

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

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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27日

§1 重要提示

本基金的董事会、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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。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。

基金托管人中国农业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预示其未来表现。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。

本报告自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
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
报告期末基金份额总额	146,003,445.08份
基金合同存续期	不定期

基金名称	深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	159906
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

基金名称	大成深证成长40ETF联接
基金代码	080612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

日,3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果显示:债券交易同向交易频率较低,部分股票同向交易频率较高,主要来自市场因素(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日内较大变动导致个别投资组合的成交价格价差异常较大,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。主动投资组合之间股票交易不存在同日反向交易。主动投资组合与指数投资组合之间或指数投资组合之间不存在股票同日反向交易,但不存在参与市场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。投资组合间相向交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常。

4.4 管理人对于报告期内基金的股票投资和业绩表现的说明

2019年上半年,国内经济增长延续弱格局,二季度GDP同比增长2.2%,较一季度小幅回落,创下了过去27年的新低。中美贸易摩擦进一步升级,加大了中美两国经济增长的不确定性,近期双方同意重启经贸磋商,美方表示不再对中国出口产品加征新的关税,贸易摩擦有缓和趋势。上半年A股在多重因素影响下震荡上行,沪深300指数上涨27.1%,创业板指上涨20.9%。

报告期内本基金基本保持高仓位运作,严格根据标的指数成分股调整以及权重变化及时调整投资组合。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

截至本报告期末本基金份额净值为0.796元;本报告期基金份额净值增长率为24.76%,业绩比较基准收益率为25.43%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场和行业走势的简要展望

展望2019年下半年,国内政策侧重于供给侧改革,不会大规模放水,海外经济下行,贸易摩擦不断。国内经济增长多方面承压,经济增速预计进一步下行。但我们同时看到A股估值在全球来看已处于非常低的位置,受MSCI纳入A股权重加大等影响,外资长期稳定流入A股市场。近期支持企业持续经营发展的货币政策和税收政策不断出台,个人所得税调整增加居民收入刺激消费。有核心竞争力的行业龙头公司有望在经济下行中突出结构性行情。

组合管理中,我们将严格按照基金合同的相关规定,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 管理人对于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、监察稽核部特定人员组成。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后市场环境发生了重大变化或证券发行价格发生影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要调整估值模型或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要调整估值模型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。基金估值政策的修订和修改采用集体讨论机制,投资决策委员会作为估值小组委员,对持仓证券的交易情况、信息披露及时性有执业数据,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对于采用特别估值程序的投资,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技术各方之间不存在任何重大利益冲突。截止本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上市债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 基金管理人对于报告期内基金利润分配政策的说明

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

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 报告人报告

5.1 报告期内本基金管理人遵守法律法规情况

在本基金基金的过程中,本基金管理人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人,大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等事宜上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,托管人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资运作报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

资产: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

报告截止日:2019年6月30日

资产	本报告期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
货币存款	7,690,853.10	6,962,371.58
结算备付金	-	-
存出保证金	-	470.10
交易性金融资产	109,384,612.82	82,179,500.00
其中:股票投资	574,612.82	-
基金投资	108,810,000.00	82,179,500.00
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收利息	5,564.49	-
应收股利	1,432.04	1,380.24
应收申购款	19,014.33	27,520.16
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	117,079,265.91	89,161,279.10

负债和所有者权益	本报告期末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	-	-
应付短期融资款	-	-
应付赎回款	780,981.76	-
应付证券清算款	29,279.24	23,242.07
应付管理人报酬	3,500.91	2,966.96
应付托管费	760.21	580.17
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,571.11	2,504.27
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	64,570.79	250,016.10
负债合计	880,894.01	279,387.62
所有者权益:		
实收基金	146,003,445.08	139,376,860.63
未分配利润	-29,814,077.18	-50,494,939.16
所有者权益合计	116,189,367.90	88,881,921.48
负债和所有者权益总计	117,079,265.91	89,161,279.10

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.796元,基金份额总额146,003,445.08份。

6.2 利润表

会计主体: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

报告期间:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间2018年6月30日
一、收入	23,518,012.33	-20,351,160.47	-
1.利息收入	29,088.19	30,146.43	-
其中:存款利息收入	29,088.19	30,146.43	-
债券利息收入	-	-	-
资产支持证券利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-1,520,464.98	740,829.56	-
其中:股票投资收益	597,486.03	-190,677.03	-
基金投资收益	-1,721,087.56	931,516.59	-
债券投资收益	-	-	-
资产支持证券投资收益	-	-	-
衍生工具收益	-	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	3,136.79	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	24,971,492.27	-21,106,544.02	-
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	37,029.86	4,407.96	-
减:二、费用	139,608.36	233,062.25	-
1.管理人报酬	21,236.20	20,489.93	-
2.托管费	4,247.06	4,080.73	-
3.销售服务费	-	-	-
4.交易费用	39,418.01	24,623.09	-
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	74,708.10	182,900.90	-
三、利润总额(亏损以“-”填列)	22,378,403.97	-20,564,212.72	-
减:所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	22,378,403.97	-20,564,212.72	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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

报告期间:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期可比期间2018年6月30日	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	139,376,860.63	-50,494,939.16	88,881,921.48
本期期间损益	-	23,378,403.97	23,378,403.97
三、本期基金净值变动(减少以“-”填列)	6,626,584.46	-2,697,542.00	3,929,042.46
其中:1.基金申购	36,683,300.00	-7,381,437.60	29,301,862.40
2.基金赎回款	-30,056,715.54	4,683,895.60	-25,372,822.95
四、本期基金净值变动(减少以“-”填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	146,003,445.08	-29,814,077.18	116,189,367.90