大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

2018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: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

2.1 基金基本情况

基金简称	大成深证ETF
场内简称	深证ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年6月5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	26,335,342.00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	2015年7月8日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证成份指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种, 其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法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。

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	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	-14,350,802.98
本期利润	-44,787,431.23
加权平均基金份额本期利润	-1.6355
本期基金份额净值增长率	-14.46%
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	-5.8650
期末基金资产净值	263,907,198.83
期末基金份额净值	10.021

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。

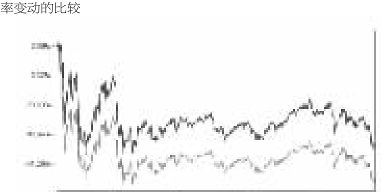
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.43%	1.68%	-8.90%	1.73%	0.47%	-0.05%
过去三个月	-12.88%	1.31%	-13.70%	1.34%	0.82%	-0.03%
过去六个月	-14.46%	1.34%	-15.04%	1.37%	0.58%	-0.03%
过去一年	-9.68%	1.13%	-10.92%	1.15%	1.24%	-0.02%
过去三年	-30.28%	1.74%	-34.58%	1.77%	4.30%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-34.21%	1.76%	-46.41%	1.83%	12.20%	-0.07%

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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。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。

§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。

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		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2015年6月5日	-	14年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月4日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2018年6月26日起担任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍:中国
刘淼女士	本基金基金经理助理	2017年9月14日	-	10年	北京大学MBA。2008年4月至2011年5月任招商基金管理有限公司基金核算部基金会计。2011年5月加入大成基金管理有限公司,历任运营部基金会计、股票投资部风控员兼投委会秘书、数量与指数投资部数量分析师。2017年9月14日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金和中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。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;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。

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。

4.4 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

上半年度,整体宏观经济环境出现了较大的变化,两会和中美贸易摩擦是上半年影响最大的外生变量。两会从顶层确立了我国未来发展的基调,而贸易摩擦则是全球政治、经济环境剧变的集中体现。在剧烈冲击下,国内宏观政策也有较大改变。经济下行压力开始出现,出于维稳的需要,去杠杆、金融监管去趋于温和,财政政策也有更加积极的趋势。此外,人民币相对美元发生了较为明显的贬值,对冲了部分贸易摩擦带来的出口压力,同时也带来了资本外流的隐忧。

上半年股票市场也经历了较大幅度的波动。进入新年后,大盘蓝筹股强势上涨,走出逼空式行情,但行情过度透支,交易极其拥挤,在一系列因素作用下,最终由外围股市下跌引发剧烈调整。之后,市场风格出现逆转,创业板等成长股票指数先企稳,为所谓"独角兽"回归营造了良好的市场氛围。市场盘整一段时间后,最终仍无法承受去杠杆、贸易摩擦等多重压力,继续下挫直至半年末。本报告期市场基准沪深300指数下跌12.90%,大多数行业、板块均有较大幅度的下跌,消费类板块由于其业绩确定性,在弱市中表现出较为优秀的防御特征,其中休闲服务、医药生物、食品饮料行业更是逆市上涨。市场表现出明显的避险特征,基本面稳定的股票由于其确定性,投资者给予了一定的溢价,这也是上半年大市值股票表现较好的原因之一。

本基金标的指数深成指下跌15.04%,跌幅高于大盘。上半年,本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作,严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。上半年年化跟踪误差0.94%,日均偏离度0.03%,各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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10.021元;本报告期基金份额净值增长率为-14.46%,业绩比较基准收益率为-15.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,外部环境和经济政策均面临较大的不确定性。经济基本面短期内不会发生较大变化,但目前国内经济增长质量明显低于政府预期。中美贸易摩擦并没有缓和的迹象,人民币汇率也不稳定,这无疑加大了政策制定的难度。"既要又要"式的复合目标越来越难实现,政府很难兼顾多方面的均衡。在内外多重压力下,短期稳定压倒长期增长,暂时成为优先级更高的目标,货币政策和财政政策保持宽松是必然选择。当内外环境稳定后,为了经济可持续发展,去杠杆、调结构的大趋势仍然不会变。

对于股票市场,下半年的形势更加错综复杂。经济基本面无疑并不会太好,然而经济下行加上外部压力,有可能会倒逼政策,令去杠杆节奏有所放缓。这对刚经历过大跌的股市来说,基本面恶化已经在一定程度上反映在股价里,综合来看反而造成边际改善的短期利好。在货币政策保持宽松的情况下,市场流动性并不紧缺,只要投资者风险偏好提升,即有可能带来一波反弹。

预计下半年市场总体走势应好于上半年。反弹行情若如期出现,其性质仍属于悲观预期修复所带来的超跌反弹。总体而言,之前成长股超跌程度更甚于价值股,部分质地尚可而被市场错杀沦为小市值的股票有望迎来修复行情。成长板块将先于价值板块反弹,强度也相对较高。值得注意的是,即使市场环境有所改善,个股风险依然不能忽视,基本面恶化、股权质押、财务报表等因素造成的个股"地雷"也会陆续爆发,基金经理需要以更高的标准筛选股票。

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、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一大成基金管理有限公司 2018年1月1日至 2018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:大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

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	8,917,082.34	3,888,932.20
结算备付金	11,443.31	3,635.23
存出保证金	2,046.18	3,108.73
交易性金融资产	253,754,312.05	333,415,965.87
其中:股票投资	253,754,312.05	333,087,565.87
基金投资	-	-
债券投资	-	328,400.00
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	1,627,434.55	-
应收利息	1,026.04	837.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	264,313,344.47	337,312,479.81
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	-	190,599.33
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	114,363.54	143,868.13
应付托管费	22,872.71	28,773.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,158.42	4,560.40
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,750.97	315,000.00
负债合计	406,145.64	682,801.48
所有者权益:		
实收基金	401,180,599.42	437,741,105.78
未分配利润	-137,273,400.59	-101,111,427.45
所有者权益合计	263,907,198.83	336,629,678.33
负债和所有者权益总计	264,313,344.47	337,312,479.81

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值10.021元,基金份额总额26,335,342.00份。

6.2 利润表

会计主体:大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

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	-43,462,000.85	17,002,527.12
1.利息收入	15,776.25	13,067.39
其中:存款利息收入	15,750.47	13,067.39
债券利息收入	25.78	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-13,041,148.85	-17,165,054.14
其中:股票投资收益	-14,888,329.61	-19,632,102.04
基金投资收益	-	-
债券投资收益	35,893.09	-
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	1,811,287.67	2,467,047.90
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-30,436,628.25	34,154,513.87
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	1,325,430.31	1,646,384.95
1. 管理人报酬	767,069.11	1,001,257.50
2. 托管费	153,413.87	200,251.56
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	93,816.36	133,874.92
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	311,130.97	311,000.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-44,787,431.16	15,356,142.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-44,787,431.16	15,356,142.17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	437,741,105.78	-101,111,427.45	336,629,678.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-44,787,431.23	-44,787,431.23
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)	-36,560,506.36	8,625,458.09	-27,935,048.27
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-36,560,506.36	8,625,458.09	-27,935,048.27
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)	401,180,599.42	-137,273,400.59	263,907,198.83

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)	620,543,637.48	-185,390,330.30	435,153,307.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,356,142.17	15,356,142.17
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)	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
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)	533,712,434.95	-144,998,114.93	388,714,320.02

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:

______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 会计机构负责人

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、会计估计与最近一期年度报告一致。

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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征收地方教育附加的通告》及其他相关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、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) 对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,股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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

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

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

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	59,764,771.99	100.00%	10,941,368.78	12.48%

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	364,354.52	100.00%	-	0.00%

6.4.4.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.4.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	54,466.00	100.00%	8,158.42	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	9,971.83	12.48%	5,266.82	100.00%

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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	767,069.11	1,001,257.50
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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托管费	153,413.87	200,251.56

注:支付基金托管人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。

6.4.4.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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情况

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

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	8,917,082.34	15,381.38	5,256,360.92	12,484.46

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

无。

6.4.5.2 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	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	17.08	-	-	98,510	1,653,063.90	1,682,550.80	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	52.04	-	-	27,200	2,375,029.75	1,415,488.00	-
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大事项	19.52	-	-	62,020	1,396,383.86	1,210,630.40	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	4.87	-	-	238,426	1,551,144.31	1,161,134.62	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事项	16.12	-	-	64,600	738,373.56	1,041,352.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	15.03	-	-	61,100	701,969.17	918,333.00	-
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项	23.28	2018年7月10日	18.38	38,367	654,770.74	893,183.76	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大事项	6.00	-	-	101,800	540,659.25	610,800.00	-
300146	汤臣倍健	2018年4月4日	重大事项	16.60	2018年7月31日	16.5	34,700	557,721.95	576,020.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项	12.89	2018年7月9日	11.43	43,526	809,175.83	561,050.14	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大事项	19.99	2018年7月2日	11.96	26,890	581,914.45	537,531.10	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.19	82,900	729,756.89	484,136.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项	32.50	-	-	13,739	333,166.91	446,517.50	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项	4.99	2018年7月2日	4.74	86,788	545,280.79	433,072.12	-
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大事项	12.28	-	-	34,900	383,866.37	428,572.00	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	重大事项	14.76	-	-	26,330	326,872.21	388,630.80	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项	19.58	2018年8月21日	17.62	19,400	436,154.38	379,852.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	39,138	373,698.12	371,419.62	-
300090	盛运环保	2018年6月4日	重大事项	8.32	2018年7月2日	7.49	43,100	461,256.11	358,592.00	-
000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事项	4.96	2018年8月7日	4.46	71,200	623,392.97	353,152.00	-
002610	爱康科技	2018年6月5日	重大事项	2.10	-	-	164,400	502,667.67	345,240.00	-
002051	中工国际	2018年4月9日	重大事项	15.27	-	-	22,056	374,974.44	336,795.12	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项	11.55	-	-	28,000	538,807.92	323,400.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项	5.37	-	-	57,645	472,295.87	309,553.65	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项	3.60	2018年7月3日	3.26	83,300	821,074.44	299,880.00	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事项	5.80	-	-	50,310	536,217.97	291,798.00	-
002411	必康股份	2018年6月19日	重大事项	28.34	-	-	10,200	271,947.53	289,068.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事项	18.76	2018年7月2日	16.88	13,720	261,815.35	257,387.20	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事项	18.08	-	-	14,000	269,918.71	253,120.00	-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项	6.71	-	-	37,550	359,670.55	251,960.50	-
000723	美锦能源	2018年3月27日	重大事项	5.43	2018年7月31日	4.89	46,000	315,263.83	249,780.00	-
002716	金贵银业	2018年5月3日	重大事项	16.84	-	-	14,800	339,202.50	249,232.00	-
002668	奥马电器	2018年6月15日	重大事项	20.10	-	-	12,120	265,081.40	243,612.00	-
002089	新海宜	2018年4月20日	重大事项	6.05	2018年7月20日	5.45	40,000	450,103.00	242,000.00	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项	3.31	-	-	71,200	430,843.36	235,672.00	-
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项	10.80	2018年8月7日	9.63	21,300	349,059.69	230,040.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项	6.20	2018年8月13日	5.57	35,200	340,441.64	218,240.00	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	重大事项	4.96	2018年7月2日	4.46	38,000	400,212.81	188,480.00	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项	9.70	-	-	18,800	340,313.08	182,360.00	-
002143	印纪传媒	2018年2月2日	重大事项	12.09	2018年7月9日	10.88	14,660	292,122.09	177,239.40	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事项	7.21	-	-	23,900	212,110.87	172,319.00	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事项	6.40	-	-	23,100	184,288.86	147,840.00	-
300317	珈伟股份	2018年2月5日	重大事项	11.90	2018年7月3日	10.68	12,400	184,695.74	147,560.00	-
000564	供销大集	2017年11月28日	重大事项	4.78	2018年7月20日	4.29	24,400	159,163.93	116,632.00	-
000693	*ST华泽	2018年5月9日	重大事项	1.00	-	-	26,800	517,816.87	26,800.00	-

注: 本基金截至2018年6月30日止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:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	253,754,312.05	96.01
	其中:股票	253,754,312.05	96.01
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	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	8,928,525.65	3.38
7	其他各项资产	1,630,506.77	0.62
8	合计	264,313,344.47	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	5,790,413.28	2.19
B	采矿业	2,201,862.18	0.83
C	制造业	160,751,157.06	60.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,021,336.30	1.14
E	建筑业	4,427,143.37	1.68
F	批发和零售业	6,928,493.95	2.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,755,497.95	0.67
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,187,860.93	9.16
J	金融业	13,859,266.73	5.25
K	房地产业	14,032,349.59	5.32
L	租赁和商务服务业	4,449,586.71	1.69
M	科学研究和技术服务业	276,342.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	2,624,872.64	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	3,476,676.68	1.32
R	文化、体育和娱乐业	4,824,584.06	1.83
S	综合	435,023.00	0.16
	合计	253,042,466.43	95.88

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	-	0.00
B	采掘业	26,800.00	0.01
C	制造业	561,050.14	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,995.48	0.05
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	711,845.62	0.27

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

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	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	193,750	10,117,625.00	3.83
2	000651	格力电器	204,700	9,651,605.00	3.66
3	000858	五 粮 液	78,900	5,996,400.00	2.27
4	002415	海康威视	141,725	5,262,249.25	1.99
5	000002	万 科A	173,300	4,263,180.00	1.62
6	000725	京东方A	1,080,500	3,824,970.00	1.45
7	300498	温氏股份	159,204	3,505,672.08	1.33
8	000001	平安银行	360,000	3,272,400.00	1.24
9	002304	洋河股份	23,962	3,153,399.20	1.19
10	002027	分众传媒	225,288	2,156,006.16	0.82

注:投资者欲了解本报告期末本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	占基金资产净值比例(%)
1	000566	海南海药	43,526	561,050.14	0.21
2	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.05
3	000693	*ST华泽	26,800	26,800.00	0.01

注:投资者欲了解本报告期末本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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300618	寒锐钴业	1,267,335.00	0.38
2	002027	分众传媒	1,081,520.17	0.32
3	000830	鲁西化工	846,074.44	0.25
4	300628	亿联网络	737,322.00	0.22
5	002594	比亚迪	726,696.00	0.22
6	000401	冀东水泥	683,411.61	0.20
7	002035	华帝股份	677,445.80	0.20
8	000040	东旭蓝天	614,146.61	0.18
9	000591	太阳能	523,442.00	0.16
10	000717	韶钢松山	520,133.00	0.15
11	002497	雅化集团	516,684.00	0.15
12	002359	北讯集团	467,546.00	0.14
13	300316	晶盛机电	462,357.00	0.14
14	000413	东旭光电	452,687.00	0.13
15	002597	金禾实业	422,304.27	0.13
16	002475	立讯精密	409,861.00	0.12
17	000703	恒逸石化	405,290.00	0.12
18	002745	木林森	405,112.00	0.12
19	002841	视源股份	396,535.00	0.12
20	000981	银亿股份	382,806.00	0.11

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300104	乐视网	586,672.00	0.17
2	000697	炼石有色	537,478.00	0.16
3	002926	华西证券	502,620.96	0.15
4	000651	格力电器	502,610.00	0.15
5	000503	国新健康	479,067.00	0.14
6	300618	寒锐钴业	460,709.00	0.14
7	300750	宁德时代	453,653.00	0.13
8	000725	京东方A	419,052.00	0.12
9	000002	万 科A	378,071.00	0.11
10	000858	五 粮 液	342,485.00	0.10
11	002630	华西能源	338,678.00	0.10
12	000518	四环生物	332,905.00	0.10
13	300628	亿联网络	331,205.00	0.10
14	000601	韶能股份	330,910.80	0.10
15	002104	恒宝股份	320,609.00	0.10
16	000001	平安银行	312,576.00	0.09
17	300498	温氏股份	304,316.00	0.09
18	002067	景兴纸业	301,404.09	0.09
19	002251	步 步 高	291,532.00	0.09
20	002916	深南电路	288,554.52	0.09

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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	26,829,976.19
卖出股票收入(成交)总额	34,033,555.15

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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

本基金本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投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券之一平安银行(000001)的发行主体平安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〕2号)。本基金认为,对平安银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.12.2 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	2,046.18
2	应收证券清算款	1,627,434.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,026.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,630,506.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000566	海南海药	561,050.14	0.21	临时停牌
2	000693	*ST华泽	26,800.00	0.01	临时停牌

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
7,629	3,452.00	328,592.00	1.25%	26,006,750.00	98.75%

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	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.76%
2	林莹	197,096.00	0.75%
3	贺雅宁	196,965.00	0.75%
4	寇胜利	196,694.00	0.75%
5	吕君	160,000.00	0.61%
6	张小丽	143,146.00	0.54%
7	靳艳华	140,369.00	0.53%
8	谢元禄	131,444.00	0.50%
9	刘小彦	131,310.00	0.50%
10	黎倩嫔	131,306.00	0.50%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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的情况

无。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年6月5日)基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	28,735,342.00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	2,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	26,335,342.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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动

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动。

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。

10.4 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。

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。

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

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	59,764,771.99	100.00%	54,466.00	100.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	2	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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:

(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;

(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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下:

本报告期内增加基金交易单元:无。本报告期内退租基金交易单元:英大证券。

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	364,354.52	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

§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《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托管人协商一致,对本基金基金合同的有关条款进行了修改,主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、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,具体内容详见2018年3月27日基金管理人网站披露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
2018年8月29日