大成恒生指数证券投资基金(QDII-LOF) 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

多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,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 木将告期白2018年01月01日起至06月30日止。

1区口约日2010年	UIC	01日起土00月30日
+ 4 + 4 + 4	§2	基金简介

基金简称	大成恒生指数(QDII)
场内简称	恒指LOF
基金主代码	160924
交易代码	160924
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2017年8月10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	28,658,556.58 ()
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	2017年8月28日

投资目标		本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,迫求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。		
投资策略	资组合,并根据标的 整。但因特殊情况(女 足够数量的股票时,非 股票时,基金管理人	本基金主要按照标的指数的成份股及其权值构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份服及其权值的变动进行相应调整。但此特殊预估了如果停阱,流动作不足,与吸无法获得足够数量的聚期时,或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术造当课整基金投资组合。以达到顺路标的指数的目的。		
业绩比较基准	恒生指数收益率×959	恒生指数收益率×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	合型基金、债券型基金	其长期平均风险和预期收益率高于混 2及货币市场基金。本基金为指数型基 的表现,具有与标的指数以及标的指数 以的风险收益特征。		
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	中国工商银行股份有限公司		

项		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		
	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@ichc.com.cn		
客户服务电话 40088855		4008885558	96688		
传真		0755-83199688	010-66105799		
2.4 境外	投资顾问	可和境外资产托管力	Λ		
项目		境外资产托管人			

	名称 英文 中文		Brown Brothers Harriman & Co.
			布朗兄弟哈里曼银行
	注册地址		140 Broadway New York, NY 1005
	办公地址		140 Broadway New York, NY 1005
	邮政编码		NY 1006
	2.5 信息披露方式		

《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

	金额甲位:八氏巾
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	14,202,749.85
本期利润	3,393,759.03
加权平均基金份额本期利润	0.0731
本期基金份额净值增长率	-277%
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	0.0188
期末基金资产净值	29,196,790.39
期末基金份額净值	1.019

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其

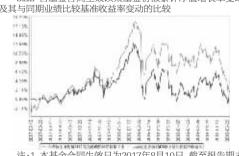
他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期 利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项

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

リレレイス						
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	-1.45%	1.14%	-4.72%	1.09%	3.27%	0.05%
过去三个 月	0.69%	1.04%	-3.58%	1.06%	4.27%	-0.02%
过去六个 月	-277%	1.14%	-3.01%	1.16%	0.24%	-0.02%
自基金合 同生效起 至今	1.90%	0.94%	4.17%	1.01%	-2.27%	-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



注:1、本基金合同生效日为2017年8月10日,截至报告期末 本基金合同生效未满一年。

2. 本基金合同规定, 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。 截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定

€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ODII业务

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 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ODII基金及75只开放式证券投资基金。

姓名	职务		以基金的基金经理(助理)期 限		说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩先生	本基金基金	2017年8月10日	-	15 9 E	。 國学商社,2000年月前 多研学成,任何关系,在《日子文》, 在10日至2000年月前 第四班多年月至2000年月前 第四班多年月至2000年日 10年20年20年日 10年20年20年日 10年20年20年日 10年20年20年日 10年20年20年日 10年20年20年20年20年20年20年20年20年20年20年20年20年20

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。 4.3 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。 4.4 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 -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

4.4.2 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 可交易,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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,全球主要发达经济体的宏观经济保持了稳 定增长,美国宏观经济也保持了稳定增长的势头,美国股票市场 也保持了在震荡中略微上涨的趋势。

在2018年1季度,作为新兴市场最重要的国家,中国宏观经 济仍然能维持稳定增长。但是,中国的宏观经济在2季度发出了

首先,由于中国整体杠杆率较高,监管层采取措施逐步降低 社会杠杆水平。去杠杆政策虽然利好经济的长期健康发展,但是 却通过银根紧缩等途径对经济的短期增长造成了一定压力。 其次,中美贸易争端逐步升级,导致中国净出口金额与去年同期相比已经有了一定幅度的下滑,这也是对宏观经济的拖累。

另外,在2季度,中国三四线城市的棚改货币化进程有所减 速,这也负面影响了宏观经济。

同时,这些负面因素也影响到了居民消费支出,最近月份的 消费数据也因此走弱。

在这些不利于宏观经济的因素的影响下,A股及港股市场 在2季度出现了快速下跌,而本基金的基准指数也同样出现了快

从汇率方面来看,在1季度,港元汇率出现了小幅下跌,而在 2季度, 港元汇率又出现了明显上升, 从而使得在今年上半年期间, 港元也取得了微小升值, 这利好于本基金净值表现。

4.5.2 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1.019元;本报告期基金份额净值增长率为-2.77%,业绩比较基准收益率为-3.01%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2018下半年,预计中国宏观经济仍然会保持增长,但是经 济增长速度可能会有所降低。

从不利的方面来看,首先,中国整体杠杆率较高是客观事实,监管层也会持续加强对金融行业的监管;其次,中美贸易冲 突在下半年还有持续升级的可能性,这会切实影响中国的出口; 另外,居民消费增速也有可能持续放缓。 当然,与2季度相比,宏观经济在下半年也有改善的方面。首

先,香港中资上市公司上半年整体增速依然维持强劲,海外中资 股样本盈利同比增速有望达到25%,较2017年的18%进一步提升,这展示了经济仍然有增长的韧性。其次,近期召开的国务院 常务会议提出更积极的财政政策、松紧适度的货币政策、清理僵 尸企业和鼓励中小企业贷款等多项促进经济增长的政策。而这 些经济增持有望改善宏观经济表现。

综合上述各方面,我们预计港股市场今年盈利增长依然具 有相当的韧性,但不利因素与压力也边际上有所增加,包括持续 去杠杆化导致融资成本上升、贸易摩擦的潜在负面影响、以及人 民币持续走弱的影响等

本基金为被动型指数基金, 其投资目标就是要复制指数的 收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念,持续实施高效 的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好地跟踪指 数,力争将跟踪误差控制在较低的水平

4.7 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

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 模型对需要讲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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 本基金管理人将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。 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预

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。

51 报告期内木基全托管人遵却字位

本报告期内, 本基金托管人在对大成恒生指数证券投资基 金(ODII-LOF)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

木报告期内 大成恒生指数证券投资基全(ODII_LOR)的 管理人——大成基金管理有限公司在大成恒生指数证券投资基 金(ODII-LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申 **咖啡同价格计算** 基全费用开支等问题 L 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 间的规定进行。本报告期内,大成恒生指数证券投资基金 (ODII-LOF)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 恒生指数证券投资基金(ODII—LOF)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:大成恒生指数证券投资基金(QDII-LOF)

资产	本期末	上年度末
资产:	2018年6月30日	2017年12月31日
	2.030.584.75	
银行存款	2,030,584.75	16,337,112.30
结算备付金 存出保证金	-	
存出保证並 交易性金融资产	-	
父粉性面膜資产 其中:股票投资	27,451,007.30 27,451,007.30	197,529,169.21 197,529,169.21
	27,461,007.30	197,029,109.21
基金投资		
债券投资	_	
资产支持证券投资		
贵金属投资 (C.A. O.Beke e	-	
衍生金融资产 亚人返售金融资产	-	
	_	
应收证券清算款	_	
应收利息	430.64	3,796.42
应收股利	126,021.35	
应收申购款	10,263.90	17,282.66
遊延所得税资产	_	
其他资产	_	
资产总计	29,618,307.94	213,887,360.59
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	5.94	43.18
应付赎回款	112,755.99	2,427,370.34
应付管理人报酬	24,747.20	181,451.63
应付托管费	4,949.45	36,290.31
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	46,488.01	174,133.94
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	
逆延所得税负债	-	
其他负债	232,570.96	143,14832
负债合计	421,517.55	2,962,437.72
所有者权益:		
空收基金	28.658.556.58	201,301,378.17
头权趋近		

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币 1.019元,基金份额总额28,658,556.58份。 6.2 利润表

公告主体:大成恒生指数证券投资基金(QDII-LOF) 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

項目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		序号	项目		1
	4,304,348.18	1	1	权益投资		
	30,184.61	1		其中:普通股票		
息收入	30,184.61			存托凭证		
L	-			优先股		
 	-			房地产信托凭证		
被资产收入	-	1	2	基金投资		
L	-		3	固定收益投资		
损失以 "-" 填列)	14,844,196.25	1		其中:债券		
资收益	14,400,489.69			资产支持证券		
ži.	-		4	金融衍生品投资		
ži.	-			其中:远期		
 	-	1		期货		
女益	-	1		期权		
ii ii	-	1		权证		
	443,706.56	1	5	买人返售金融资产		
□动收益(损失以"-"号填列)	-10,808,990.82			其中: 买断式回购的买人返售金融资产		
损失以"-"号填列)	-		6	货币市场工具		
损失以"-"号填列)	238,958.14		7	银行存款和结算备付金	合计	
	910,589.15		8	其他各项资产		
刑	240,827.80		9	合计		
	48,165.52	_	注	:本基金通过	深港通交	易机制投
费	-	451	00	730元 占期	末其全资	立净值的
	433,254.23	451,007.30元,占期末基金资 7.2 期末在各个国家(地			マ / 3 T 光 コ	
	-		1.2	. 期本任台门	国家(地)	乙 / ய分口
购金融资产支出	-	_				
tho	-		国家(地	恒区)	公允价值	
	188,341.60		中国香	港		27,451

单位:人民币元

注: 本基金合同生效日为2017年8月10日。 2018年1月1日至2018年6月30日止。截至报告日,本基金合同生 效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:大成恒生指数证券投资基金(QDII-LOF) 本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

項目	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)	201,301,378.17	9,623,544.70	210,924,922.87		
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期净 利润)	-	3,393,769.03	3,393,759.03		
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)	-172,642,821.59	-12,479,069.92	-185,121,891.51		
其中:1基金申购款	5,615,988.48	390,155.47	6,006,143.95		
2基金赎回款	-178,258,810.07	-12,869,225.39	-191,128,035.46		
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)	28,658,556.58	538,233.81	29,196,790.39		

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署: 罗登攀

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报

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 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 管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租人固 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

相关境内外税务法规和实务操作,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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收 人免征增值税,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)目前基金取得的源自境外的差价收入和利息收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法 规执行,在境内暂不征收企业所得税。 (3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所 得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境

内街不征收个人所得税和企业所得税 (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 注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订

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 本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2.1 基金管理费 单位:人民币元 支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一

资产净值1.00%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支 日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元 注:支付基金托管人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,逐日累计至每月月底,按月支付。其

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 本报告期内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

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以外的其他关联方未投资

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

		单位:人民币元
关联方 名称		本期]至2018年6月30日
名称	期末余额	当期利息收人
中国工商银行	2,030,584.75	23,090.88
注:本基金的	银行存款由基金托管	人工商银行保管,按银行

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 于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流

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

通受限的证券。 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。 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

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

的卖出回购证券款余额。

7.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

号	项目	金額	占基金总资产的 比例(%)	
1	权益投资	27,451,007.30	92.68	
	其中:普通股票	27,451,007.30	92.68	
	存托凭证	-	-	
	优先股	-	-	
	房地产信托凭证	-	-	
2	基金投资	_	_	
3	固定收益投资	-	_	
	其中:债券	-	_	
	资产支持证券	-	_	
4	金融衍生品投资	-	_	
	其中:远期	-	_	
	期货	-	_	
	期权	-	-	
	权证	-	_	
5	买人返售金融资产	-	_	
	其中: 买断式回购的买人返售金融资产	-	_	
6	货币市场工具	-	_	
7	银行存款和结算备付金合计	2,030,584.75	6.86	
8	其他各项资产	136,715.89	0.46	
9	合计	29,618,307.94	100.00	

资的港股公允价值为27 比例为9402% 市场的权益投资分布

注:1.股票的国家(地区)类别根据其所在证券交易所确

2.本基金本报告期末未持有存托凭证

7.3 期末按行业分类的权益投资组合 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合 注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

		3万世が十一元・ノイトグロック						
行业类别	公允价值	占基金资产净值比列(%)						
金融	-	-						
信息技术	-	-						
房地产	-	-						
能源	-	-						
电信服务	-	-						
公用事业	-	-						
工业	27,293.74	0.09						
消费者非必需品	-	-						
消费者常用品	-	-						
基础材料	-	-						
医疗保健	-	-						
合计	27,293.74	0.09						
注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。								
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益								

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小

排序的前十名权益投资明细 金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名 称(中 文)	证券代码	所在 证券 市场	所属国 家(地 区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比列 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控 股	700 HK	香联交所	中国香港	8,700	2,888,511.19	9.89
2	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控 股	5 НК	香联交所	中国香港	46,000	2,854,399.36	9.78
3	AIA GROUP LTD	友邦保 险	1299 HK	香联交所	中国香港	43,600	2,521,678.38	8.64
4	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建设银行	939 HK	香联交所 港合易	中国香港	381,000	2,328,852.98	7.98
5	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 HK	香联交所	中国香港	499,000	1,636,549.84	5.61
6	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香联交所	中国香港	22,500	1,322,191.58	4.53
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香联交所 港合易	中国香港	20,500	1,247,872.31	4.27
8	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易 所	388 HK	香联交所	中国香港	4,300	855,577.88	2.93
9	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香联交所	中国香港	65,000	742,012.31	2.54
10	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	长和	1 HK	香联交斯	中国香港	10,000	701,459.20	2.40

·H.	川九名	11火血:	区页明	送出		_	金额单位:	V 123	==
						Z	比到4年1年1	八民川	1)
9 9	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所 在 证 券市场	所属国家 (地区)	数量(股)	公允价值	占基金资 产净值比 列%)	
	Country Garden Services Holdings Company	碧桂园服 务	6098 HK	香港联合交易	中国香港	3,218	27,293.74	0.09	

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

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的

金额单位:人民币元

权益投资明细

本期累计买人金额 2,135,36 1,081,31 564,46 553,76 526,85

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单价乘以成 交数量),不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的 金额单位:人民币元

公司名称/英文 本期累计去出余额 9,035,44 3,936,26 3,670,50 3,282,50 3.030.0

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。 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额 单位: 人民币元

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。 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

水基全水报告期末未持有债券 7.7 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。 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 名金融衍生品投资明细 本基金本报告期末未持有金融衍生品。 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前

十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。 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本期未出现被 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

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 单位:人民币元

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明约

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的

本基金本报告期末未持有积极投资的股票 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,

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:份

			10-1410	YER	比例		14-14 DAME	比例	
1,144		25,051.19		-	0.00%		28,658,556.58	100.00%	
注:	E:持有人户数为有效/			□数,	即存量	份额	大于零的	账户。	
8.2	期	末上市基	金前十二	名持有	与人				
序号 持有人名称			持有份額(份)			占上市总份额比例			
1		田秀英			54	59.70%			
2		张秀环		55,853.00			6.14%		
3	言晟			50,000.00			5.50%		
4	张欣			40,000.00				4.40%	
5	罗四倍			31,254.00			3.43%		
6	王磊			30,000.00			3.30%		
7	王丽春			20,003.00			2.20%		
8	付秀玲			20,002.00			2.20%		
9	曹月娟			16,904.00				1.86%	
10	中普普			11,003.00			1.21%		
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况									
项目 持4			有份额总数	枚(份)		占基金总份额	比例		
27.A.00.10	n I me	Action to read out							

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

§ 9 开放式基金份额变动 单位:份 § 10 重大事件揭示

10.1 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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情

10.4 基金投资策略的改变

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

佣金

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,本公司制定了租用境内证券公司交易单元的选择标准

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 7.1。 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

讲行选择基金交易单元 2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境

外券商,具体选择标准如下: 一)具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营 业执照、业务许可证明文件; (二)资历雄厚,信誉良好;

(三)财务状况良好,经营行为规范; (四)内部管理规范,严格,具备健全的内控制度(包括但不 限于公平交易制度及保密制度),能满足各投资组合运作高度保

(五)证券研究或市场研究实力较强,有固定的研究机构和 专门研究人员,能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的 信息服务,并能根据各投资组合投资的特定要求,提供专题研究

(六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准 确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令 (七)具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及 时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。 (八)能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务

(九)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条 交易管理部在每半年15个交易日内, 汇总上半年境外券商 综合服务评价结果,作为当次境外券商交易量分配依据。并依此 制作交易量分配计划,报部门及公司分管领导批准;

交易量分配计划获批后,作为选择交易券商的依据,供交易 员在交易时进行券商选择。 为商服务出现重大失误或其他异常情况时,及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作,并对其失误所造

3、本报告期内本基金退租交易单元:无;新增交易单元:海

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 § 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

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。 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

大成基金管理有限公司

2018年8月29日