大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF) 2019年半年度报告摘要

2019年6月30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
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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年03月20日(基金合同生效日)起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成中华沪深港300指数(LOF)
场内简称	中华300
基金主代码	160925
交易代码	160925
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2019年3月20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	911,833,527.00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	2019年3月29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。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。本基金通过港股通投资港股的策略是按照指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中华交易服务沪深港300指数(人民币)收益率×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%
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。本基金部分基金资产将投资于香港市场,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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
信息披露负责人	姓名	赵冰	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

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3月20日(基金合同生效日) - 2019年6月30日)
本期已实现收益	7,362,984.56
本期利润	-14,779,399.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0130
本期基金份额净值增长率	-1.33%
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	-0.0133
期末基金资产净值	899,690,247.95
期末基金份额净值	0.9867

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。

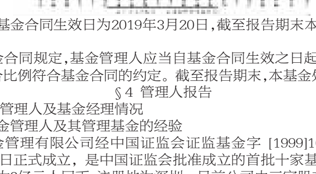
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.57%	0.91%	5.49%	0.93%	0.08%	-0.02%
过去三个月	-1.39%	0.88%	0.19%	1.02%	-1.58%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-1.33%	0.82%	-0.09%	1.03%	-1.24%	-0.21%

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、本基金合同生效日为2019年3月20日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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。截至报告期末,本基金处于建仓期。

§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QDII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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2019年3月20日	-	16年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究所,任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部,任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司,曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016年12月29日起任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金(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

2019年,虽然海外股市有所动荡,但是各种宏观经济数据显示,以美国为首的发达经济体仍然保持较好的增长势头,并不会陷入经济衰退,因此美股也于近期创出了历史新高。

在1季度,中国为了扭转经济下滑的不利局面实施了多项经济政策:首先,中央政府实施了宽信用、宽货币的货币政策,货币政策是经济的领先指标,较为宽松的货币政策有利于后几个月的经济增长;其次,政府实施了广泛的减税政策,其中企业减税降负促进经济活力,个人所得税降低有望促进消费。因此,A股及港股市场在1季度及2季度初期都出现了较好的涨幅。

但是五一过后市场出现了若干不利信号,首先是中美贸易谈判一度出现重大倒退,中美双方重新面临互加关税的风险;其次是中国5月份之后的宏观经济数据有大幅放缓的迹象,这也意味着宏观经济面临着极为不利的局面。在这些因素的影响下,A股及港股市场出现了大幅回撤。

值得欣慰的是,在六月中下旬以来,中美双方开始重启贸易谈判,宏观经济数据也出现了走稳的迹象,因此A股及港股市场开始出现了反弹。

根据指数成分股的分布,本基金分别投资于A股市场及港股市场,因此A股及港股的走势都会对本基金产生重要影响。

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0.9867元;自基金合同生效起至今基金份额净值增长率为-1.33%,业绩比较基准收益率为-0.09%。

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,今年下半年全球经济增长或逐步放慢,中国也不例外,当前普遍预测中国2019年的GDP增速在6.2%左右。

因为经济增速放缓,经济下行压力尚未得到缓解,所以预计中国下半年政策宽松力度有望加强。在相对宽松的经济政策作用下,辅之中美贸易谈判重启而减弱外部不确定性,中国经济在下半年或实现逐步企稳。根据历史数据回溯,政策宽松加景气下行且逐步企稳的经济场景中,股票市场大多表现为由熊转牛。

根据彭博一致预期,中华沪深港300指数的指数成分股公司在未来2-3年间还有较好盈利增长,同时当前中华沪深港300指数的估值水平位于历史平均水平区间,在估值水平不变的假设基础上,盈利的持续增长有望推动指数点位的持续上涨。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念,持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好地跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管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3月20日(基金合同生效日)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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,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问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《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规定进行。

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

本托管人认为,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、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)

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
资 产:	
银行存款	98,532,986.74
结算备付金	-
存出保证金	109,199.33
交易性金融资产	811,761,204.95
其中:股票投资	811,761,204.95
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	-
应收利息	20,913.93
应收股利	3,157,240.64
应收申购款	21,827.28
递延所得税资产	-
其他资产	58,275.80
资产总计	913,661,648.67
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30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	96.75
应付赎回款	12,609,812.19
应付管理人报酬	367,734.73
应付托管费	73,546.95
应付销售服务费	-
应付交易费用	758,303.13
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	161,906.97
负债合计	13,971,400.72
所有者权益:	
实收基金	911,833,527.00
未分配利润	-12,143,279.05
所有者权益合计	899,690,247.95
负债和所有者权益总计	913,661,648.67

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9867元,基金份额总额911,833,527.00份。

6.2 利润表

会计主体:大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入	-11,445,123.76
1.利息收入	2,788,785.64
其中:存款利息收入	1,860,510.10
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	928,275.54
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	6,565,643.25
其中:股票投资收益	-2,167,987.92
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	8,733,631.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-22,142,383.59
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,342,830.94
减:二、费用	3,334,275.27
1. 管理人报酬	1,518,616.29
2. 托管费	303,723.32
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,360,013.59
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	151,922.07
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-14,779,399.03
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-14,779,399.03

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月20日(基金合同生效日)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)	1,968,326,601.16	-	1,968,326,601.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,779,399.03	-14,779,399.03
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)	-1,056,493,074.16	2,636,119.98	-1,053,856,954.18
其中:1. 基金申购款	19,435,063.54	-167,995.08	19,267,068.46
2.基金赎回款	-1,075,928,137.70	2,804,115.06	-1,073,124,022.64
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)	911,833,527.00	-12,143,279.05	899,690,247.95

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 基金基本情况

大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2018]2130号《关于准予大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,967,654,798.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0120号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2019年3月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,968,326,601.16份基金份额,其中认购资金利息折合671,803.16份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2019]143号文审核同意,本基金8,136,323.00份基金份额(截至2019年3月22日止)于2019年3月29日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通机制允许买卖的香港联交所上市的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、衍生工具(股指期货、权证)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例不低于80%;投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中华交易服务沪深港300指数(人民币)收益率×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间为2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期间无须说明其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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的转让收入免征增值税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

无。

6.4.7.2 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
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
光大证券	845,229,979.81	94.71

6.4.8.1.2 债券交易

无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
光大证券	3,104,900,000.00	79.94

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 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3月20日(基金合同生效日)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	715,278.92	94.33	715,278.92	94.33

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,518,616.29
其中:支付销售机构的客户维护费	1,235,315.55

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×0.50%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	303,723.32

注:支付基金托管人中国农业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×0.10%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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3月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	98,532,986.74	733,854.38

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
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	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	811,761,204.95	88.85
	其中:股票	811,761,204.95	88.85
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	98,532,986.74	10.78
8	其他各项资产	3,367,456.98	0.37
9	合计	913,661,648.67	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	6,646,125.00	0.74
B	采矿业	12,420,187.00	1.38
C	制造业	147,906,664.00	16.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,010,635.00	1.00
E	建筑业	10,390,035.00	1.15
F	批发和零售业	4,267,321.80	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	10,351,929.60	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,855,558.00	0.98
J	金融业	132,469,791.88	14.72
K	房地产业	18,348,365.00	2.04
L	租赁和商务服务业	5,294,344.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	764,232.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	542,184.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,280,817.30	0.25
R	文化、体育和娱乐业	1,281,232.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	370,829,421.58	41.22

7.2.2 报告期末积极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	363,431.25	0.04
C	制造业	149,935.83	0.02
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	39,603.76	-
J	金融业	33,869.94	-
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	23,106.60	-
S	综合	-	-
	合计	609,947.38	0.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	504,080.37	0.06
消费者非必需品	19,589,197.80	2.18
消费者常用品	11,789,761.92	1.31
能源	17,417,426.34	1.94
金融	195,174,571.30	21.69
医疗保健	6,780,648.00	0.75
工业	20,026,693.63	2.23
信息技术	4,870,022.07	0.54
电信服务	92,389,440.68	10.27
公用事业	25,187,385.72	2.80
房地产	46,592,608.16	5.18
合计	440,321,835.99	48.95

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	00700	腾讯控股	241,100	74,781,532.77	8.31
2	00005	汇丰控股	743,600	42,386,663.40	4.71
3	601318	中国平安	380,328	33,700,864.08	3.75
4	01299	友邦保险	437,000	32,386,662.14	3.60
5	00939	建设银行	4,625,000	27,380,517.08	3.04
6	02318	中国平安	221,000	18,235,175.87	2.03
7	600519	贵州茅台	17,600	17,318,400.00	1.92
8	01398	工商银行	3,050,000	15,292,889.10	1.70
9	00941	中国移动	216,000	13,518,966.74	1.50
10	600036	招商银行	362,100	13,028,358.00	1.45

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)的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	03311	中国建筑国际	84,000	592,609.35	0.07
2	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.04
3	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
4	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
5	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.00

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)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	82,952,203.86	9.22
2	00005	汇丰控股	44,866,501.66	4.99
3	01299	友邦保险	32,066,865.83	3.56
4	601318	中国平安	30,809,971.76	3.42
5	00939	建设银行	27,603,403.95	3.07
6	02318	中国平安	18,363,979.38	2.04
7	01398	工商银行	16,235,756.74	1.80
8	600519	贵州茅台	15,872,238.09	1.76
9	00941	中国移动	14,974,261.24	1.66
10	600036	招商银行	12,754,717.36	1.42
11	00388	香港交易所	11,756,638.64	1.31
12	03988	中国银行	10,339,881.62	1.15
13	000651	格力电器	10,096,227.12	1.12
14	601166	兴业银行	9,727,390.60	1.08
15	000333	美的集团	9,055,564.00	1.01
16	00883	中国海洋石油	8,703,189.01	0.97
17	00001	长和	7,659,698.48	0.85
18	000858	五 粮 液	7,240,654.76	0.80
19	600276	恒瑞医药	6,965,547.15	0.77
20	02888	渣打集团	6,900,896.46	0.77

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	2,936,597.82	0.33
2	00005	汇丰控股	2,271,118.14	0.25
3	01299	友邦保险	2,006,170.63	0.22
4	00016	新鸿基地产	1,135,248.81	0.13
5	01398	工商银行	829,163.60	0.09
6	03988	中国银行	811,509.23	0.09
7	02318	中国平安	775,060.61	0.09
8	00883	中国海洋石油	734,789.12	0.08
9	00388	香港交易所	700,878.13	0.08
10	600023	浙能电力	688,560.00	0.08
11	00941	中国移动	646,936.78	0.07
12	000503	国新健康	631,906.00	0.07
13	600066	宇通客车	620,548.00	0.07
14	00011	恒生银行	599,948.25	0.07
15	300024	机器人	596,332.60	0.07
16	03968	招商银行	586,418.24	0.07
17	00551	裕元集团	556,390.80	0.06
18	00688	中国海外发展	543,055.08	0.06
19	00002	中电控股	514,065.36	0.06
20	02388	中银香港	512,210.72	0.06

注:本期累计卖出金额指卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	864,678,233.70
卖出股票收入(成交)总额	28,606,657.24

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	109,199.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,157,240.64
4	应收利息	20,913.93
5	应收申购款	21,827.28
6	其他应收款	323.00
7	待摊费用	57,952.80
8	其他	-
9	合计	3,367,456.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
13,947	65,378.47	20,789,245.58	2.28	891,044,281.42	97.72

注:持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	屈艳贞	1,234,500.00	20.07
2	张宁湘	662,148.00	10.76
3	汤海波	427,405.00	6.95
4	沈秀英	333,305.00	5.42
5	王华明	270,301.00	4.39
6	岳娟	250,000.00	4.06
7	刘兴芹	196,425.00	3.19
8	王爱平	173,200.00	2.82
9	杨丽娇	151,031.00	2.45
10	祁志发	150,036.00	2.44

注:以上数据由中国证券登记结算有限公司提供,持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	30,047.60	0.0033

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2019年3月20日)基金份额总额	1,968,326,601.16
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,435,063.54
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,075,928,137.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	911,833,527.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。
2019年4月1日

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动 经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自2019年7月6日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动 2019年1月,中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。 2019年4月,中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。
2019年4月1日

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。
2019年4月1日

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。
2019年4月1日

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。
2019年4月1日

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。
2019年4月1日

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	845,229,979.81	94.71%	715,278.92	94.33%	-
中泰证券	1	47,206,362.13	5.29%	43,024.21	5.67%	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

(1)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

(2)经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;

(3)研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

(4)具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;

(5)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(6)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金专用席位。本报告期内本基金退租的交易单元:无,新增交易单元:国泰君安。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	3,104,900,000.00	79.94%	-	-
招商证券	-	-	779,200,000.00	20.06%	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我司发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自2019年7月6日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

大成基金管理有限公司

2019年8月27日