

大成核心双动力混合型证券投资基金

基金管理人:大成基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018年8月29日

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018年8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2018年01月01日起至06月30日止

§ 2 基金简介

基金简称	大成核心双动力混合
基金主代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	91,089,218.26(/)
基金合同存续期	不定期

投资策略		本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战时配置,并采用"核心-双卫星"策略管理股票资产。				
业绩比较基准		75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数				
风险收益特征		本基金是主动投资的混合基金,预期风险收益水平位于股票基金,高于债券基金和货币市场基金。				
2.3 基金管理人和基金	金托管					
项目		基金管理人 基金托管人				
名称	大成割	改基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司				

以稳健的投资策略为主,采用合理的方法适当提升风 验收益水平,力争获取超越业绩比较基准的中长期投

2.4 信息披露方式

《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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-4,811,558.03
本期利润	-13,527,933.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1368
本期基金份额净值增长率	-12.82%
3.12 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0821
期末基金资产净值	83,614,070.48
期末基金份额净值	0.918
注:1、本期已实现收益指	基金本期利息收入、投资收益、其他

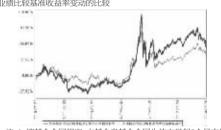
不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实 现收益加上本期公允价值变动收益。 2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用

后实际收益水平要低于所列数字。 3.2 基金净值表现

. 传僧长索及其上同期小塘比松其准收兴家的比松

J.Z.1 ZE:	E DOUBLE COLUMN	IENE K	平汉头一	A11-13-6.1-41にお	ULLIAX SETET	IX IIII 4 I J J I
阶段	份額净值 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	10-3	2-4
过去一个月	-6.13%	1.31%	-5.63%	0.96%	-0.50%	0.35%
过去三个月	-9.89%	1.04%	-7.03%	0.85%	-2.86%	0.19%
过去六个月	-12.82%	1.05%	-8.80%	0.87%	-4.02%	0.18%
过去一年	-7.91%	0.87%	-1.99%	0.71%	-5.92%	0.16%

1.32% 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



注:1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6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、本基金于2015年7月22日由大成核心双动力股票型证券投资基金更名为大成核心双动力混合型证券投资基金。

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 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。

经过十多年的稳健发展,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2018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

tot de	ann da	任本基金的基金	经理(助理)期限	证券从	114 1111
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	说明
张 钟 玉	本基金 金经	2015年2月28日	-	8年	由计学师士 2010年 13人大度基金管理等 13人为任务等的 13人为任务等的 13人为任务等的 13人为任务等的 13人为任务等的 13人为一位 13人的 13人的 13人的 13人的 13人的 13人的 13人的 13人的
苏 秉 毅	基金数据 医金属量数 医金属量	2016年3月4日	_	14年	部所学術 - 2004年 2004年 2004年 2005年 2005年

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

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;股票同向交易溢价率变动主要来源 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变动导致个别组合间的 成交价格存在一定差异,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。

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 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2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 441 报告期内基金投资策略和运作分析

.季度在中美贸易摩擦升级、社融超预期下降和地产政策持续收紧 等事件的影响下,A股市场单边下跌,沪深300指数二季度下跌9.9%,创业板指下跌15.5%。受经济周期影响较大的传统制造和金融业以及出口 收入占比高的电子元器件等行业普遍大幅下跌,食品饮料、餐饮旅游、医药、家电等稳定消费类股票受到追捧,二季度超额收益明显。

报告期内本基金基于基金契约,精选沪深300成分股构建了核心组 合,同时选择业绩持续增长、估值合理的成长股作为进攻组合。 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0.918元: 本报告期基金份额净 值增长率为-12.82%,业绩比较基准收益率为-8.80%。

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2018下半年,国内经济增长多方面承压。一方面,贸易战对出 口的影响将逐新体现,另一方面,受金融去杠杆和房地产调控影响,地产和基建投资增速难以维持。但我们认为下半年A股仍有结构性机会,近 期监管在货币政策和财政政策上已经有放松趋势,利好上半年预期过度 悲观的周期性板块和有减税新政支持的创新行业。

我们将继续精选受益于供给侧改革、消费升级等的蓝筹股构建核心 组合,同时选择受益于经济结构调整、业绩持续增长、估值合理的成长个

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、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三名投资组

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: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,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交 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/中证指 数有限公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理 标准另有规定的除外)的估值数据。

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局同的规定进行收益分配。本报告期内已分配利润4,520,408.17元(每十份基金份额分红0.500元),符 合基金合同规定的分红比例。

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

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,本基金托管人在对大成核心双动力混合型证券投资基

金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽 职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。 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 本报告期内,大成核心双动力混合型证券投资基金的管理人—

成基金管理有限公司在大成核心成功力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问 题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运 作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,大成核心双动力混合型 证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为4,

520.408.17元 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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双 动力混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容 真实、准确和完整。

《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:大成核心双动力混合型证券投资基金 报告截止日: 2018年6月30日

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	16,487,771.68	35,975,757.87
结算备付金	284,653.92	705,669.35
存出保证金	31,069.50	43,382.25
交易性金融资产	67,154,627.19	120,838,177.36
其中:股票投资	67, 154, 627.19	120,586,177.36
基金投资	_	_
债券投资	-	252,000.00
资产支持证券投资	-	_
贵金属投资	-	_
衍生金融资产	-	_
买人返售金融资产	-	
应收证券清算款	-	978,221.15
应收利息	2,737.85	3,737.30
应收股利	-	-
应收申购款	29,553.37	9,281.10
递延所得税资产	-	_
其他资产	-	_
资产总计	83,990,413.51	158,554,226.38
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30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	-	22,115,283.64
应付赎回款	2,218.89	1,995.28
应付管理人报酬	107,262.53	173,097.55
应付托管费	17,877.10	28,849.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	75,416.68	174,480.66
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	173,567.83	150,007.50
负债合计	376,343.03	22,643,714.20
所有者权益:		
实收基金	91,089,218.26	122,962,728.26
未分配利润	-7,475,147.78	12,947,783.92
所有者权益合计	83,614,070.48	135,910,512.18
负债和所有者权益总计	83,990,413.51	158,554,226.38

591,089,218.26份。6.2 利润表会计主体:大成核心双动力本报告期:2018年1月1日3		基金
华 / (10年1月1日	EZ018年6月30日	单位:人民
项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6 月30日
一、收入	-12,037,884.01	4,805,634.42
1.利息收入	58,171.30	104,701.75
其中:存款利息收入	58,149.42	100,618.42
债券利息收入	21.88	-
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收人	-	4,083.33
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-3,422,788.78	-582,174.19
其中:股票投资收益	-4,137,407.86	-1,379,763.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	36,219.38	-
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	678,399.70	797,589.13
3.公允价值变动收益(损失以 "-"号填列)	-8,716,375.90	4,972,934.34
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	43,109.37	310,172.52
减:二、费用	1,490,049.92	1,497,875.05
1. 管理人报酬	780,386.16	745,893.15
2. 托管费	130,064.39	124,315.54
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	404,622.33	537, 159.00
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	174,977.04	90,507.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-13,527,933.93	3,307,759.37

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体,大成核心双动力混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

項目	2018年	本期 F1月1日至2018年6月30	H				
	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)	122,962,728.26	12,947,783.92	135,910,512.18				
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本 期利润)	-	-13,527,933.93	-13,527,933.93				
三、本期基金份額交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以"-" 号填列)	-31,873,510.00	-2,374,589.60	-34,248,099.60				
其中:1.基金申购款	3,132,967.49	160,811.23	3,293,778.72				
2.基金赎回款	-35,006,477.49	-2,535,400.83	-37,541,878.32				
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)	-	-4,520,408.17	-4,520,408.17				
五、期末所有者权益(基 金净值)	91,089,218.26	-7,475,147.78	83,614,070.48				
項目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	309,489,012.68	678,399.81	310,167,412.49				
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本 期利润)	-	3,307,759.37	3,307,759.37				
三、本期基金份額交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以"-" 号填列)	-187,578,544.58	1,639,498.71	-185,939,045.87				
其中:1.基金申购款	62,090,801.82	2,340,067.47	64,430,869.29				
2.基金赎回款	-249,669,346.40	-700,568.76	-250,369,915.16				
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	121,910,468.10	5,625,657.89	127,536,125.99				

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

罗登攀 周立新

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 计机构负责人

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 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

(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涌股股东向流涌股股东支付对价而发 生的股权转让,暂免征收印花税。

(2)增值税及附加、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《关于明确会融 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《关于租人固定资产 讲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 实际买人价计算销售额,或者以2017年最后一个交易目的股票收盘价 (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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附 加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。

(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 人,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 人、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%计人应纳税所得额;持股期限超过1 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。

6.4.3 关联方关系

本基金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

大成基金管理有限公司("大成基金") 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 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。

644 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 本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6442 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

		单位:人民币	17
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
当期发生的基金应支付 的管理费	780,386.16	745,893.15	
其中:支付销售机构的客 户维护费	91,985.24	108,426.42	
注:基金管理费报	前一日的基金资产净	值的1.5%的年费率计提。	ì

算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费 E为前一日的其全资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送 基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内 从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付 日期顺延。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元 注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

H=E×0.25%/当年天数 H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送 基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内 从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付

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 本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行 间同业市场的债券(含回购)交易。 6444 各关联方投资本基金的情况

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 本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。 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

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

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

单位:人民币元 注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,并按银行

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事 6.4.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

2018年半年度报告摘要

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 于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的

单位:人民币元 证券。 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

1749	称	11993	因	价	11993	价		18K/14/C/18K	ACATER	
6017 27	上海电气	201 8年6 月 7 日	亜大事项	6.34	201 8年8 月7 日	5.71	157,200	920,495.00	996, 648.00	_
0026 02	世纪华通	201 8年6 月12 日	重大事项	32.50	-	-	15,300	525,761.00	497, 250.00	-
6008 11	东方集团	201 8年5 月 30 日	重大事项	4.30	-	1	67,600	301,306.51	290, 680.00	_
3003 24	旋极信息	201 8年5 月 30 日	重大事项	9.49	-	-	26,794	283,732.00	254, 275.06	_
6000 22	山东钢铁	201 8年3 月27 日	重大事项	2.02	201 8年8 月16 日	1.83	112,700	229,995.00	227, 654.00	_
0024 31	棕榈股份	201 8年5 月 30 日	重大事项	6.71	-	-	20,300	148,228.67	136, 213.00	_
6007 50	江中药业	201 8年5 月 2 日	重大事项	17.75	201 8年8 月1 日	16.12	6,720	117,878.00	119, 280.00	_
6007 59	洲际油气	201 8年3 月27 日	重大事项	3.94	-	-	29,100	112,158.00	114, 654.00	_
0020 11	盾安环境	201 8年5 月 2 日	重大事项	6.40	-	-	12,600	99,540.00	80, 640.00	_
6004 85	信威集团	201 6年 12月 26日	重大事项	10.64	-	-	3,100	56,018.92	32, 984.00	_
3002 38	冠昊生物	201 8年2 月 2 日	重大事项	18.87	201 8年7 月18 日	16.98	1,600	45,882.67	30, 192.00	_
0024 64	众空联	201 8年2 月 2 日	重大事项	21.19	201 8年7 月31 日	19.07	980	19,523.00	20, 766.20	-
6033 15	福鞍股份	201 8 年 4 月 9日	重大事项	12.44	201 8年8 月1 日	13.20	1,200	19,272.00	14, 928.00	-
0025 12	达华智能	201 8年6 月19 日	重大事项	9.70	-	-	900	9,648.00	8,730.00	-
0021 13	天润数娱	201 8年2 月 1 日	重大事项	5.78	-	-	1,360	9,104.00	7,860.80	-
0024 26	胜利精密	201 8年6 月19 日	重大事项	3.60	201 8年7 月3 日	3.26	2,100	9,786.00	7,560.00	-
0026 09	捷顺科技	201 8年6 月19 日	重大事项	9.52	201 8年7 月3 日	8.57	700	9,926.00	6,664.00	-

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。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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额。 §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

		金	:额单位:人民市
序号	项目	金额	占基金总资产的比 例(%)
1	权益投资	67,154,627.19	79.96
	其中:股票	67,154,627.19	79.96
2	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买人返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	16,772,425.60	19.97
7	其他各项资产	63,360.72	80.0

7.2 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 1,574,371 信息传输、软件和信息技术员 2,808,258.

科学研究和技术服务 **尼服务、修理和其他服务**》

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末未持有港股通投资股票

7.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
1	601328	交通银行	368,800	2,116,912.00	2.5
2	601288	农业银行	582,300	2,003,112.00	2.4
3	600887	伊利股份	71,300	1,989,270.00	2.3
4	600690	青岛海尔	101,500	1,954,890.00	2.3
5	600015	华夏银行	255,700	1,904,965.00	2.2
6	601601	中国太保	58,300	1,856,855.00	2.2
7	000858	五粮液	24,300	1,846,800.00	2.2
8	601628	中国人寿	77,900	1,754,308.00	2.1
9	600837	海通证券	178,834	1,693,557.98	2.0
10	000963	华东医药	33,300	1,606,725.00	1.9

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初基金资产净值2%或前20名的股票明

金额单位:人民币元 股票名称 本期累计买人金额

注:本期累计买人金额指买人成交金额(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初基金资产净值2%或前20名的股票明

金额单位:人民币元 股票名称 本期累计卖出金额

1,922,63

1,247,969.49 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)

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 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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 木基全木报告期末未持有债券

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 木基全木报告即末未持有债券

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产 支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券 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 本基金本报告期末未持有贵金属。

投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

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

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期未投资股指期货

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期未投资股指期货

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未持有国债期货。 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货。 7.12 投资组合报告附注

主体交通银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户 身份识别义务等,受到中国人民银行处罚 (银反洗罚决字(2018)1 号)。本基金认为,对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负 面影响。 本基金投资的前十名证券之一中国人寿(601628)的发行主体中

7.12.1 本基金投资的前十名证券之一交通银行(601328)的发行

国人寿保险股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字(2018)5号)。 本基金认为,对中国人寿的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影

7.12.2 基金投资的前十名股票中,没有投资干超出基金合同规定备 选股票库之外股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,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

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明组

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

持有份额 注:持有人户数为有效户数,即存量份额大干零的账户。 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位:份

8.3 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 的情况

> § 9 开放式基金份额变动 单位:份

10.1 基金份额持有人大会决议 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

€ 10 重大事件揭示

本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项

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安永华明会计师事务所(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。

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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况 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

成交金額 佣金

通证券 61,180 26.25 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

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为; (二)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; (三)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; (四)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; (五)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

和用证券公司交易单元的选择标准主要包括

(六)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交 易单元。

本报告期内退出交易单元:无。 本报告期内新增交易单元:海通证券。

成交金額

用证券公司交易单元的选择标准和程序。

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

《11 影响投资者决策的其他重要信息

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例 达到或者超过20% 的时间区间	期初 份額	申购 份額	赎回 份額	持有份额	份额占 比
机构	1	20180101-20180 213	30,000, 000.00	0.00	30,000, 000.00	0.00	0.00%
	2	20180101-20180 630	25,772, 551.55	0.00	0.00	25,772, 551.55	28.29%
	3	20180101-20180 630	31,113, 308.54	0.00	0.00	31,113, 308.54	34.16%
Ţ	-	-	-	-	-	-	-
_		1	产品料	有风险			

11.2 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

IEE並の前付有人口に以了累中的,可能云台米平一些並の前付有人人前級自同的及基本資 問烈波动的风险。甚至有可能引起基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资 以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份

限假(公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定)的要求,本基金管理人经与基金 等人的着一致,对本基金基金合同的有关条款进行了修改,主要作前言,释义、投资交易限制 即马赎回管理,基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确,具体内 非见2018年3月27日基金管理人风险故酷的相关公告和修订更新后的法律文件。

大成基金管理有限公司