

大成正向回报灵活配置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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29日

1 重要提示

1.1 重要提示
本基金管理人、董事、监事、高级管理人员及其他相关人员不存在虚假记载、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2018年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报表、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先仔细阅读本基金的招募说明书及更新。
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。
本报告自2018年8月1日起至06月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称 大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金
基金代码 001366
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2015年7月1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
境内基金份额发售机构 大成基金管理有限公司
基金销售机构 不定期更新
基金估值程序 不定期更新

2.2 基金产品说明
投资目标 在严格控制风险的基础上,通过严格控制组合下行风险,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略 本基金的投资目标是在严格控制组合的下行风险,力争实现基金资产的长期增值。本基金的投资策略为:在严格控制组合的下行风险的前提下,通过严格控制组合的下行风险,力争实现基金资产的长期增值。本基金的投资策略为:在严格控制组合的下行风险的前提下,通过严格控制组合的下行风险,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准 一年定期银行存款利率+2%
风险收益特征 本基金属于混合型基金,其预期收益及风险水平高于股票型基金,低于债券型基金和货币型基金,属于证券投资基金中风险程度较高的品种。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称 大成基金管理有限公司 大成基金管理有限公司
姓名 魏志军 魏志军
联系电话 0755-81832888 010-69360969
电子信箱 dcfund@dfund.com.cn dxp@chibank.com.cn
客户服务热线 4008858888 86609
传真 0755-81999888 010-68126116

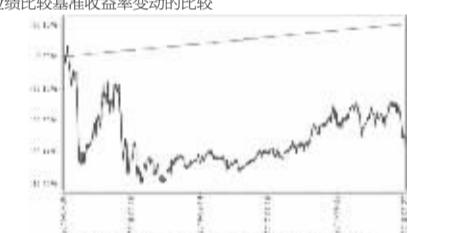
2.4 信息披露方式
信息披露半年度报告正文的管理人互联网 <http://www.dcfund.com>
基金半年度报告备查地点 基金管理人基金托管人住所

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	报告期末2018年1月1日至2018年6月30日	本报告期末	上年度末	3.1.2 期间数据和指标	报告期末2018年6月30日	本报告期末	上年度末
本期已实现收益	8,496,446.43			期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00
本期公允价值变动收益	-15,970,014.84			期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00
加权基金份额本期利润	-0.021			基金份额净值增长率	0.01%	0.01%	0.01%
本期基金份额净值增长率	-0.17%			基金份额净值增长率	0.01%	0.01%	0.01%
3.1.2 期间数据和指标 <th>报告期末2018年6月30日</th> <th>本报告期末</th> <th>上年度末</th> <td>基金份额净值增长率</td> <td>0.01%</td> <td>0.01%</td> <td>0.01%</td>	报告期末2018年6月30日	本报告期末	上年度末	基金份额净值增长率	0.01%	0.01%	0.01%
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	基金份额净值增长率	0.01%	0.01%	0.01%
基金份额净值	1.00	1.00	1.00	基金份额净值增长率	0.01%	0.01%	0.01%

注:1.本期已实现收益指本期利息收入、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低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
注:1.本期已实现收益指本期利息收入、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低于所列数字。



注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至本报告期末本基金的各项投资组合比例已达到基金合同的规定。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人
大成基金管理有限公司
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
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

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、债券型基金和货币型基金的完备产品线。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ODI基金及75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	魏志军
职务	基金经理
任职日期	2015年7月8日
离任日期	-
证券从业年限	10年
说明	1.工学硕士,曾任广发证券股份有限公司研究员,2012年8月起加入大成基金管理有限公司,历任研究员,专户研究员,现任大成基金管理有限公司基金经理,2014年6月23日起任大成基金基金经理,2014年7月1日起任大成基金基金经理,2017年8月8日起任大成基金基金经理,2017年9月15日起任大成基金基金经理,2018年6月30日任大成基金基金经理。

注:1.任职日期、离任日期为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,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和工具,对旗下所有投资组合进行连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易间向交易价差进行分析。分析结果表明:债券交易间向交易价差;股票间向交易价差;股票间向交易价差;股票间向交易价差。分析结果表明:债券交易间向交易价差;股票间向交易价差;股票间向交易价差;股票间向交易价差。

4.3 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均未发现异常交易行为。主动投资组合间是否存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要。主动投资组合间与指数投资组合之间存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要。主动投资组合间与指数投资组合之间存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要。

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
2018年上半年,市场行情开始进入一个快速轮动的状态,指数的波动幅度也较去年明显加大。元旦后,以地产为代表的银行板块走出了一波快速上涨的行情,地产、银行指数在短时间里涨幅均超过10%,同期创业板为代表的中小市值个股明显下跌,颇有去年行情特点延续的趋势,但是很快市场又发生轮动,地产等行业权重快速拉升,同期计算机为代表的科技类股票表现强势,市场出现明显的跷跷板行情。在一季度末期,市场开始进入比较均衡的状态,但是中美贸易战成为影响市场波动的主要力量,在这一时期,防御性较强的医药等板块表现突出,同时食品饮料等防御性板块也明显上涨。进入六月后,国际贸易战的进一步恶化和国内去杠杆的进一步推进,引发了市场的快速下跌,几乎所有板块均轮流下跌,上证等多个指数在六月底均创出年内低点。

在一季度中,我们减持了去年获利较多的周期和建筑类股票,逐步加大了医疗方面的配置,这一点在本季度为我们赢得了二季度的较好收益。我们在二季度的判断是货币宽松和国内宏观情况持续影响市场走势,因此二季度持仓主要以防御性的医药和消费为主,但是六月份的市场下跌力度依然超出我们预期,组合的收益在六月的调整中损失较大。目前我们认为市场的悲观情绪依然存在,但是在目前持仓的股票均为有基本面支撑的防御型股票,并且对目前持仓的在未来的业绩

增长维持乐观判断,因此继续以目前的医药和消费持仓为主。

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0.743元;本报告期基金份额净值增长率为-9.17%,业绩比较基准收益率为1.60%。

4.5 管理人宏观经济、证券市场和行业走势的简要展望
总结A股上半年,股风风险偏好快速上升,是引发下跌的核心因素。A股风险偏好受到三重压制:1)中美贸易摩擦;2)美债利率和美元指数上行对权益资产估值造成压力,部分新兴市场的投资吸引力有限;3)去杠杆背景下市场对经济前景的担忧;4)股市下跌引发股权质押风险触发的担忧。所以在18年上半年市场风格仍然偏向于价值,因价值更能抵抗风险偏好下降对估值的影响,消费股的确定性溢价上升;而部分景气度公用事业和低估值的周期或主要行业。

我们认为A股生态已经在发生三大变化:1)绩优股的牛市仍在进行,绩劣股的熊市愈演愈烈;2)A股加速融入全球资本市场,海外投资者相对全球全市场估值;3)去杠杆过程中,基于ROIC的投资方法穿透财务数据“迷雾”甄别行业的本质面,供给侧收缩提升上市公司质量导致小盘绩差股风险偏好下降,未来去杠杆股的领涨行情将继续演绎。在全球横向比较的估值体系下,A股龙头公司仍具备低估值优势。

对于下半年的观点,我们认为A股市场正在构筑中期底部,先防御,后进攻。正如上半年股风风险偏好快速上升是引发A股下跌的核心原因,目前的估值已隐含较高悲观预期,下半年权益资产估值回落也将是A股反弹的核心驱动力。近期在货币市场波动宽松与资金供求关系恶化的共同驱动下,市场的反弹将显著强于预期。但去杠杆路径和中美贸易摩擦尚待清晰,市场风险偏好上行空间仍受制约,更具趋势性的股风风险溢价回落需要等待:1)信用缓和与扩大内需政策;2)中美摩擦过程中偏积极的信号。两大催化剂均有望在下半年先见出现。

我们预计18年下半年A股除金融股外能获得18%左右的盈利增速,ROE相对平稳。下半年权益风险溢价回落的顺序决定了行业轮动顺序。从行业配置的角度来看,消费配置龙头股估值相对低溢价仍处于合理区间,将继续作为仓位的主要组成部分。虽然我们对创业板估值水平仍然保持谨慎态度,但是三季度部分代表国内科技前进方向的公司有望获得反弹机会。待信用缓和与扩大内需政策更为清晰,则低估值周期龙头也将迎来反弹机会。

4.6 管理人对报告期内基金投资策略等事项的说明
本基金管理人指导基金投资策略和估值程序等由公司估值委员会、公司估值委员会主要职责是制定估值程序和制度、修订及执行情况的监督、估值委员会由股票管理部、研究员、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构估值部指定人员组成。公司估值委员会的相关人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两名估值基金经理。

股票管理部、研究员、固定收益部、风险管理部和社保基金及机构估值部负责关注相关投资品种的动态,评判具有增值的投资品种是否处于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调整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调整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资金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值程序;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。

本基金的日常估值程序由基金运营部估值委员会执行,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,基金信息及投资处理所有的估值小组成员,对本基金公允价值证券的估值情况、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意见,参与估值政策讨论;对需采用特别估值程序的证券,基金管理人应及时与特别估值程序,由估值委员会以约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个环节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国证监会注册在案有相关公司/证券持有人签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和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
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况的说明
4.9 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况的说明
4.10 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况的说明

5 投资组合报告
5.1 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.2 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.3 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.4 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.5 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.6 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.7 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.8 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.9 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.10 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.11 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.12 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.13 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.14 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.15 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.16 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.17 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.18 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.19 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.20 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.21 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.22 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.23 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.24 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.25 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.26 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.27 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.28 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.29 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.30 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.31 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.32 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.33 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.34 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.35 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.36 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.37 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.38 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.39 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.40 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.41 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.42 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.43 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.44 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.45 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.46 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.47 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.48 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.49 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.50 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.51 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.52 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.53 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.54 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.55 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.56 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.57 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.58 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.59 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.60 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.61 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.62 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.63 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.64 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.65 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.66 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.67 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.68 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.69 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.70 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.71 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.72 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.73 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.74 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.75 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.76 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.77 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.78 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.79 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.80 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.81 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.82 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.83 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.84 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.85 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.86 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.87 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.88 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.89 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.90 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.91 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.92 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.93 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.94 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.95 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.96 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.97 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.98 报告期末本基金持仓资产配置情况
5.99 报告期末本基金持仓资产配置情况

5.100 报告期末本基金持仓资产配置情况

项目	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	报告期	年初至本报告期末	报告期	年初至本报告期末
一、期间所有者权益(基金净值)	234,754,008.30	-62,719,910.09	192,034,097.27	-
二、本报告期间净资产(基金净值)	-	-15,970,014.84	-15,970,014.84	-
三、本报告期间公允价值变动收益(基金净值)	-18,907,407.07	3,229,550.62	-15,747,307.05	-
四、本报告期间损益(基金净值)	6,017,910.54	-1,073,009.69	4,942,900.00	-
五、本报告期间基金份额变动(基金净值)	-25,009,288.22	4,314,301.30	-20,694,986.92	-
六、本报告期末净资产(基金净值)	215,767,320.60	-56,450,376.21	160,316,945.48	-

注:本基金截至本报告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交易,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债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。
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余额。
6.4.5.3.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
6.4.5.3.4 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

6.4.6 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.6.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.6.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.6.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.7 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.7.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.7.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.7.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.8 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.8.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.8.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.8.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.9 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.9.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.9.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.9.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.10 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.10.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.10.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.10.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.11 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.11.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.11.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.11.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.12 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.12.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.12.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.12.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.13 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.13.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.13.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.13.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.14 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.14.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.14.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.14.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.15 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.15.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.15.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.15.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.16 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.16.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.16.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.16.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.17 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.17.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.17.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.17.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.18 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.18.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.18.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.18.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.19 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.19.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.19.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.19.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.20 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.20.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.20.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.20.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.21 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.21.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.21.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.21.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.22 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.22.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.22.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.22.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.23 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.23.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.23.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.23.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.24 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.24.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.24.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.24.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.25 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.25.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.25.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.25.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.26 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.26.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.26.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.26.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.27 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.27.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.27.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.27.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.28 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.28.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.28.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.28.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.29 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.29.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.29.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.29.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.30 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.30.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.30.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.30.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.31 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.31.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.31.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.31.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.32 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.32.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.32.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.32.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.33 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.33.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.33.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.33.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.34 报告期末基金资产净值及其构成

2018年半年度报告摘要

注:1.基金可作为特定投资者,认购中国证监会《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减持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,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大会审议通过,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。
6.4.1.2 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	停牌日期	停牌原因	期初数量(股)	期末数量(股)	期末公允价值(人民币元)	期末估值总额(人民币元)	备注
60346	2018年9月5日	重大事项停牌	905	864	689,940	5,719,807	6,429,467.00
300140	2018年1月1日	重大事项停牌	1533	1650	166,900	2,839,243.94	2,568,977.00
300072	2018年6月1日	重大事项停牌	2328	1838	58	2,072.21	1,350.21

注:本基金截至本报告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交易,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债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。
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余额。
6.4.5.3.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
6.4.5.3.4 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

6.4.6 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.6.1 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.6.2 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.6.3 报告期末基金资产净值及其构成

6.4.7 报告期末基金资产净值及其构成
6.4.7.1 报告期末基金资产净值及其构成