# 大成策略回报混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27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。本半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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成策略回报混合 |
| 基金主代码 | 090007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月26日 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,771,447,564.70份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 追求基金资产的长期稳健增值,兼顾当期收益;同时,实施积极的分红政策,回报投资者。 |
| 投资策略 | 本基金在控制风险的前提下,采取趋势投资策略进行总体资产配置;在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略,以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益;同时,强调收益管理,实施收益管理策略,以期在增长期及时锁定收益,制度性的减少未来可能的下跌风险,增加投资总收益。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深300指数+20%×中债综合指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种,其长期平均的预期收益和风险低于股票基金,高于债券基金和货币市场基金。 |

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 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵冰 | 石立平 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95595 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-63639132 |
| 邮政编码 | | 518040 | 100033 |
| 法定代表人 | | 刘卓 | 李晓鹏 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dcfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -86,603,312.03 |
| 本期利润 | 378,278,288.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1860 |
| 本期基金份额净值增长率 | 16.95% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0270 |
| 期末基金资产净值 | 1,723,575,621.24 |
| 期末基金份额净值 | 0.973 |

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。

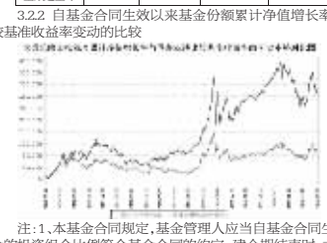
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 3.51% | 1.03% | 4.43% | 0.93% | -0.92% | 0.10% |
| 过去三个月 | -6.08% | 1.40% | -0.72% | 1.22% | -5.36% | 0.18% |
| 过去六个月 | 16.95% | 1.47% | 21.85% | 1.24% | -4.90% | 0.23% |
| 过去一年 | -4.70% | 1.43% | 8.89% | 1.22% | -13.59% | 0.21% |
| 过去三年 | 17.59% | 1.04% | 19.99% | 0.89% | -2.40% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 315.07% | 1.47% | 105.33% | 1.24% | 209.74% | 0.23% |

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:1、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。

2、本基金业绩比较基准自2015年9月14日起由原“沪深300指数×80%+中信全债指数×20%”变更为“沪深300指数×80%+中债综合指数×20%”。

§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%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理,还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过二十年的稳健发展,公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样,构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2019年6月30日,本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金,5只ODII基金及68只开放式证券投资基金。

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 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 侯春燕 | 本基金基金经理 | 2018年9月7日 | - | 9年 | 经济学硕士。2010年6月加入大成基金管理有限公司,曾担任研究部研究员、基金经理助理。2015年12月9日起任大成益琴稳健证券投资基金基金经理。2017年1月18日至2019年1月10日任大成消费主题混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年12月1日至2019年1月10日任大成新锐产业混合型证券投资基金基金经理。2018年9月7日起任大成策略回报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 |
| 孙丹 | 本基金基金经理助理 | 2018年3月12日 | - | 11年 | 经济学硕士。2008年至2012年就职于景顺长城产品开发部任产品经理。2012年至2014年就职于华夏基金机构债券投资部任研究员。2014年5月加入大成基金管理有限公司,曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018年3月12日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成鼎阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。2017年5月8日起任大成景鸿灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017年5月31日起任大成景荣债券型证券投资基金(原大成景荣保本混合型证券投资基金转型)基金经理。2017年5月31日起任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年11月19日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年12月8日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2019年6月15日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月6日起任大成惠阳定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年7月20日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。2019年7月31日起任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)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;部分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。

4.3.2 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%的情形;主动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。

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

本基金组合目前持仓主要集中在医药、汽车、电子、机械、食品饮料、旅游和银行地产。上半年组合中证券、银行地产、食品饮料的个股贡献了主要的收益,但由于以下几个方面因素导致收益率不甚理想:一是汽车和电子行业复苏进度低于预期,股价表现较弱;二是医药中的部分个股经营方面遭遇压力、下跌幅度较大;三是组合二季度增持了航空和酒店,选择这两个方向是看好消费升级以及行业竞争格局的优化,但因为二季度经济下行压力加大,航空和酒店在二季度均下跌较多。

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0.973元;本报告期基金份额净值增长率为16.95%,业绩比较基准收益率为21.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随着经济潜在增长率缓慢下行,经济结构也在经历着深刻的变化。很多历史的规律以及分析框架在当下遇到挑战。本基金管理人在不断的学习总结中力争加深对产业和公司竞争力的理解,以期为持有人在下半年获得更好的收益。

本组合长期的投资主线包括:一、制造业升级,包括核心零部件的进口替代以及技术升级推动的效率提升;二、人口结构中主力群体(30-40岁的中年人和60岁以上老人)相关的消费,例如旅游、医药等;三、低估值的金融地产中仍具备成长能力的公司。

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,中国光大银行股份有限公司在大成策略回报混合型证券投资基金(以下称“本基金”)托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《大成策略回报混合型证券投资基金2019年半年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、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)、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成策略回报混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 273,160,764.46 | 297,837,219.31 |
| 结算备付金 | 708,216.83 | 1,369,901.92 |
| 存出保证金 | 545,242.18 | 550,957.00 |
| 交易性金融资产 | 1,459,472,565.34 | 1,767,755,834.55 |
| 其中:股票投资 | 1,459,472,565.34 | 1,765,997,859.75 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | 1,757,974.80 |
| 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 | 56,255.70 | 72,635.92 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 841,636.03 | 6,281,365.08 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,734,784,680.54 | 2,073,867,913.78 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018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 | 6,032,802.17 | 4,119,715.59 |
| 应付赎回款 | 1,632,637.41 | 603,407.24 |
| 应付管理人报酬 | 2,065,484.55 | 2,705,308.55 |
| 应付托管费 | 344,247.44 | 450,884.75 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 747,009.14 | 847,050.75 |
| 应交税费 | 17.32 | 20.83 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 386,861.27 | 591,892.68 |
| 负债合计 | 11,209,059.30 | 9,318,280.39 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,771,447,564.70 | 2,481,757,731.63 |
| 未分配利润 | -47,871,943.46 | -417,208,098.24 |
| 所有者权益合计 | 1,723,575,621.24 | 2,064,549,633.39 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,734,784,680.54 | 2,073,867,913.78 |

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.973元,基金份额总额1,771,447,564.70份。

6.2 利润表

会计主体:大成策略回报混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 398,814,823.47 | -312,927,642.61 |
| 1.利息收入 | 872,261.79 | 3,463,776.57 |
| 其中:存款利息收入 | 865,559.06 | 2,446,572.41 |
| 债券利息收入 | 6,702.73 | 4,033.07 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 1,013,171.09 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | -67,794,820.28 | 179,747,326.33 |
| 其中:股票投资收益 | -84,717,193.54 | 140,476,172.99 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 4,439.12 | - |
| 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 | 16,917,934.14 | 39,271,153.34 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 464,881,600.45 | -498,604,351.53 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 855,781.51 | 2,465,606.02 |
| 减:二、费用 | 20,536,535.05 | 35,445,870.45 |
| 1. 管理人报酬 | 14,447,543.68 | 26,129,526.88 |
| 2. 托管费 | 2,407,924.00 | 4,354,921.11 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 3,528,955.25 | 4,719,258.95 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 税金及附加 | 24.13 | 14.57 |
| 7. 其他费用 | 152,087.99 | 242,148.94 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 378,278,288.42 | -348,373,513.06 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 378,278,288.42 | -348,373,513.06 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成策略回报混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30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) | 2,481,757,731.63 | -417,208,098.24 | 2,064,549,633.39 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 378,278,288.42 | 378,278,288.42 |
| 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) | -710,310,166.93 | -8,942,133.64 | -719,252,300.57 |
| 其中:1.基金申购款 | 284,355,557.29 | -11,904,104.31 | 272,451,452.98 |
| 2.基金赎回款 | -994,665,724.22 | 2,961,970.67 | -991,703,753.55 |
| 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) | 1,771,447,564.70 | -47,871,943.46 | 1,723,575,621.24 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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) | 2,544,128,138.34 | 592,712,441.54 | 3,136,840,579.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -348,373,513.06 | -348,373,513.06 |
| 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) | 364,338,467.91 | 83,476,006.82 | 447,814,474.73 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,252,868,349.93 | 287,855,068.84 | 2,540,723,418.77 |
| 2.基金赎回款 | -1,888,529,882.02 | -204,379,062.02 | -2,092,908,944.04 |
| 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) | - | -265,953,762.90 | -265,953,762.90 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,908,466,606.25 | 61,861,172.40 | 2,970,327,778.65 |

报表附注为财务报表的组成部分。

| 本报告6.1 | 至6.4财务报表由下列负责人签署: |
|---|---|

| 谭晓冈 | 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 |

6.4 报表附注

6.4.1 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

6.4.2 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有关问题的通知》、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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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”) | 基金销售机构、基金管理人、注册登记机构 |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”) | 基金销售机构、基金管理人的股东 |
| 中国光大银行股份有限公司 (“中国光大银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 | 688,062,639.03 | 32.42 | 1,664,035,063.25 | 51.79 |

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) |
| 光大证券 | 1,875,796.40 | 100.00 | - | - |

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) |
| 光大证券 | - | - | 850,000,000.00 | 100.00 |

6.4.4.1.4 权证交易

无。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30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 | 627,050.39 | 32.42 | 302,309.52 | 40.47 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 | 1,516,448.42 | 51.79 | 581,289.13 | 50.56 |

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 14,447,543.68 | 26,129,526.88 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 3,423,702.01 | 3,049,703.57 |

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1.50%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 × 1.50%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,407,924.00 | 4,354,921.11 |

注:支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国光大银行 | 273,160,764.46 | 850,366.59 | 487,005,341.69 | 2,405,547.22 |

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 6.4.5.1.1 受限证券类别:股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002352 | 顺丰控股 | 2017年8月22日 | 2019年8月23日 | 非公开限售 | 35.19 | 33.13 | 426,258 | 15,000,019.02 | 14,121,927.54 | - |
| 300788 | 中信出版 | 2019年6月27日 | 2019年07月05日 | 新股流通受限 | 14.85 | 14.85 | 1,556 | 23,106.60 | 23,106.60 | - |
| 601236 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年07月05日 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |

注:1.基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,本基金持有的上市公司非公开发行股份,自股份解除限售之日起12个月内,通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%;采取大宗交易方式的,在任意连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外,本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份,在受让后6个月内,不得转让所受让的股份。

2.基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1 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 | 1,459,472,565.34 | 84.13 |
| | 其中:股票 | 1,459,472,565.34 | 84.13 |
| 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 | 273,868,981.29 | 15.79 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,443,133.91 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 1,734,784,680.54 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合7.2.1 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 | 1,495,362.00 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 43,948,484.19 | 2.55 |
| C | 制造业 | 785,719,133.32 | 45.59 |
| 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 | 47,243,689.80 | 2.74 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 96,380,374.26 | 5.59 |
| H | 住宿和餐饮业 | 84,625,488.76 | 4.91 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 39,603.76 | 0.00 |
| J | 金融业 | 108,783,887.11 | 6.31 |
| K | 房地产业 | 113,904,455.40 | 6.61 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,954,916.00 | 0.35 |
| 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 | 64,860,567.68 | 3.76 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 106,516,603.06 | 6.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,459,472,565.34 | 84.68 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金