大成蓝筹稳健证券投资基金 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	大成蓝筹稳健混合
基金主代码	090003
前端交易代码	090003
后端交易代码	091003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月3日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,053,074,305.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券,在控制市系统风险的前提下获取投资收益,同时辅助运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例;行业配置采取权重分析为核心的策略,以投资基本的行业权重为基础,以行业研究及比较分析为核心;通过这时期大成降低相应行业的投资权重,使整体投资表现跑上或超越投资基准;个股选择策略将采用优势股选策略为核心选策略,运用“价值+势头”选股方法,优选出被市场低估并有良好市场表现,处于价值回归期的无和200指数成分股投资;债券投资采用完全积极的投资策略,采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、新利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略。
业绩比较基准	天相280指数×70%+中债综合指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与收益水平低于股票型基金,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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑沐	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888666	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

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	48,657,520.67
本期利润	-235,220,237.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0667
本期基金份额净值增长率	-6.44%
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	-0.1388
期末基金资产净值	3,490,556,850.49
期末基金份额净值	0.8612

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。

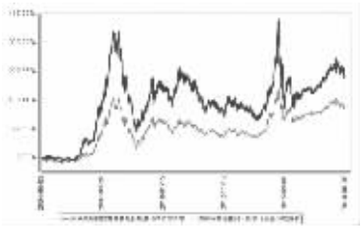
3.2 基金净值表现

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	-6.63%	1.30%	-6.12%	0.91%	-1.51%	0.39%
过去三个月	-7.79%	1.16%	-6.32%	0.81%	-1.47%	0.35%
过去六个月	-6.44%	1.17%	-8.09%	0.82%	1.65%	0.35%
过去一年	1.46%	0.93%	-0.70%	0.68%	2.16%	0.25%
过去三年	-14.54%	1.75%	-10.15%	1.05%	-4.39%	0.70%
自基金合同生效起至今	276.27%	1.60%	162.15%	1.22%	114.12%	0.38%

注:根据《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2015 年9月14 日起,由“70%×天相280指数+30%×中信标普国债指数”变更为“70%×天相280指数+30%×中债综合指数”;基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》,本基金投资股票比例为基金资产净值的30%-95%,投资债券比例为基金资产净值的0%-65%, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,法律法规另有规定时从其规定。

§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

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		
侯春燕女士	本基金基金经理	2015年12月9日	-	8年	经济学硕士,2010年6月加入大成基金管理有限公司。历任研究员、基金经理助理。2015年12月16日起担任大成蓝筹稳健证券投资基金经理。2017年1月18日起担任大成券债主题混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金经理。2017年12月11日起担任大成新锐产业混合型证券投资基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
张文平先生	本基金基金经理助理、固收研究部(兼属固定收益总部)副总监	2016年5月23日	2018年3月12日	6年	南京大学管理学硕士,注册会计师,证券从业资格6年。2009年10月至2011年7月就职于华马城会计师事务所分公司审计部;2011年起加入大成基金管理有限公司,曾任固定收益部助理研究员,现任固定收益总部研究部副总。2013年11月26日至2015年3月13日担任大成稳祥分级债券型证券投资基金经理助理。2015年4月9日至2016年11月18日担任大成稳祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015年6月23日至2018年7月16日任大成景颐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月11日至2017年3月18日任大成完全实施内容证券投资基金基金经理。2015年7月11日至2018年3月16日任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015年11月24日至2018年3月16日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月23日至2018年3月16日任大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成稳健增值混合型证券投资基金、大成景眼领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金和大成优选混合型证券投资基金基金经理助理。2016年8月16日至2018年3月16日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日至2018年3月16日任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2016年9月6日至2018年3月16日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2016年10月20日至2018年3月16日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国。
孙丹女士	本基金基金经理助理	2018年3月12日	-	10年	经济学硕士,2008年至2012年就职于景顺长城产品开发部产品经理;2012年至2014年就职于华夏基金机构债券投资部研究员;2014年5月加入大成基金管理有限公司,历任固定收益部信用策略、宏观利率研究员。2017年5月11日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景怡信用债债券型证券投资基金基金经理。2017年5月8日至2018年5月25日任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2017年5月31日起担任大成嘉裕定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年6月21日起担任大成景星灵活配置混合型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景耀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月6日起担任大成嘉时定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018年3月12日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成稳健增值混合型证券投资基金、大成景眼领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。2018年3月14日起担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景祥灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年5月28日起担任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。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

今年上半年市场波动较大,但是本基金仓位和持仓和年初相比基本保持不变,其中优质制造和医药板块的个股选择取得了显著的正收益,但低估了乘用车行业景气下行的压力,相关个股亏损较多。

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0.8612元;本报告期基金份额净值增长率为-6.44%,业绩比较基准收益率为-8.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

不论宏观经济如何波动,我们持续跟踪研究各个行业内优秀的公司,落脚点在于这些公司是否致力于提升产品的竞争力,是否持续研发投入提升自身的效率,是否在组织结构上能吸引优秀的人才聚集等等。在研究过程中,我们看到了一些积极的信号,企业核心竞争力的形成是一个长期的过程,我们保持密切跟踪,以期为持有人取得较好的收益。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在大成蓝筹稳健证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:大成蓝筹稳健证券投资基金

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	290,825,958.26	329,264,179.39
结算备付金	3,112,602.19	2,978,638.32
存出保证金	317,868.76	490,845.82
交易性金融资产	3,203,457,151.97	3,543,368,772.88
其中:股票投资	3,203,457,151.97	3,543,368,772.88
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	-	199,917,419.88
应收证券清算款	-	-
应收利息	57,431.77	206,074.88
应收股利	-	-
应收申购款	73,456.42	61,067.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,497,844,469.37	4,076,285,985.44
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	-	100,049,985.90
应付赎回款	676,328.50	1,467,900.01
应付管理人报酬	4,474,062.12	5,085,569.03
应付托管费	745,677.01	847,593.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	916,937.89	2,172,276.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	474,613.36	602,967.75
负债合计	7,297,618.88	110,226,292.22
所有者权益:		
实收基金	4,053,074,305.49	4,308,630,234.05
未分配利润	-562,517,456.00	-342,570,630.83
所有者权益合计	3,490,556,850.49	3,966,059,703.22
负债和所有者权益总计	3,497,844,469.37	4,076,285,985.44

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币0.8612元,基金份额总额4,053,074,305.49份。

6.2 利润表

会计主体:大成蓝筹稳健证券投资基金

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	-198,402,595.63	569,602,663.54
1.利息收入	1,590,088.86	3,072,939.68
其中:存款利息收入	1,313,191.12	1,434,489.59
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	276,817.74	1,638,440.09
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	83,703,779.91	390,627,325.02
其中:股票投资收益	56,158,680.40	353,375,274.41
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	28,545,099.51	37,252,050.62
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-283,877,758.62	165,763,149.20
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	181,374.22	139,249.63
减:二、费用	36,817,642.32	41,979,683.73
1. 管理人报酬	28,508,090.56	27,462,966.62
2. 托管费	4,751,348.93	4,577,159.49
3. 销售服务费		
4. 交易费用	3,306,158.37	9,664,014.87
6. 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	253,041.46	275,542.75
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-235,220,237.96	517,622,979.81
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-235,220,237.96	517,622,979.81

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成蓝筹稳健证券投资基金

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)	4,308,630,234.05	-342,570,530.83	3,966,059,703.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-235,220,237.96	-235,220,237.96
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)	-255,555,928.56	15,273,313.78	-240,282,614.78
其中:1.基金申购款	36,104,812.69	-2,567,388.20	33,537,424.49
2.基金赎回款	-291,660,741.25	17,840,701.98	-273,820,039.27
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)	4,053,074,305.49	-562,517,456.00	3,490,556,850.49
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)	4,860,177,417.62	-1,266,431,169.03	3,593,746,248.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	517,622,979.81	517,622,979.81
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)	-211,703,164.62	46,131,910.30	-165,571,254.32
其中:1.基金申购款	21,821,872.60	-4,956,834.53	16,865,038.07
2.基金赎回款	-233,525,037.22	51,088,744.83	-182,436,292.39
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)	4,648,474,253.00	-702,676,278.92	3,945,797,974.08

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相一致。

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[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,包括买卖债券的差价收入,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。

(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

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	400,139,720.70	18.47%	1,440,103,974.47	22.75%

6.4.4.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.4.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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	364,648.30	18.47%	113,693.88	12.42%
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	1,312,358.41	22.75%	896,076.51	27.16%

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	28,508,090.56	27,462,966.62
其中:支付销售机构的客户维护费	5,636,281.30	5,404,984.46

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×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	4,751,348.93	4,577,159.49

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×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各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
中国银行	290,825,958.26	1,293,868.52	251,179,154.83	1,381,684.28

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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

本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

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
002352	顺丰控股	2017年8月22日	2018年8月23日	非公开发行流通受限	35.19	44.24	994,600	34,999,974.00	44,001,104.00	-
002352	顺丰控股	2017年8月22日	2019年8月23日	非公开发行流通受限	35.19	41.96	994,601	35,000,009.19	41,723,511.96	-

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、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的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受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份, 在受让后6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公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

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
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	38.03	-	-	451,700	23,577,106.68	17,178,151.00	-

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	3,203,457,151.97	91.58
	其中:股票	3,203,457,151.97	91.58
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	293,938,561.45	8.40
7	其他各项资产	448,756.95	0.01
8	合计	3,497,844,469.37	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合7.2.1 报告期末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	采矿业	86,574,610.03	2.48
C	制造业	1,662,263,813.66	47.62
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	202,704,727.59	5.81
G	交通运输、仓储和邮政业	85,724,615.95	2.46
H	住宿和餐饮业	46,718,474.88	1.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	613,457,052.00	17.57
K	房地产业	186,368,183.25	5.34
L	租赁和商务服务业	234,307,430.28	6.71
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