

中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资 基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 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	大成中证 500 沪市 ETF
场内简称	500 沪市 ETF
基金主代码	510440
交易代码	510440
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2012 年 8 月 24 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	22,058,261.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 10 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 沪市指数（代码：000802）
风险收益特征	本基金为股票基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	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		4008885558	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	-92,879.28
本期利润	-6,395,742.78
加权平均基金份额本期利润	-0.2899
本期基金份额净值增长率	-15.74%
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	0.5137
期末基金资产净值	34,260,545.15
期末基金份额净值	1.553

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。

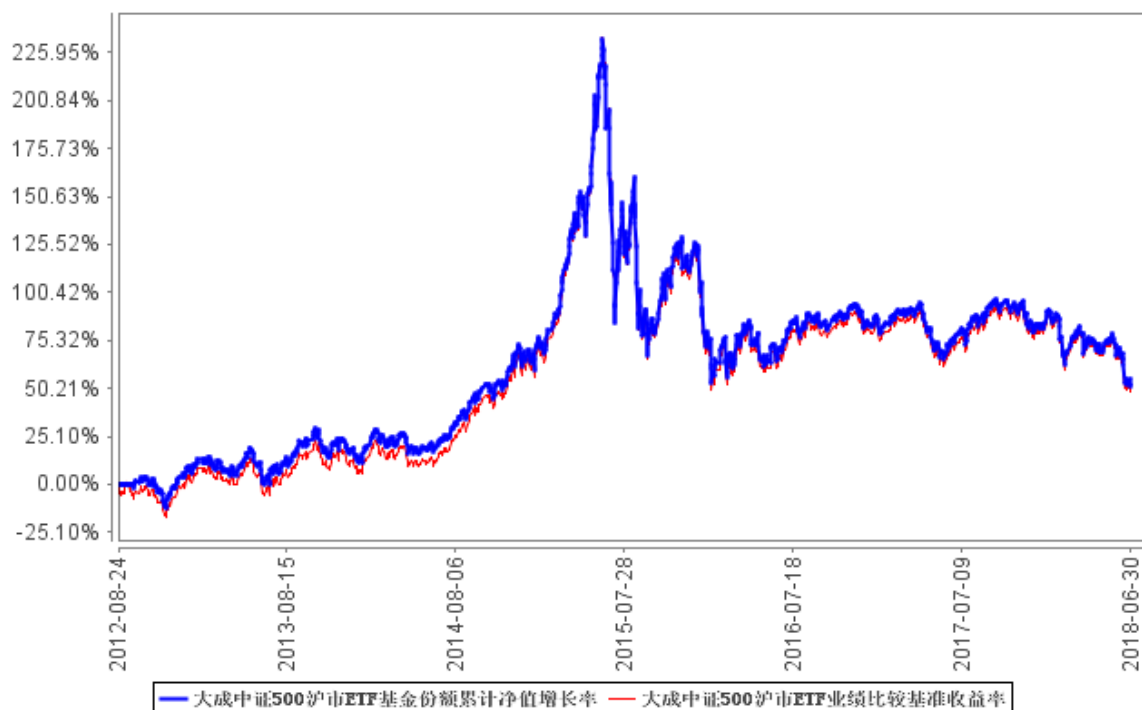
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3.2 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	-8.86%	1.75%	-9.08%	1.77%	0.22%	-0.02%
过去三个月	-11.81%	1.32%	-12.27%	1.33%	0.46%	-0.01%
过去六个月	-15.74%	1.43%	-15.88%	1.44%	0.14%	-0.01%
过去一年	-13.14%	1.21%	-12.57%	1.22%	-0.57%	-0.01%
过去三年	-39.81%	1.94%	-41.20%	1.94%	1.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	55.30%	1.74%	52.68%	1.78%	2.62%	-0.04%

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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。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的各项比例。

§ 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		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2012 年 8 月 24 日	—	14 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及

					大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起担任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国
刘淼女士	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	10 年	北京大学 MBA。2008 年 4 月至 2011 年 5 月任招商基金管理有限公司基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计、股票投资部风控员兼投委会秘书、数量与指数投资部数量分析师。2017 年 9 月 14 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金和中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。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合规守信情况的说明

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

上半年度，整体宏观经济环境出现了较大的变化，两会和中美贸易摩擦是上半年影响最大的外生变量。两会从顶层确立了我国未来发展的基调，而贸易摩擦则是全球政治、经济环境剧变的集中体现。在剧烈冲击下，国内宏观政策也有较大改变。经济下行压力开始出现，出于维稳的需要，去杠杆、金融整肃趋于温和，财政政策也有更加积极的趋势。此外，人民币相对美元发生了较为明显的贬值，对冲了部分贸易摩擦带来的出口压力，同时也带来了资本外流的隐忧。

上半年股票市场也经历了较大幅度的波动。进入新年后，大盘蓝筹股强劲上涨，走出逼空式行情，但行情过度透支，交易极其拥挤，在一系列因素作用下，最终由外围股市下跌引发剧烈调整。之后，市场风格出现逆转，创业板等成长类股票率先企稳，为所谓“独角兽”回归营造了良好的市场氛围。市场盘整一段时间后，最终仍无法承受去杠杆、贸易摩擦等多重压力，继续下挫直至半年末。本报告期市场基准沪深 300 指数下跌 12.90%，大多数行业、板块均有较大幅度的下跌，消费类板块由于其业绩确定性，在弱市中表现出较为优秀的防御特征，其中休闲服务、医药生物、食品饮料行业更是逆市上涨。市场表现出明显的避险特征，基本面稳定的股票由于其确定性，投资者给予了一定的溢价，这也是上半年大市值股票表现较好的原因之一。

本基金标的指数中证 500 沪市指数下跌 15.88%，跌幅高于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。上半年年化跟踪误差 0.65%，日均偏离度 0.03%，各项操作与指标均符合基金合同的要求。

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 1.553 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.74%，业绩比较基准收益率为-15.88%。

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，外部环境和经济政策均面临较大的不确定性。经济基本面短期内不会发生较大变化，但目前国内经济增长质量明显低于政府预期。中美贸易摩擦并没有缓和的迹象，人民币汇率也不稳定，这无疑加大了政策制定的难度。“既要又要”式的复合目标越来越难实现，政府很难兼顾多方面的均衡。在内外多重压力下，短期稳定压倒长期增长，暂时成为优先级更高的目标，货币政策和财政政策保持宽松是必然选择。当内外环境稳定后，为了经济可持续发展，去杠杆、调结构的大趋势仍然不会变。

对于股票市场，下半年的形势更加错综复杂。经济基本面无疑并不会太好，然而经济下行加上外部压力，有可能会倒逼政策，令去杠杆节奏有所放缓。这对刚经历过大跌的股市来说，基本面恶化已经在一定程度上反映在股价里，综合来看反而造成边际改善的短期利好。在货币政策保持宽松的情况下，市场流动性并不紧缺，只要投资者风险偏好提升，即有可能带来一波反弹。

预计下半年市场总体走势应好于上半年。反弹行情若如期出现，其性质仍属于悲观预期修复所带来的超跌反弹。总体而言，之前成长股超跌程度更甚于价值股，部分质地尚可而被市场错杀沦为小市值的股票有望迎来修复行情。成长板块将先于价值板块反弹，强度也会相对较高。值得注意的是，即使总体环境有所改善，个股风险依然不能忽视，基本面恶化、股权质押、财务报表等因素造成的个股“地雷”也会陆续爆发，基金经理需要以更高的标准筛选股票。

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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。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两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资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。

4.8 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

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合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金（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合规守信、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：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

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	584,832.13	456,065.87
结算备付金	-	-
存出保证金	251.01	235.80
交易性金融资产	33,834,323.94	40,401,447.84
其中：股票投资	33,834,323.94	40,401,447.84
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	100.33	99.07
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	34,419,507.41	40,857,848.58
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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	14,713.96	17,136.07
应付托管费	2,942.79	3,427.20
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,006.57	10,997.38

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	134,298.94	170,000.00
负债合计	158,962.26	201,560.65
所有者权益：		
实收基金	22,058,261.00	22,058,261.00
未分配利润	12,202,284.15	18,598,026.93
所有者权益合计	34,260,545.15	40,656,287.93
负债和所有者权益总计	34,419,507.41	40,857,848.58

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.553 元，基金份额总额 22,058,261.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

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	-6,084,722.97	-2,959,816.14
1.利息收入	1,547.80	2,084.87
其中：存款利息收入	1,546.93	2,083.71
债券利息收入	0.87	1.16
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	216,592.73	-4,591,672.20
其中：股票投资收益	-93,449.98	-4,848,919.55
基金投资收益	-	-
债券投资收益	582.93	830.44
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	309,459.78	256,416.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,302,863.50	1,635,873.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-6,102.16
减：二、费用	311,019.81	338,552.64

1. 管理人报酬	95,412.94	110,922.66
2. 托管费	19,082.60	22,184.54
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,070.33	21,002.88
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	184,453.94	184,442.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,395,742.78	-3,298,368.78
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,395,742.78	-3,298,368.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

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）	22,058,261.00	18,598,026.93	40,656,287.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,395,742.78	-6,395,742.78
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	22,058,261.00	12,202,284.15	34,260,545.15
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）	22,058,261.00	18,259,954.27	40,318,215.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,298,368.78	-3,298,368.78
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）	-	2,420,963.94	2,420,963.94
其中：1. 基金申购款	14,000,000.00	12,269,286.90	26,269,286.90
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-9,848,322.96	-23,848,322.96
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）	22,058,261.00	17,382,549.43	39,440,810.43

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>崔伟</u>
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一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.2.2 增值税及附加、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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、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	341,236.00	4.28%	9,773,933.71	66.71%

6.4.4.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	7,583.80	100.00%	-	0.00%

6.4.4.1.3 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	310.90	4.28%	57.81	0.83%
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	8,907.63	66.72%	8,907.63	70.57%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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	95,412.94	110,922.66
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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	19,082.60	22,184.54

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2012 年 8 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	77.0700%	77.0700%

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
中国银行股份有限公司	584,832.13	1,467.13	213,260.51	1,963.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

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
600022	山东钢铁	2018 年 3 月	重大	2.02	2018 年 8 月	1.83	139,830	290,305.24	282,456.60	-

		月 27 日	事 项		月 16 日					
600811	东方 集团	2018 年 5 月 30 日	重 大 事 项	4.30	-	-	63,070	353,127.37	271,201.00	-
600751	海航 科技	2018 年 1 月 12 日	重 大 事 项	6.49	-	-	27,400	234,578.62	177,826.00	-
600158	中体 产业	2018 年 3 月 27 日	重 大 事 项	11.64	2018 年 7 月 16 日	11.61	14,401	314,028.60	167,627.64	-
600086	东方 金钰	2018 年 1 月 19 日	重 大 事 项	10.04	-	-	14,378	197,939.92	144,355.12	-
600122	宏图 高科	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	7.40	-	-	19,400	270,846.51	143,560.00	-
600848	上海 临港	2018 年 6 月 19 日	重 大 事 项	21.67	-	-	6,400	133,482.08	138,688.00	-
600750	江中 药业	2018 年 5 月 2 日	重 大 事 项	17.75	2018 年 8 月 1 日	16.12	5,457	144,868.88	96,861.75	-
600759	洲际 油气	2018 年 3 月 27 日	重 大 事 项	3.94	-	-	24,138	217,259.87	95,103.72	-
600335	国机 汽车	2018 年 4 月 3 日	重 大 事 项	10.43	-	-	8,832	121,980.45	92,117.76	-
600687	刚泰 控股	2018 年 6 月 11 日	重 大 事 项	9.09	2018 年 8 月 20 日	8.18	9,500	142,172.82	86,355.00	-

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	33,834,323.94	98.30
	其中：股票	33,834,323.94	98.30
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	584,832.13	1.70
7	其他各项资产	351.34	0.00
8	合计	34,419,507.41	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	230,698.00	0.67
B	采矿业	1,381,901.32	4.03
C	制造业	19,234,075.67	56.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,238,579.46	3.62
E	建筑业	324,748.08	0.95
F	批发和零售业	2,528,555.43	7.38
G	交通运输、仓储和邮政业	2,405,594.29	7.02
H	住宿和餐饮业	391,930.00	1.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,199,864.50	3.50
J	金融业	727,184.00	2.12
K	房地产业	2,366,084.61	6.91

L	租赁和商务服务业	332,576.37	0.97
M	科学研究和技术服务业	123,649.20	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	238,739.92	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	52,353.00	0.15
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	625,979.99	1.83
S	综合	362,372.10	1.06
	合计	33,764,885.94	98.56

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	-	0.00
C	制造业	-	0.00
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	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	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
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	69,438.00	0.20
S	综合	-	0.00
	合计	69,438.00	0.20

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603019	中科曙光	9,500	435,765.00	1.27
2	600521	华海药业	15,704	419,139.76	1.22
3	600426	华鲁恒升	23,773	418,167.07	1.22
4	600201	生物股份	24,466	418,123.94	1.22
5	603589	口子窖	6,300	387,135.00	1.13
6	600298	安琪酵母	10,330	368,574.40	1.08
7	600256	广汇能源	84,540	345,768.60	1.01
8	600584	长电科技	19,952	337,986.88	0.99
9	601233	桐昆股份	19,060	328,213.20	0.96
10	600872	中炬高新	11,695	327,460.00	0.96

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>)的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600880	博瑞传播	16,300	69,438.00	0.20

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600760	中航沈飞	312,500.00	0.77
2	600258	首旅酒店	268,570.20	0.66
3	600528	中铁工业	239,785.00	0.59
4	600895	张江高科	201,463.00	0.50
5	601098	中南传媒	193,637.00	0.48
6	603885	吉祥航空	188,583.00	0.46
7	600827	百联股份	181,440.00	0.45
8	603899	晨光文具	179,135.00	0.44
9	600649	城投控股	172,186.00	0.42
10	601966	玲珑轮胎	167,674.00	0.41
11	601179	中国西电	157,151.00	0.39
12	601872	招商轮船	155,400.00	0.38
13	600021	上海电力	142,457.00	0.35
14	601801	皖新传媒	104,482.00	0.26
15	601608	中信重工	103,200.00	0.25
16	600777	新潮能源	102,870.00	0.25
17	601128	常熟银行	102,752.00	0.25
18	603659	璞泰来	85,722.00	0.21
19	600350	山东高速	61,640.00	0.15
20	603056	德邦股份	60,813.00	0.15

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600516	方大炭素	613,774.00	1.51
2	600176	中国巨石	537,165.18	1.32
3	600346	恒力股份	308,153.00	0.76
4	600566	济川药业	256,087.06	0.63
5	600438	通威股份	255,816.00	0.63
6	601699	潞安环能	248,024.70	0.61
7	601231	环旭电子	150,201.00	0.37
8	600315	上海家化	133,322.00	0.33

9	600587	新华医疗	104,818.00	0.26
10	600059	古越龙山	91,271.60	0.22
11	600284	浦东建设	89,595.16	0.22
12	601002	晋亿实业	74,588.16	0.18
13	600826	兰生股份	71,491.74	0.18
14	600628	新世界	67,916.20	0.17
15	600673	东阳光科	66,320.00	0.16
16	600894	广日股份	61,824.00	0.15
17	600776	东方通信	58,453.71	0.14
18	603528	多伦科技	46,059.00	0.11
19	603001	奥康国际	45,915.86	0.11
20	600388	龙净环保	34,625.00	0.09

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,933,186.20
卖出股票收入（成交）总额	4,103,996.62

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

期末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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	251.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	100.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	351.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中无流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
308	71,617.73	19,083,818.00	86.52%	2,974,443.00	13.48%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	77.07%
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000.00	9.07%
3	钱中明	360,100.00	1.63%
4	胡晔	147,763.00	0.67%
5	高翔	94,600.00	0.43%
6	贺顺龙	90,000.00	0.41%
7	中国银河证券股份有限公司	83,318.00	0.38%
8	张春雁	72,900.00	0.33%
9	王焕永	68,400.00	0.31%
10	吴炳芬	67,253.00	0.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 8 月 24 日）基金份额总额	541,058,261.00
本报告期期初基金份额总额	22,058,261.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	22,058,261.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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人事变动

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

本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安永华明会计师事务所(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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	7,624,824.82	95.72%	6,948.76	95.72%	-

光大证券	2	341,236.00	4.28%	310.90	4.28%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
太平洋证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

渤海证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
方正证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
民族证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
华林证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
中银国际	1	—	0.00%	—	0.00%	—
东方证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
中信证券	2	—	0.00%	—	0.00%	—
华泰证券	2	—	0.00%	—	0.00%	—

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，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

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他条件。

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》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金新增席位：太平洋证券。

本报告期内本基金退租席位：无。

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	—	0.00%	—	0.00%	—	0.00%
光大证券	7,583.80	100.00%	—	0.00%	—	0.00%
广发证券	—	0.00%	—	0.00%	—	0.00%

东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投证 券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
太平洋证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	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%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	17,000,000.00	-	-	17,000,000.00	77.07%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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，本基金管理人经与基金托管人协商一致，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、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

大成基金管理有限公司

2018 年 8 月 29 日