大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)

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

₹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

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太其全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

2.1 基金基本情况	
基金简称	大成海外中国机会混合(QDII-LOF)
场内简称	海外中国
基金主代码	160923
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29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	43,294,646.59份
基金合同存续期	不定期

CALCALL CATA FORMA	1 707
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金通过重点挖掘受益于中国经济增长的海外投资机会,在实现高度风险分散的同时,追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相核合的方法分析灭观经分 前正旁市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类 货产的强钢收益与风险。 成战人引制规定和模核会类员 产的比例,在保持总体风险 水平相对稳定的基础上 力争投资组合的稳键增值。此外,永基金将等或建设 行定期与不定期的资产配置风险监控,通时地做出相 级的调整。
业绩比较基准	MSCI中国指数收益率×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期风险与预期收益水平化于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,加于中等风险收益特征的基金品种。
2.3 基金管理人和基金托管	

			于中等风险收益特	征的基金品种。
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	中国工商银行股份有限公司
		姓名	赵冰	郑明
信息据	医医负责人	联系电话	0755-83183388	010-66105799
电		电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服	务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588 010-66105798		
2.4	境外投	资顾问和	境外资产托管人	
J.	質目		境外资产托	管人
£2.40c	英文	Brown Broth	ners Harriman & Co.	
名称中文		布朗兄弟哈里曼银行		

	中文	1110475030403113210417	
注册地址 140 Broadway New York		140 Broadway New Yor	k,NY 1005
办公地	站址	140 Broadway New Yor	k,NY 1005
邮政编	码	NY 1005	
2.5	信息扱	露方式	
登载者 网网址		E报告正文的管理人互联	http://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

	金额毕位:人民巾	
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	519,246.30	

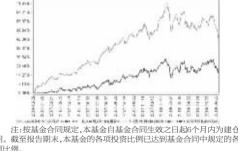
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	519,246.30
本期利润	195,874.94
加权平均基金份额本期利润	0.0045
本期基金份额净值增长率	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1187
期末基金资产净值	51,876,339.10
期末基金份额净值	1.198
注:1、本期已实现收益指基金	本期利息收入、投资收益、其他收入
(不含公允价值变动收益)扣除相	关费用后的余额,本期利润为本期已

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认购或交易基金的各项费用,计 人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	份額净值 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	10-33	2-4	
	过去一个 月	-4.16%	1.39%	-5.31%	1.33%	1.15%	0.06%	
	过去三个 月	2.31%	1.23%	-4.07%	1.10%	6.38%	0.13%	
	过去六个 月	0.50%	1.30%	-2.11%	1.28%	2.61%	0.02%	
	过去一年	14.10%	1.11%	18.57%	1.10%	-4.47%	0.01%	
	自基金合 同生效起 至今	19.80%	0.96%	47.48%	0.99%	-27.68%	-0.03%	
	3.2.2	自基金合	同生效じ	来基金位	分额累计汽	自值增长率3	变动及其与	3 [i
M	1/结比软	注は水水	台密变动	的比较				



项比例。 《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 ODII\\\\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QDII基金及 75只开放式证券投资基金。

姓名	职务	任本基金的表 理)]	甚金经理(助 期限	证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期	PR	
冉凌浩先 生	本基金基金经理	2016年12月29日	-	1544	金融学硕士,2005年4月 至2004年6月至2005年9月 证券研究部,任研究员 设施工学研证券研究部 月间。 1月10年6月 1月10年7日 1月10年7日 1月10年7日 1月10年7日 1月10年7日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1日 1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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介本基金本报告期内无境外投资顾问。 4.3 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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4.4.1 公平交易制度的执行情况

的行为。

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 干市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机洗柽,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。 4.4.2 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存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需 要, 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 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

45.1报台期内基金投资策略和运作分析 2018年上半年,全球主要发达经济体的宏观经济保持了稳定增长, 美国宏观经济也保持了稳定增长的势头,美国股票市场也保持了在震荡 中略微上涨的趋势。

在2018年1季度,作为新兴市场最重要的国家,中国宏观经济仍然 能维持稳定增长。但是,中国的宏观经济在2季度发出了相对消极的信

首先,由于中国整体杠杆室较高,监管层采取措施逐步降低社会杠 去杠杆政策虽然利好经济的长期健康发展,但是却通过银根紧 缩等途径对经济的短期增长造成了一定压力。

其次,中美贸易争端逐步升级,导致中国净出口金额与去年同期相 比已经有了一定幅度的下滑,这也是对宏观经济的拖累。 另外,在2季度,中国三四线城市的棚改货币化进程有所减速,这也

负面影响了宏观经济。 同时,这些负面因素也影响到了居民消费支出,最近月份的消费数 据也因此走弱。 在这些不利于宏观经济的因素的影响下,A股及港股市场在2季度

出现了快速下跌,而本基金的基准指数也同样出现了快速下跌的情形。 从汇率方面来看,在1季度,港元汇率出现了小幅下跌,而在2季度, 港元汇率又出现了明显上升,从而使得在今年上半年期间,港元也取得 了微小升值,这利好干本基金净值表现。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现 截至木报告期末木其全份额净值为1198元,木报告期其全份额净

值增长率为0.50%,业绩比较基准收益率为-2.11%。 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2018下半年,预计中国宏观经济仍然会保持增长,但是经济增长速

度可能会有所降低。 从不利的方面来看 首先 中国整体杠杆率较高是客观事实 监管层

也会持续加强对金融行业的监管;其次,中美贸易冲突在下半年还有持 续升级的可能性,这会切实影响中国的出口;另外,居民消费增速也有可 当然,与2季度相比,宏观经济在下半年也有改善的方面。首先,香港 中资上市公司上半年整体增速依然维持强劲,海外中资股样本盈利同比增速有望达到25%,较2017年的18%进一步提升,这展示了经济仍然有

增长的朝性。其次,近期召开的国务院常务会议提出更积极的财政政策、松紧适度的货币政策、清理僵尸企业和鼓励中小企业贷款等多项促进经 济增长的政策,而这些经济增持有望改善宏观经济表现。 综合上述各方面,我们预计港股市场今年盈利增长依然具有相当的 韧性,但不利因素与压力也边际上有所增加,包括持续去杠杆化导致融资成本上升、贸易摩擦的潜在负面影响、以及人民币持续走弱的影响等。

4.7 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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估 循金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两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构 投资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 察稽核部份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技术工作。 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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形 无。

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海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)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,大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)的管 理人——大成基金管理有限公司在大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计 成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)未进行利润分配。 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海外中

国机会混合型证券投资基金(LOF)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,以上内容直空,准确和完整,

半年度财务会计报告(未经审计) §6 6.1 资产负债表

		单位:人民
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	3,327,036.51	3,736,330.00
结算备付金	-	
存出保证金	-	
交易性金融资产	48,507,438.13	48,596,821.54
其中:股票投资	48,507,438.13	48,596,821.54
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	-	-
买人返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	
应收利息	662.25	851.10
应收股利	250,140.78	17,850.4
应收申购款	9,292.49	64,195.1
递延所得税资产	_	-
其他资产	-	
资产总计	52,094,570.16	52,416,048.29
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	10.36	10.58
应付赎回款	35,706.91	39,725.46
应付管理人报酬	65,654.17	64,162.69
应付托管费	15,319.30	14,971.29
应付销售服务费	-	
应付交易费用	2,233.96	772,806.10
应交税费	_	-
应付利息	-	
应付利润	_	
递延所得税负债	_	
其他负债	99,306.36	270,149.64
负债合计	218,231.06	1,161,825.70
所有者权益:		, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
实收基金	43,294,646.59	42,996,201.3
未分配利润	8,581,692.51	8,258,021.18
所有者权益合计	51,876,339.10	51,254,222.49
负债和所有者权益总计	52,094,570.16	52,416,048.2

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币1.198元,

6.2 利润表 会计主体:大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF) 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日 单位:人民币元 主工具收益 4.177.275 -323.371.3 兑收益(损失以 托管费 17,059,342.3

17,059,342 6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

项目	2018£	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)	42,996,201.31	8,258,021.18	51,254,222.49
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本 期净利润)	-	195,874.94	195,874.94
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)	298,445.28	127,796.39	426,241.67
其中:1.基金申购款	3,113,348.22	706,502.14	3,819,850.36
2.基金赎回款	-2,814,902.94	-578,705.75	-3,393,608.69
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)	43,294,646.59	8,581,692.51	51,876,339.10
项目	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)	619,811,052.48	20,495.58	619,831,548.06
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本 期净利润)	-	17,059,342.32	17,059,342.32
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	-545,739,154.32	-13,398,526.57	-559,137,680.89
(净值减少以"-" 号填列)			
(净值减少以 "-"	2,451,930.96	65,579.65	2,517,510.61
(净值减少以"-" 号填列)	2,451,930.96 -548,191,085.28	65,579.65 -13,464,106.22	
(净值减少以"-" 号填列) 其中:1.基金申购款		,	2,517,510.61 -561,655,191.50

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 崔伟

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 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、税项与最近一期年度报告

6.4.2 税项 根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总

局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得 税若干优惠政策的通知》、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]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行 税额抵扣等增值税政策的通知》、国发 [1985]19号发布和国务院令 [2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国 务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规 定)的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教 育附加的通告》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示

(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。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入和利息收入,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。 (4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维

护建设税、教育费附加和地方教育费附加。 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 基金管理人、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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易

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

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的

6.4.4.1.2 债券交易 本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的

6.4.4.1.3 债券回购交易 本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的

交易。

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的

6.4.4.1.5 权证交易

6.4.4.2 关联方报酬

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的 交易。

6.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

6.4.4.2.1 基金管理费 上年度可比期间 7年1月1日至2017年6月30 项目

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 X 1.50% / 当年天数。 6.4.4.2.2 基金托管费

> 单位:人民币元 项目

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.35% / 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 本报告期与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。

0.35%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:

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 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。 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 单位:人民币元

注: 本基金的银行存款由基金托管人工商银行和境外资产托管人 BBH银行保管,存放于工商银行的银行存款按银行同业利率计息,存放 于BBH银行的银行存款不计息 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。 6.4.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.5.1 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

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

2018年半年度报告摘要

证券。

单位:人民币元

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 本基金截至本报告期末未持有因公布的重大事项可能产生重大影 响而被暂时停牌的股票。

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

于本报告期末,本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 于本报告期末,本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的

《7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资 产的比例 (%)
1	权益投资	48,507,438.13	93.11
	其中:普通股	48,507,438.13	93.11
	存托凭证	-	_
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	_	-
2	基金投资		-
3	固定收益投资	_	-
	其中:债券		-
	资产支持证券	_	-
4	金融衍生品投资		-
	其中:远期	_	-
	期货	1	
	期权		-
	权证	_	-
5	买人返售金融资产	_	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资 产	-	_
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,327,036.51	6.39
8	其他各项资产	260,095.52	0.50
9	合计	52,094,570.16	100.00

元,占期末基金资产净值的比例为1.46%;通过深港通交易机制投资的 港股公允价值为47 749 238 30元。占期末其余资产净值的比例为 92.04% 72 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

注:本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为758,199.83

金额单位:人民币元

注:1.股票的国家(地区)类别根据其所在证券交易所确定。						
2.本基金本报告期末未持有存托凭证。						
7.3 期末按行业分类的权益投资组合						
金额单位:人民币元						
行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)				
能源	313,970.44	0.61				
工业	2,161,624.09	4.17				

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS) 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益

投资明细

							金额甲位:	八氏口
序号	公司名称(英文)	公司 名称 (中文)	证券代码	所在 证券 市场	所属国 家(地 区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	勝控有公 司	700 HK	港合易 港合易	中国香港	14,000	4,648,178.92	8.96
2	CSPC PHARMACEU- TICAL GROUP LT	石 药集团	1093 HK	香联交所	中国香港	160,000	3,197,035.20	6.16
3	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	华洞啤酒	291 HK	香联交所	中国香港	84,000	2,698,257.24	5.20
4	SUNNY OPTICAL TECH	舜 字 光 学 科技	2382 HK	香联交所	中国香港	20,000	2,461, 852.00	4.75
5	SINO BIOPHARMA- CEUTICAL	中 国生物制药	1177 HK	港合易 港合易	中国香港	225,000	2,283,957.90	4.40
6	AIA GROUP LTD	友 邦保险	1299 HK	港合易 港合易	中国香港	39,000	2,255,629.74	4.35
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	港合易 港合易	中国香港	30,000	1,826,154.60	3.52
8	SANDS CHINA LTD	金中有公	1928 HK	香联交所	中国香港	50,000	1,768,402.25	3.41
9	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中银香港	2388 HK	香联交所	中国香港	56,000	1,744, 542.52	3.36
10	GALAXY ENTERTAIN- MENT GROUP L	银 河 娱乐	27 HK	港合易 港合易	中国香港	34,000	1,741, 423.05	3.36

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。7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投 资明细

金额单位:人民币元

989,384 882,40 736,03 595,239 488,294 HONG KON EXCHANGES & CLEAR 464,32 400,965 363,543 211,032

注, 太期累计工人全额指工人成交全额(成交单价乘以成交数量) 不考虑相关交易费用。 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投

CK HU HOLDINGS LTD

金额单位:人民币元

单位: 人民币元

194,702

本期累计卖出金额

4	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	1038 HK	854,337.99	1.67
5	IMAX CHINA HOLDING INC	1970 HK	749,500.06	1.46
6	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	601,611.40	1.17
7	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	401,852.85	0.78
8	SMARTONE TELECOMMUNICA- TIONS	315 HK	394,430.50	0.77
9	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	371,487.64	0.72
10	NEW WORLD DEVELOPMENT	17 HK	287,080.96	0.56
11	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	259,006.99	0.51
12	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	232,410.44	0.45
13	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	229,285.11	0.45
14	AIA GROUP LTD	1299 HK	177,338.51	0.35
15	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	159,335.38	0.31
16	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	158,811.32	0.31
17	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	1829 HK	152,520.61	0.30
18	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	128,018.89	0.25
19	WHARF HOLDINGS LTD	4 HK	91,538.76	0.18

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注:本项中"买人股票的成本(成交)总额"及"卖出股票的收入(成 交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相

本基金本报告期末未持有债券

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券 投资明细

本基金本报告期末未持有债券

7.8 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。 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融

衍生品投资明组 本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金

本基金本报告期末未持有基金。 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本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内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定 的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金額
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	250,140.78
4	应收利息	662.29
5	应收申购款	9,29249
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	260,095.52

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 7.11.5 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不存在流通受限的情况。 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§ 8 基金份额持有人信息

份额单位:份

《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本 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.4 基金投资策略的改变 基金投资策略在本报告期内没有重大改变

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。

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

注:1、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

(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

(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

(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。 2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商,

平交易制度及保密制度),能满足各投资组合运作高度保密的要求; (五)证券研究或市场研究实力较强,有固定的研究机构和专门研 究人员,能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个

(六)具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、 高质量完成各投资组合下达的交易指令。

(七)具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效 处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

交易量分配计划获批后,作为选择交易券商的依据,供交易员在交 券商服务出现重大失误或其他异常情况时,及时报公司监察稽核部

退租境外交易单元

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

期初份额 持有份额

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

大成基金管理有限公司

关交易费用。 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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

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

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

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员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

96.979 624,124.39

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 定了租用境内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:

(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 市公司调研等研究服务;

具体选择标准如下:

(一)具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、 业务许可证明文件;

股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务,并能根据各投

评价结果,作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配 计划,报部门及公司分管领导批准;

3、本报告期内本基金新增的境内交易单元:海通证券(06172),无

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

单位:份

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

金额单位:人民币元

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

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;

(二)资历雄厚,信誉良好; (三)财务状况良好,经营行为规范; (四)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度(包括但不限于公

资组合投资的特定要求,提供专题研究报告;

(八)能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。 (九)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。 交易管理部在每半年15个交易日内,汇总上半年境外券商综合服务

及相关领导。可暂停与该券商的合作,并对其失误所造成的损失进行追