大成积极成长混合型证券投资基金 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	大成积极成长混合
基金主代码	519017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月16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	926,962,691.71份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在优化组合投资基础上,主要投资于有良好成长潜力的上市公司,尽可能规避投资风险,谋求基金财产长期增值。
投资策略	本基金主要根据GDP增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数CPI增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标以及国家政策的变化,对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量、定性分析,作出资产配置决策。本基金还力争通过财务指标分析、成长型筛选、估值比较、实地调研等深入、科学的基本面分析,挖掘具有良好成长性的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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	31,284,389.90
本期利润	-123,067,643.07
加权平均基金份额本期利润	-0.1325
本期基金份额净值增长率	-12.20%
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	-0.0443
期末基金资产净值	885,864,386.47
期末基金份额净值	0.956

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。

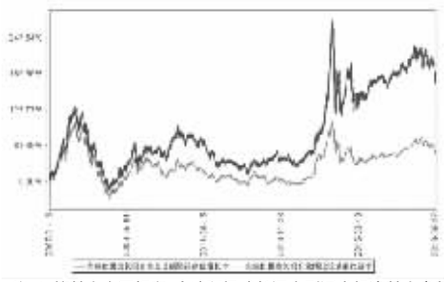
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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%	1.55%	-6.04%	1.02%	-2.39%	0.53%
过去三个月	-8.25%	1.31%	-7.61%	0.91%	-0.64%	0.40%
过去六个月	-12.20%	1.33%	-9.63%	0.92%	-2.57%	0.41%
过去一年	-7.60%	1.16%	-2.44%	0.76%	-5.16%	0.40%
过去三年	-2.23%	1.65%	-14.65%	1.19%	12.42%	0.46%
自基金合同生效起至今	172.03%	1.64%	50.98%	1.44%	121.05%	0.20%

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、按基金合同规定,大成积极成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。建仓期结束时,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的比例。

2、本基金业绩比较基准自2009年2月2日起变更为:沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%,本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2007年1月15日(基金合同生效暨基金转型日)至2009年2月1日为原业绩比较基准(新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%)的走势图,2009年2月2日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

§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	任本基金基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
田慧	基金经理	2017年4月6日	-	15年	经济学硕士。2003年5月至2007年10月曾任证券时报社公司新闻编辑记者、信托证券投资部投资业务董事、国投证券投资部投资经理。2007年10月加盟长信基金管理有限公司担任基金经理,管理长信金利趋势、长信利息收益、长信利息收益A、长信利息收益B、长信利息收益C、长信利息收益H、长信利息收益E、长信利息收益F、长信利息收益G、长信利息收益I、长信利息收益J基金的投资管理。2010年2月1日至2010年5月31日担任长信利息收益H、长信利息收益E、长信利息收益F、长信利息收益G、长信利息收益I、长信利息收益J基金的投资管理。2010年2月1日至2010年5月31日担任长信利息收益H、长信利息收益E、长信利息收益F、长信利息收益G、长信利息收益I、长信利息收益J基金的投资管理。2010年11月1日起担任长信利息收益H、长信利息收益E、长信利息收益F、长信利息收益G、长信利息收益I、长信利息收益J基金的投资管理。2011年4月1日起担任长信利息收益H、长信利息收益E、长信利息收益F、长信利息收益G、长信利息收益I、长信利息收益J、长信利息收益A、长信利息收益B、长信利息收益C基金的投资管理。2012年3月31日起担任长信利息收益H、长信利息收益E、长信利息收益F、长信利息收益G、长信利息收益I、长信利息收益J、长信利息收益A、长信利息收益B、长信利息收益C、长信利息收益D基金的投资管理。2013年7月17日至2014年5月31日担任长信利息收益基金的投资管理。2013年11月4日至2016年3月31日担任大成可转债债券型证券投资基金的基金经理。2014年8月29日至2016年3月31日担任大成景盛平稳债券型证券投资基金的基金经理。2014年10月30日至2016年3月31日担任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2014年12月30日至2016年3月31日担任大成景和稳债券型证券投资基金的基金经理。2015年7月31日起担任大成中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。2016年11月11日起担任大成国民经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月14日起担任大成新蓝筹混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月14日起担任大成灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月21日起担任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月1日起担任大成研究精选股票型证券投资基金的基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国	2017年4月6日
张文先生	基金经理;基金经理助理;本基金投资决策委员会委员;固定收益投资部总监	2016年5月26日	2018年3月12日	8年	南京大学理学硕士,注册会计师,证券从业资格证。2006年3月至2011年5月就职于华夏基金管理有限公司审计部,2011年3月加入大成基金管理有限公司,曾任固定收益研究部研究员,现任固定收益研究部副总监。2012年11月26日至2016年3月31日担任大成景丰纯债债券型证券投资基金的基金经理。2013年3月11日至2016年3月31日担任大成可转债债券型证券投资基金的基金经理。2013年4月26日至2016年3月31日担任大成景利纯债债券型证券投资基金的基金经理。2013年6月21日至2016年3月31日担任大成景和纯债债券型证券投资基金的基金经理。2013年7月12日至2017年1月10日担任大成景利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2013年7月31日至2016年3月31日担任大成景丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2013年8月29日至2016年3月31日担任大成景和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2013年10月29日至2016年3月31日担任大成景盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2014年6月30日至2016年3月31日担任大成景利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2014年8月29日至2016年3月31日担任大成景平稳债券型证券投资基金的基金经理。2014年10月30日至2016年3月31日担任大成景丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年11月26日至2016年3月31日担任大成景和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年5月20日至2016年3月31日担任大成新蓝筹混合型证券投资基金的基金经理。2016年5月30日至2016年3月31日担任大成灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国	6年
孙丹丹女士	基金经理;基金经理助理	2016年1月12日	-	10年	经济学硕士。2008年至2012年就职于摩根士丹利华鑫证券有限责任公司,担任证券投资顾问;2012年至2014年就职于华夏基金管理有限公司,担任投资经理;2014年5月加入大成基金管理有限公司,历任固定收益研究部研究助理、研究员、高级研究员。2017年5月31日起担任大成景丰纯债债券型证券投资基金、大成景利纯债债券型证券投资基金的基金经理。2017年6月30日至2018年5月30日担任大成景安短债债券型证券投资基金的基金经理。2017年6月30日起担任大成景和纯债债券型证券投资基金、大成景盛纯债债券型证券投资基金、大成景睿纯债债券型证券投资基金、大成景利纯债债券型证券投资基金、大成景丰纯债债券型证券投资基金、大成景平稳纯债债券型证券投资基金、大成景惠纯债债券型证券投资基金、大成景益纯债债券型证券投资基金的基金经理。2017年6月30日起担任大成景和灵活配置混合型证券投资基金、大成景利灵活配置混合型证券投资基金、大成景丰灵活配置混合型证券投资基金、大成景盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年5月30日至2018年6月30日担任大成景惠灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年5月30日起担任大成景惠灵活配置混合型证券投资基金、大成景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国	2018年6月29日

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

2018年上半年, 国内A股市场呈现了较为明显的波动。在第一季度前期,市场延续了2017年低估值、高确定性的蓝筹股行情,银行、家电、房地产、食品饮料等行业表现较好。但进入2月份之后,由于国家鼓励科技创新的一系列政策出台,以及受鼓励部分高科技及互联网企业回归国内A股市场的政策影响,以计算机、通信、医药为代表的科技类企业出现了较大幅度涨幅,而与此对应的是,传统的周期类企业,以及去年涨幅较大的大型蓝筹股,则出现一定幅度下跌。进入第二季度之后,国际经济和政治环境发生了较大幅度变化。美国所发起的贸易战,以及美国政府在谈判过程中所呈现的反复无常的政策特征,给A股市场的预期造成了极大扰动。同时,国内为了化解金融风险,降低整体杠杆率所采取的去杠杆政策和资管新规等政策均在稳步推进,客观上也改变了股票市场预期。二季度A股市场整体表现较为弱势, 各大主要市场指数均有一定幅度下跌,从行业表现来看,除了白酒等少数几个行业表现相对较好,其他行业在第二季度表现一般。

2018年上半年中证100指数下跌11.77%,上证50指数下跌13.30%,上证综指下跌13.90%,创业板指数下跌8.33%。上半年本产品受市场整体指数下跌影响,净值有所下跌。

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0.956元; 本报告期基金份额净值增长率为-12.20%,业绩比较基准收益率为-9.63%。

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年下半年,我们认为,国家前期的去杠杆政策已经取得明显成效,未来货币政策将逐步转向中性,同时财政政策将更加积极。预计下半年国家将在基础设施,消费、民生、科技创新等领域加大政策扶持力度。具体行业选择上,大众消费、科技创新、社会服务、医药、家电等投资主题和行业将是我们所重点关注的投资领域。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

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;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。本报告期内已分配利润118,920,041.38元(每十份基金份额分红1.340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:大成积极成长混合型证券投资基金
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	148,049,659.49	108,065,089.33
结算备付金	2,184,844.43	2,119,176.92
存出保证金	524,616.91	802,558.99
交易性金融资产	738,047,482.36	952,865,061.36
其中:股票投资	738,047,482.36	952,865,061.36
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	-	49,970,194.96
应收证券清算款	-	-
应收利息	26,083.56	59,968.99
应收股利	-	-
应收申购款	146,996.55	39,229.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	891,864,195.94	1,116,805,793.08
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	-	5,469,030.50
应付赎回款	224,940.43	297,345.17
应付管理人报酬	1,149,987.65	1,397,994.36
应付托管费	191,664.60	232,999.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,049,064.51	1,057,561.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,384,152.28	3,485,745.41
负债合计	5,999,809.47	11,940,675.60
所有者权益:		
实收基金	926,962,691.71	903,276,023.98
未分配利润	-41,098,305.24	201,589,093.50
所有者权益合计	885,864,386.47	1,104,865,117.48
负债和所有者权益总计	891,864,195.94	1,116,805,793.08

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币0.956元,基金份额总额926,962,691.71份。

6.2 利润表

会计主体:大成积极成长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

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	-109,485,610.52	148,060,320.41
1.利息收入	478,280.34	1,002,084.08
其中:存款利息收入	472,152.14	711,285.87
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	6,128.20	290,798.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	44,346,332.74	64,811,856.13
其中:股票投资收益	37,143,124.03	55,103,342.51
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	7,203,208.71	9,708,513.62
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-154,352,032.97	82,013,271.17
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	41,809.37	233,109.03
减:二、费用	13,582,032.55	14,007,352.56
1. 管理人报酬	7,370,990.50	9,168,677.95
2. 托管费	1,228,498.44	1,528,112.99
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,757,755.04	3,078,033.59
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	224,788.57	232,528.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-123,067,643.07	134,052,967.85
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-123,067,643.07	134,052,967.85

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成积极成长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

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		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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)	903,276,023.98	201,589,093.50	1,104,865,117.48	1,122,110,449.31	103,476,122.54	1,225,586,571.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-123,067,643.07	-123,067,643.07	-	134,052,967.85	134,052,967.85
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)	23,686,667.73	-699,714.29	22,986,953.44	-122,351,053.21	-13,266,156.79	-135,617,210.00
其中:1.基金申购款	105,240,586.54	9,614,577.88	114,855,164.42	120,879,530.76	9,264,491.62	130,144,022.38
2.基金赎回款	-81,553,918.81	-10,314,292.17	-91,868,210.98	-243,230,583.97	-22,530,648.41	-265,761,232.38
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)	-	-118,920,041.38	-118,920,041.38	-	-62,191,825.80	-62,191,825.80
五、期末所有者权益(基金净值)	926,962,691.71	-41,098,305.24	885,864,386.47	999,759,396.10	162,071,107.80	1,161,830,503.90

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代征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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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	286,529,186.21	9.14%	287,772,190.06	14.46%

6.4.4.1.2 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	261,121.21	9.14%	213,804.76	20.38%
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	262,252.61	14.46%	19,706.10	2.37%

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	7,370,990.50	9,168,677.95
其中:支付销售机构的客户维护费	1,349,551.86	1,442,171.04

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1.5%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 1.5% / 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	1,228,498.44	1,528,112.99

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0.25%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 X 0.25% / 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。

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	148,049,659.49	445,361.99	109,896,467.17	693,564.63

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

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

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

金额单位:人民币元

6.4.8.1.1 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
601138	工业富联	2018年5月28日	2019年6月10日	新股流通受限	13.77	16.40	703,067	9,681,232.59	11,530,298.80	-
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

注:1、基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《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/上海证券交易所上市公司股东及董事、