

大成竞争优势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。本基金年度报告第三部分之一以上独立董事签字证明，并由董事长签发。

基金管理人和基金托管人根据基金合同规定，对本基金年度报告所载资料的内容进行核查，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本年度报告摘要概要简述半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成竞争优势混合
基金主代码	000013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4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
报告期末基金总资产	557,047,260.00
报告期末基金份额总额	不适用

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于具有持续竞争优势的行业，追求基金资产长期增值。
通过宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等要素“自下而上”的量级和行业分析，评估各类资产的投资价值，各资产价值的趋势变化，确定组合中股票、债券等各资产的配置比例。	
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证综合指数
风险收益特征	本投资组合风险收益水平高于混合基金，风险和货币市场基金。
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	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	赵冰	郭明
信息披露负责人	赵冰	郭明
客户服务电话	0755-83118338 010-66106708 0955-86666668	010-66106708 0955-86666668
客户服务电话	0755-83119668 010-66106709	

2.4 信息披露方式	基金管理人通过公告形式披露信息。基金管理人公告的披露方式包括但不限于：网站（http://www.dcfund.com.cn）、报纸、基金份额持有人会议、基金份额持有人大会。
登载基金半年度报告的公告页码	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备查地点	基金管理人住所地

§ 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日至2018年6月30日(元)
本期已实现收益	71,469,530.06
本期利润	-91,033,082.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1290
本期基金份额净值增长率为	-10.06%
3.1.2 期末数据指标	报告期末2018年6月30日
期末可供分配基金份额利润	0.02426
期末基金份额净值	692,105,621.87
期末基金份额净值	1.243

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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扣除相关费用后的余额。

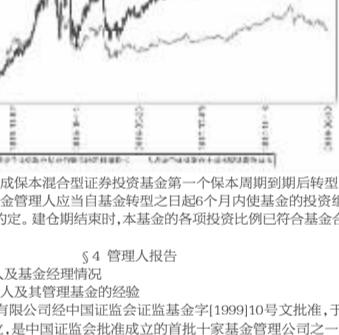
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率为(%)	份额净值增长率为(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去一个月	-5.08%	1.34%	-0.63%	0.96%	-0.26%
过去三个月	-7.03%	0.09%	0.00%	0.20%	-0.29%
过去六个月	-10.00%	1.11%	-0.93%	0.80%	-1.23%
过去一年	6.79%	0.93%	-1.98%	0.71%	8.77%
过去二年	23.74%	1.67%	-13.00%	1.12%	36.74%
自基金合同生效以来	53.60%	1.17%	82.30%	0.48%	

3.2.2 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:本基金由大成基金混合型证券投资基金第一个保本期到期后转型而来。按基金合同规定,基金管理人应当在基金转型之日起6个月内将基金的投资组合比例符合基金合同的约定,建仓期结束时,本基金的各项投资比例已符合基金合同的规定。

§ 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情况

4.1.2 基金管理人及其管理基金的经营情况

4.2 基金经理对报告期内本基金运作遵规守信的情况的说明

报告期内,基金管理人严格遵守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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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 公平交易行为的专项说明

4.3.1 公平交易行为的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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 对公司内部公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易行为的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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 报告期内基金的偏离度情况

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.3 对公司内部控制制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.4 对公司公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.5 对公司异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.6 对公司内幕交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.7 对公司关联交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.8 对公司重大关联交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.9 对公司高级管理人员、基金经理等从业人员证券投资情况的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.10 对公司异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.11 对公司内幕交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.12 对公司不公平交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合在一定时间内变动导致个别组合间的交易价格存在一定差异,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。

4.4.13 对公司利益输送行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格按照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连续1个交易日内、3个交易日内及6个交易日内股票及债券的同向交易情况进行分析。分析结果表明:基金经理同向交易频率较低;股票同向交易的买卖差额主要来源于个股(即个股当日价格振幅较大)及组合经交易对手选择,因投资策略需要,主动型投资组合与指数型