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金
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)	16,285,812.00	10,897,630.28	27,183,442.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,820,414.63	-16,820,414.63
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)	9,000,000.00	13,832,078.53	22,832,078.53
其中:1.基金申购款	45,000,000.00	37,338,928.09	82,338,928.09
2.基金赎回款	-36,000,000.00	-23,506,849.56	-59,506,849.56
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)	25,285,812.00	7,909,294.18	33,195,106.18
项目	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)	36,285,812.00	9,985,141.10	46,270,953.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,739,004.97	12,739,004.97
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)	-20,000,000.00	-11,826,515.79	-31,826,515.79
其中:1.基金申购款	37,000,000.00	13,236,428.29	50,236,428.29
2.基金赎回款	-57,000,000.00	-25,062,944.08	-82,062,944.08
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)	16,285,812.00	10,897,630.28	27,183,442.28

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 刘亚林
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 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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货,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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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,股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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,暂减按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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
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:下述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	11,457,687.52	80.21	14,154,515.85	77.78

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	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
光大证券	10,441.33	80.21	2,617.65	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
光大证券	12,899.71	77.78	2,438.77	75.75

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,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	252,353.64	218,868.35
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注: 支付基金管理人大成基金 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

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	50,470.70	43,773.63

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

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	488,450.73	5,664.34	543,118.28	4,919.33

注:本基金由基金托管人保管的银行存款,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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项	16.01	2019-01-10	17.15	40,099	845,989.96	641,984.99	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	8.62	-	-	13,473	305,042.32	116,137.26	-

注: 本基金截至本期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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	32,875,596.38	98.53
	其中:股票	32,875,596.38	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	其他各项资产	316.80	0.00
9	合计	33,365,329.18	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