

大成可转债增强债券型证券投资基金

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 重要提示及目录

1.1 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, 应阅读半年报报告正文。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 21 其全其木樗낂

2.1 2532257411100	
基金简称	大成可转债增强债券
基金主代码	090017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月30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	37,286,962.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品况明	
投资目标	在严格控制投资风险。保持资产能动生的前提下,采取目上而下的资产配置镇略和目下而上的个券选择 策略,通过主动投资组合管理,充分把握可转债兼具 股性和储性的风险收益特征,追求投资资金的长期保 值增值。
投资策略	本基金主型投资于可申债等限定收益发资产。在局级 基金资产收益安全与建立的时间。以有限的风速的 增级股票市场的上级效益。基本命年基金合同均定 均均变值国对结合定性以及企业分析。目上可以 施整体资产配置策略,通过对国内外发现经济失及 证券市场更少,市场利量类别及开市场全球决 况。但用风险变化情况和有关改资法律法规等实践的 综合分析,例则各大效劳工未收起素变化情况。在 不同的大效资产之间进行动态物器和优化。以规量市 场风池、把随市场位使化、上规量市
业绩比较基准	中信标普可转债指数×60%+中债综合指数×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金产品,属证券投资基金中的低风 酸收益品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基 金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资 于可转换债券(含可分离交易可转债),在债券型基 金中属于风险,本年机效底的投资产品。

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	郭明
信息披露负责人	联系电话	0755-83183388	010-66105798
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105799
2.4 信息扱	露方式		•
come to dealer a color a color	the of the boat of	ode-over 1 comment t	

基金托管

2.1 口心が及時フリエ	
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	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行托管业务罩
《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

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	-2,724,364.40
本期利润	-3,296,195.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0862
本期加权平均净值利润率	-7.67%
本期基金份额净值增长率	-7.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-6,785,727.03
期末可供分配基金份额利润	-0.1820
期末基金资产净值	39,228,527.42
期末基金份额净值	1.052

(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。

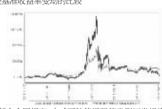
2、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配 利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)

3、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。

3.2.1 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	-3.66%	0.95%	-1.64%	0.47%	-2.02%	0.48%
过去三个月	-5.48%	0.91%	-2.81%	0.40%	-2.67%	0.51%
过去六个月	-7.80%	0.93%	0.15%	0.46%	-7.95%	0.47%
过去一年	-9.62%	0.75%	-1.55%	0.39%	-8.07%	0.36%
过去三年	-39.19%	1.27%	-12.43%	0.87%	-26.76%	0.40%
自基金合同 生效起至今	6.19%	1.35%	18.88%	0.83%	-12.69%	0.52%

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 期业结比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,大成可转债增强债券型证券投资基金自基金 合同生效之日起6个月内使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 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

11.4	anna da	任本基金的基金	经理(助理)期限	证券从	
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	说明
赵 世 宏 先生	本基理	2016年3月26日	-	74	营营学硕士、2011年31 至 2011年31 至 2011年31 至 2011年41 至 2011年41 列 2011年51 列

注:1、李富强先生自2018年7月16日起任本基金基金经理。赵世宏 先生自2018年7月20日起不再担任本基金基金经理。上述事项已按法规 要求及公司相关制度办理,变更流程合法合规。

2、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。 3、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

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,经济运行总体平稳,基建投资增速持续下降、社会 消费品零售总额下行趋势明显,中美贸易战持续发酵,宏观经济仍有下 滑压力。资管新规落地,非标受资管新规的影响新增融资急剧下降,5月 6月社会融资总量特别是实体经济中长期新增融资量下滑明显。信用事 件频发,股市下跌,部分企业融资困难。货币政策边际放松,央行通过定 向降准缓解市场资金压力,银行间市场资金面相对宽松,财政政策发力

仍有较大空间,利率债到期收益率大幅下行,信用债信用利差相对扩大 组合操作上,本基金根据市场变化灵活调整了权益仓位,主要配置 于高景气度的细分行业优质龙头公司。债券操作方面,精选中高等级信 用个券以获得较高的持有期回报,同时逢低配置了部分利率品种。

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1.052元;本报告期基金份额净值增长率为-7.80%,业绩比较基准收益率为0.15%。 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,"在保持宏观政策稳定的同时,财政金融政策要协同 发力"将成为下半年政策主线。货币政策已经实质性转松,流动性合理 充裕,从国内的基本面出发,看不到收紧的必要性。目前看金融监管政策 定力还比较强,三年攻坚战,预计观察到实体经济实质严重的后果前不 太可能有方向的调整,至多是节奏和细节的微调。上半年财政政策收的 很紧,下半年政策会相对有所放松。按照国务院常务会议精神下半年中 央财政大概率会有一些调整。贸易战小范围正式开打,市场已经有一定 预期,下半年还将持续。经济下行压力仍在,货币政策宽松的基础仍存。 下半年通胀仍没有太大压力,PPI回落的幅度可能对下半年走势有一定

投资操作上,权益资产将继续注重自上而下挖掘投资机会,并密切 关注市场回调带来的机会,选取符合最新政策导向、盈利确定向好、估值 具备安全边际的品种进行重点配置。债券类操作以规避信用风险并保持 适度的信用久期为主,利率债方面市视市场机会适时进行波段操作。可 转债方面选择具有安全边际且具有较好基本面和股价上升前景的券种 适当配置。

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

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

本基金在本报告期内,曾出现了连续60个工作日资产净值低于五千 万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案 上报中国证券监督管理委员会。

§ 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,本基金托管人在对大成可转债增强债券型证券投资基 金的托管过程中,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

分配等情况的说明

本报告期内,大成可转债增强债券型证券投资基金的管理人一 成基金管理有限公司在大成可转债增强债券型证券投资基金的投资运 作 其全资产净值计管 其全份麵由廠區 |价格计算、基金费用开支等问 题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运 作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,大成可转债增强债券型 证券投资基金未进行利润分配。

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 发表意见

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可转债 增强债券型证券投资基金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 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:大成可转债增强债券型证券投资基金 报告截止日: 2018年6月30日

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	723,242.20	509,934.68
结算备付金	149,557.69	265,971.87
存出保证金	17,007.02	17,630.68
交易性金融资产	35,298,932.69	44,069,559.13
其中:股票投资	2,405,880.51	7,156,479.20
基金投资	-	
债券投资	32,893,052.18	36,913,079.93
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	6,000,000.00	1,400,000.00
应收证券清算款	104,216.25	
应收利息	95,142.37	266,916.58
应收股利	-	
应收申购款	19,659.00	33,391.49
递延所得税资产	-	
其他资产	-	
资产总计	42,407,757.22	46,563,404.43
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	3,000,000.00	300,000,000
应付证券清算款	-	110,335.64
应付赎回款	10,839.87	10,928.83
应付管理人报酬	32,647.16	38,772.61
应付托管费	6,529.45	7,754.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	20,414.12	23,074.49
应交税费	43,078.60	42,682.00
应付利息	1,255.64	297.99
並付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	64,464.96	140,038.70
负债合计	3,179,229.80	673,884.7
所有者权益:		
实收基金	37,286,962.24	40,217,827.04
未分配利润	1,941,565.18	5,671,692.6

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币1.052元 基金份额总额37286962.24份。

会计主体:大成可转债增强债券型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

42.407.757.

46,563,404,43

180,128. -1,565,480 82,240.

-571,831 1,524,386. 销售服务费 税金及附加 3 296 195

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:大成可转债增强债券型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

			十四・ハイレ
项目	2018年	本期 F1月1日至2018年6月30	E
	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)	40,217,827.04	5,671,692.68	45,889,519.72
二、本期经营活动产生 约基金净值变动数(本 引利润)	-	-3,296,195.77	-3,296,195.77
三、本期基金份额交易 生的基金净值变动 女 (净值减少以"-" 号填列)	-2,930,864.80	-433,931.73	-3,364,796.53
其中:1.基金申购款	1,068,610.65	138,760.73	1,207,371.38
基金赎回款	-3,999,475.45	-572,692.46	-4,572,167.91
日、本期向基金份额持 百人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 b以"-"号填列)	-	-	-
1、期末所有者权益 基金净值)	37,286,962.24	1,941,565.18	39,228,527.42
项目	2017年	上年度可比期间 F1月1日至2017年6月30	E
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
-、期初所有者权益 基金净值)	45,475,895.46	6,648,300.45	52, 124, 195.91
二、本期经营活动产生 约基金净值变动数(本 引利润)	-	742,289.34	742,289.34
三、本期基金份额交易 至生的基金净值变动 数 (净值减少以"-" 号填列)	-2,276,886.76	-289,804.67	-2,566,691.43
其中:1.基金申购款	2,469,019.17	375,522.94	2,844,542.11
基金赎回款	-4,745,905.93	-665,327.61	-5,411,233.54
四、本期向基金份额持 可人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 D以"-"号填列)	-	-	-
5、期末所有者权益	43,199,008.70	7,100,785.12	50,299,793.82

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:

周立新 罗登攀 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 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。

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是《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新行条例》。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 育附加的诵告》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,

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。 643 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

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

基金管理人、注册登记机构、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 6.4.4.1 诵讨关联方交易单元讲行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行

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	212,985.53	247,366.45	
其中:支付销售机构的客 户维护费	47,689.42	64,589.45	
注:支付基金管理	型人大成基金的管理人	报酬按前一日基金资产净值	
		按月支付。其计算公式为:	
and defended it to be added	>4. — 44 A >44 A >44 A	and the second s	

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。 6.4.4.2.2 基金托管费 单位:人民币元

注,专付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提,该日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间 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

上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	项目
	-	基金合同生效日 (2011年 11月30日) 持有的基金份 額
	1,285,561.85	期初持有的基金份额
1,285,561.8		期间申购/买人总份额
	-	期间因拆分变动份额
		减:期间赎回/卖出总份额
1,285,561.8	1,285,561.85	期末持有的基金份额
2.9800	3.4500%	期末持有的基金份额 占基金总份额比例

所相关规定计算并支付。 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

2018年半年度报告摘要

关联方		太期 至2018年6月30日	上年度可比 2017年1月1日至2	
名称	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
中国工商 银行	723,242.20	5,926.92	4,463,890.32	5,100.42
注. *1	1全的组行7	マか由甘仝丘	等人由国工商组:	行促管 并按组

间同业利率计息。 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承 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 利润分配情况

木报告期内本基金无利润分配事项。 6.4.6 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.6.1 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 证券 6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌的股票。 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6463.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2018年6月30日止,本基金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。 6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,基金从事证券交易所债券正同 购交易形成的卖出回购证券款余额6000000.00元,于2018年7月2日到 期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和 或在新质押式回购下转人质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算 为标准券后,不低于债券回购交易的余额。 《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

	共平:胶器	2,405,880.51	5.67
2	固定收益投资	32,893,052.18	77.56
	其中:债券	32,893,052.18	77.56
	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	买人返售金融资产	6,000,000.00	14.15
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	872,799.89	2.06
7	其他各项资产	236,024.64	0.56
8	合计	42,407,757.22	100.00

			金额单位:人民币
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	0.00
В	采矿业	-	0.00
C	制造业	2,405,880.51	6.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	0.00
Е	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
Н	住宿和餐饮业	-	0.00
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业	-	0.00
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
Ν	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
0	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
Р	教育	-	0.00
Ω	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	2,405,880.51	6.13

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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净 值比例(%)
1	000960	锡业股份	2,101,023.00	4.58
2	002353	杰瑞股份	1,406,310.00	3.06
3	002271	东方雨虹	1,109,481.00	2.42
4	601636	旗滨集团	1,081,099.49	2.36
5	601808	中海油服	937,998.00	2.04
6	000012	南玻A	920,881.00	2.01
7	000910	大亚圣象	916,486.00	2.00
8	601318	中国平安	899,508.00	1.96
9	000786	北新建材	869,872.00	1.90
10	601225	陕西煤业	853,625.00	1.86
11	600884	杉杉股份	853,210.00	1.86
12	603826	坤彩科技	853,164.00	1.86
13	300661	圣邦股份	853,092.00	1.86
14	603708	家家悦	848,732.80	1.85
15	300352	北信源	841,275.00	1.83
16	300595	欧普康视	835,611.40	1.82
17	300618	寒锐钻业	835,016.00	1.82
18	300601	康泰生物	832,596.00	1.81
19	600048	保利地产	774,844.00	1.69
20	002707	合信施液	663.142.00	1.45

注:本项中"本期累计买入金额"指买人成交金额(成交单价乘以 成交数量) 不老虎相关交易费田

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

股票名称 本期累计卖出金额 1,094,411 大亚圣象

注:本项中"本期累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以 成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本项中"买入股票的成本(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 关交易费用.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元 基金资产净值比例(% 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

金额单位:人民币元 占基金资产净 值比例(%) 债券名称

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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 告全屋投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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国债期货交易情况说明 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未持有国债期货。 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货。

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未出现本期被监管部

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

份额单位:份

		单位:人民币
序号	名称	金額
1	存出保证金	17,007.02
2	应收证券清算款	104,216.25
3	应收股利	_
4	应收利息	95,142.37
5	应收申购款	19,659.00
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	_
0	Alt	226 02464

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

			ZIZ FE	※十四・ハイトCI
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	113011	光大转债	3,850,151.20	9.81
2	123006	东财转债	3,292,150.71	8.39
3	110032	三一转债	2,805,836.40	7.15
4	132002	15天集EB	2,410,353.00	6.14
5	128016	雨虹转债	2,309,787.36	5.89
6	110034	九州转债	1,971,795.00	5.03
7	113015	隆基转债	1,033,977.60	2.64
8	110038	济川转债	940,102.50	2.40
9	110040	生益转债	924,912.40	2.36
4.0	440000	alter Albertein Pills	400 000 00	4.00

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情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,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

的情况

持有份额 持有份额

注:持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。 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

《9 开放式基金份额变动 报告期期初基金份额总额

§ 10 重大事件揭示

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

10.1 基金份额持有人大会决议

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 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

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

注: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

了和田证券公司交易单元的选择标准和程序。

性要求:

单位:人民币元

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

(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;

和用证券公司交易单元的程序:首先根据和用证券公司交易单元的 选择标准形成《卷商服条评价表》,然后根据评分高低进行选择其全交 易单元。 本报告期内本基金和用证券公司交易单元的变更情况如下:

(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。

2、本报告期内增加交易单元:海通证券。本报告期内退租交易单元:

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 金额单位:人民币元

	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称	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	成交金額	占当期4 证 成交总符 的比例
长江证券	50,046, 242.12	61.46%	150,200, 000.00	97.41%	-	0.00
海通证券	15,913, 117.65	19.54%	-	0.00%	-	0.00
申银万国	15,467, 510.91	19.00%	4,000,000.00	2.59%	-	0.00
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
东方证券	-	0.00%	_	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

投资 者类 別	序号	持有基金份额比例 达到或者超过20% 的时间区间	期初 份額	申购 份額	赎回 份额	持有份額	份额占 比
机构	1	20180101-20180 630	16,101, 960.76	0.00	0.00	16,101, 960.76	43.18%
个人	-	-	-	-	-	-	-
			产品特有风	险			
值剧烈	波动的	有人占比过于集中时 风险,甚至有可能引起	基金的流动性及	U脸,基金	管理人	人大额赎回而引可能无法及时变	现基金资

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 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

2018年8月29日

大成基金管理有限公司