

# 大成健康产业混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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持证券投资明细.....	42
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贵金属投资明细.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
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.....	53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成健康产业混合型证券投资基金
基金简称	大成健康产业混合
基金主代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 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	25,809,344.27 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	<p>本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。</p> <p>为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。</p>
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

注：根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），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转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

### 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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

### §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	520,902.73
本期利润	-2,996,694.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1165
本期加权平均净值利润率	-11.29%
本期基金份额净值增长率	-11.47%
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	-1,899,949.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0736
期末基金资产净值	23,909,394.99
期末基金份额净值	0.926
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-10.62%

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

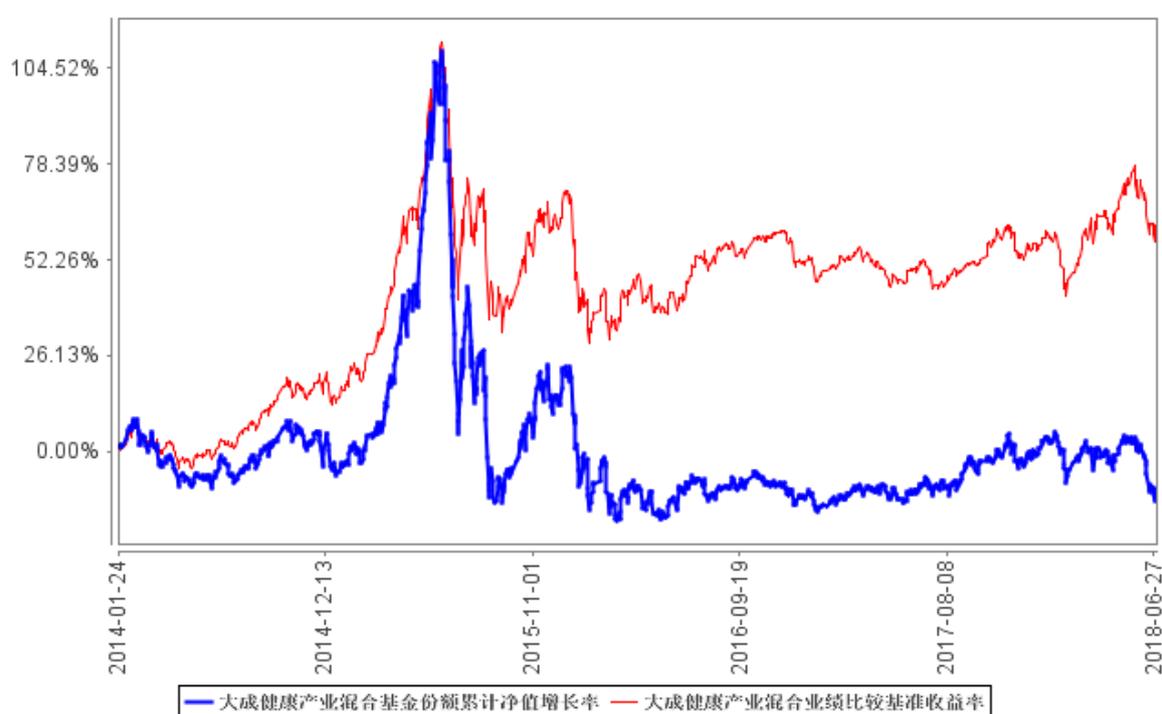
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-12.97%	1.81%	-6.94%	1.58%	-6.03%	0.23%
过去三个月	-11.30%	1.49%	-1.65%	1.30%	-9.65%	0.19%
过去六个月	-11.47%	1.46%	3.53%	1.23%	-15.00%	0.23%
过去一年	-2.01%	1.30%	6.50%	0.99%	-8.51%	0.31%
过去三年	-41.24%	2.00%	-7.30%	1.41%	-33.94%	0.59%

自基金合同生效起至今	-10.62%	1.95%	61.87%	1.38%	-72.49%	0.57%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

注：根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；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：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），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转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日（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，

本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3、根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；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。

## §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		
杨挺先生	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 日	-	10 年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员；2012 年 8 月起任职于大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员。2014 年 3 月 18 日至 2014 年 6 月 25 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 26 日至 2015 年 7 月 21 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月

					8 日任大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 12 日起担任大成价值增长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

2018 年以来，市场开始进入一个快速轮动的状态，指数的波动幅度也较去年明显加大。元旦以后，以地产和银行为主的大盘蓝筹走出了一波快速上涨的行情，地产、银行指数在很短时间内涨幅均超过 10%，同期创业板为代表的中小市值公司明显下跌，颇有去年行情特点延续的趋势。但是很快市场又发生轮动，地产银行等权重股快速下跌，同期以计算机为代表的科技创新类股票快速上涨，市场出现明显的跷跷板情况。在一季度末期，市场开始进入比较均衡的状态，但是中美贸易战成为影响市场波动的主要力量，在这一时期，防御性较为突出的医疗等板块表现突出，同时食品饮料等防御型板块也明显上涨。进入六月后，国际贸易形势的进一步恶化和国内去杠杆的进一步推进，引发了市场的快速下跌，几乎所有板块均轮流下跌，上证等多个指数在六月底均创出年内低点。

在一季度中，我们减持了去年获利较多的部分周期和建筑类股票，进一步加大了医疗方面的配置，这一点在本季度为我们在二季度获得了较多收益。我们在对二季度的判断是贸易冲突和国内宏观情况将持续影响市场走势，因此在二季度持仓主要以防御型的医药和消费为主，但是六月份的普遍下跌力度依然超过我们预期，组合的收益在六月的调整中损失较大。目前我们认为市场的悲观情绪依然存在，但是目前持仓的股票均为有基本面支撑的防御型股票，并且对目前组合标的在未来的业绩增长维持乐观判断，因此继续以目前的医疗和消费持仓为主。

##### 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 0.926 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.47%，业绩比较基准收益率为 3.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总结 A 股上半年，股权风险溢价快速上升，是引发下跌的核心因素。A 股风险偏好受到多重压制：1) 中美贸易摩擦；2) 美债利率和美元指数上行对权益资产估值造成压力，部分新兴市场的投资吸引力和资金承压；3) 去杠杆紧信用下市场对经济负面预期；4) 股市下跌引发股权质押风险触发的担忧。所以在 18 年上半年市场风格仍然偏向于价值，因价值更能抵御风险偏好下降

对于估值的压制，消费股的确定性溢价上升；而部分稳定型公用事业和低估值周期成次要选择。

我们认为 A 股生态已经和正在发生三大变迁：1) 绩优股的牛市仍在进行，绩劣股的熊市愈演愈烈；2) A 股加速融入全球资本市场，海外投资者横向比较全球市场估值；3) 去杠杆过程中，基于 ROIC 的投资方法能穿透财务数据“迷雾”甄别行业的基本面。供给侧改革提升上市公司质量导致小盘绩差股风险偏好趋势下降，未来龙头股的领涨行情将继续演绎。在全球横向比较的估值体系下，A 股龙头公司仍具备低估优势。

对于下半年的观点，我们认为 A 股市场正在构筑中期底部，先防御，后进攻。正如上半年股权风险溢价上升是导致 A 股下跌的核心原因，目前的估值已隐含较悲观假设，下半年股权风险溢价回落也将是 A 股反弹的核心驱动力。近期在货币政策边际宽松与资金供求关系悲观预期修复共同驱动下，市场的反弹将更显著表现在成长股上。但去杠杆路径和中美贸易摩擦尚待清晰，市场风险偏好上行空间仍受制约，更具趋势性的股权风险溢价回落需要等待：1) 信用缓和与扩大内需政策；2) 中美摩擦过程中偏积极的信号。两大催化剂均有望在下半年先后出现。

我们预计 18 年 A 股剔除金融板块能获得 18%左右的盈利增速，ROE 相对平稳。下半年股权风险溢价小幅回落的顺序决定了行业轮动顺序。从行业配置的角度来看，消费配置龙头股估值国际比较依然处于合理区间，将继续作为仓位的主要组成部分。虽然我们对创业板估值水平仍然持谨慎态度，但是三季度部分代表国内科技前进方向的公司有望获得反弹机会。待信用缓和与扩大内需政策更为清晰，则低估值的周期龙头也将迎来反弹机会。

#### 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”）在对大成健康产业混合型证券投资基金（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：大成健康产业混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	2,731,932.24	1,815,023.17
结算备付金		94,628.46	104,630.71
存出保证金		8,031.41	9,576.14
交易性金融资产	6.4.3.2	20,734,148.12	25,832,857.55
其中：股票投资		20,734,148.12	25,802,355.15
基金投资		-	-
债券投资		-	30,502.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	600,000.00	200,000.00
应收证券清算款		-	270,524.18
应收利息	6.4.3.5	898.05	812.03
应收股利		-	-
应收申购款		53,268.73	9,765.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		24,222,907.01	28,243,189.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		117,843.98	-
应付赎回款		14,902.56	208,045.56
应付管理人报酬		31,356.93	35,150.61
应付托管费		5,226.14	5,858.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	40,005.93	43,986.65

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	104,176.48	130,008.45
负债合计		313,512.02	423,049.71
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	25,809,344.27	26,604,157.95
未分配利润	6.4.3.10	-1,899,949.28	1,215,981.38
所有者权益合计		23,909,394.99	27,820,139.33
负债和所有者权益总计		24,222,907.01	28,243,189.04

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.926，基金份额总额 25,809,344.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
<b>一、收入</b>		-2,525,233.08	1,574,649.29
1.利息收入		11,439.15	9,658.63
其中：存款利息收入	6.4.3.11	10,730.43	9,637.80
债券利息收入		57.09	20.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		651.63	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		974,912.08	-644,003.45
其中：股票投资收益	6.4.3.12	794,677.51	-795,446.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	489.31	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	179,745.26	151,442.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-3,517,597.62	2,203,565.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	6,013.31	5,428.65

<b>减：二、费用</b>		471,461.81	497,980.60
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	196,804.81	210,189.07
2. 托管费	6.4.6.2.2	32,800.76	35,031.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	135,292.69	160,965.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.20	-
7. 其他费用	6.4.3.20	106,563.35	91,794.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,996,694.89	1,076,668.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,996,694.89	1,076,668.69

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

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）	26,604,157.95	1,215,981.38	27,820,139.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,996,694.89	-2,996,694.89
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）	-794,813.68	-119,235.77	-914,049.45
其中：1.基金申购款	4,959,084.10	145,597.92	5,104,682.02
2.基金赎回款	-5,753,897.78	-264,833.69	-6,018,731.47
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)	25,809,344.27	-1,899,949.28	23,909,394.99
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)	35,048,729.88	-3,254,772.64	31,793,957.24
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	1,076,668.69	1,076,668.69
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)	-6,691,236.84	630,402.84	-6,060,834.00
其中：1.基金申购款	1,755,727.62	-161,769.01	1,593,958.61
2.基金赎回款	-8,446,964.46	792,171.85	-7,654,792.61
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)	28,357,493.04	-1,547,701.11	26,809,791.93

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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	2,731,932.24
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,731,932.24

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		21,402,777.99	20,734,148.12	-668,629.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		21,402,777.99	20,734,148.12	-668,629.87

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

#### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券	600,000.00	-
合计	600,000.00	-

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购取得的债券。

### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	533.61
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	38.34
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	322.86
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.24
合计	898.05

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	40,005.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,005.93

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	38.13
预提费用	104,138.35
预提审计费	-
预提信息披露费	-
合计	104,176.48

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	26,604,157.95	26,604,157.95
本期申购	4,959,084.10	4,959,084.10
本期赎回(以“-”号填列)	-5,753,897.78	-5,753,897.78

- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	25,809,344.27	25,809,344.27

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,603,382.59	-387,401.21	1,215,981.38
本期利润	520,902.73	-3,517,597.62	-2,996,694.89
本期基金份额交易产生的变动数	-63,193.00	-56,042.77	-119,235.77
其中：基金申购款	445,162.55	-299,564.63	145,597.92
基金赎回款	-508,355.55	243,521.86	-264,833.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,061,092.32	-3,961,041.60	-1,899,949.28

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	10,078.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	579.58
其他	72.02
合计	10,730.43

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	45,875,335.20
减：卖出股票成本总额	45,080,657.69
买卖股票差价收入	794,677.51

**6.4.3.13 债券投资收益****6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	489.31
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	489.31

**6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,511.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	32,000.00
减：应收利息总额	22.09
买卖债券差价收入	489.31

**6.4.3.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.3.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.3.15 衍生工具收益****6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具产生的收益。

**6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具产生的收益。

**6.4.3.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	179,745.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	179,745.26

**6.4.3.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,517,597.62
——股票投资	-3,519,095.22
——债券投资	1,497.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-3,517,597.62

**6.4.3.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,246.64
转换费收入	766.67
合计	6,013.31

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.3.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	135,292.69
银行间市场交易费用	-
合计	135,292.69

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	74,385.57
银行划款手续费	2,425.00
债券帐户维护费	-
持有人大会费用	-
其他	-
合计	106,563.35

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 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	5,026,014.10	5.62%	37,079,366.54	34.81%

#### 6.4.6.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.4 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	4,579.67	5.62%	4,579.67	11.45%
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	33,794.15	34.81%	16,120.44	34.42%

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的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 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	196,804.81	210,189.07
其中：支付销售机构的客户维护费	66,478.63	69,984.36

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日相应顺延。

#### 6.4.6.2.2 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	32,800.76	35,031.50

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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，支付日相应顺延。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.4.1 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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 1 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
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	5,024,120.60	5,024,120.60
期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.4700%	17.7200%

#### 6.4.6.4.2 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。

#### 6.4.6.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		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	2,731,932.24	10,078.83	1,806,770.28	8,765.15

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。

#### 6.4.6.6 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。

#### 6.4.6.7 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。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.8 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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
603456	九洲药业	2018年6月5日	重大事项	9.05	2018年7月5日	8.64	86,400	824,039.00	781,920.00	-
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事项	15.33	2018年7月31日	16.50	24,100	409,832.00	369,453.00	-
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项	23.28	2018年7月10日	24.00	72	2,576.17	1,676.16	-

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 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。

#### 6.4.8.3.2 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。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主

要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票均在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的金融资产大部分不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化的影响。本基金持有的生息资产主要为银行存款等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,731,932.24	-	-	-	2,731,932.24
结算备付金	94,628.46	-	-	-	94,628.46
存出保证金	8,031.41	-	-	-	8,031.41
交易性金融资产	-	-	-	20,734,148.12	20,734,148.12
买入返售金融资产	600,000.00	-	-	-	600,000.00
应收利息	-	-	-	898.05	898.05
应收申购款	-	-	-	53,268.73	53,268.73
资产总计	3,434,592.11	-	-	20,788,314.90	24,222,907.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	117,843.98	117,843.98
应付赎回款	-	-	-	14,902.56	14,902.56
应付管理人报酬	-	-	-	31,356.93	31,356.93
应付托管费	-	-	-	5,226.14	5,226.14
应付交易费用	-	-	-	40,005.93	40,005.93
其他负债	-	-	-	104,176.48	104,176.48
负债总计	-	-	-	313,512.02	313,512.02
利率敏感度缺口	3,434,592.11	-	-	-20,474,802.88	23,909,394.99
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,815,023.17	-	-	-	1,815,023.17

结算备付金	104,630.71	-	-	-	104,630.71
存出保证金	9,576.14	-	-	-	9,576.14
交易性金融资产	-	-	30,502.40	25,802,355.15	25,832,857.55
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	270,524.18	270,524.18
应收利息	-	-	-	812.03	812.03
应收申购款	-	-	-	9,765.26	9,765.26
资产总计	2,129,230.02	-	30,502.40	26,083,456.62	28,243,189.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	208,045.56	208,045.56
应付管理人报酬	-	-	-	35,150.61	35,150.61
应付托管费	-	-	-	5,858.44	5,858.44
应付交易费用	-	-	-	43,986.65	43,986.65
其他负债	-	-	-	130,008.45	130,008.45
负债总计	-	-	-	423,049.71	423,049.71
利率敏感度缺口	2,129,230.02	-	30,502.40	25,660,406.91	27,820,139.33

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有大量交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	20,734,148.12	86.72	25,802,355.15	92.75
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	20,734,148.12	86.72	25,802,355.15	92.75

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升5	1,200,000.00	2,094,209.32
业绩比较基准下降5	-1,200,000.00	-2,094,209.32	

注：本基金的业绩比较基准为申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	20,734,148.12	85.60
	其中：股票	20,734,148.12	85.60
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	600,000.00	2.48
	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	2,826,560.70	11.67
	-	-	0.00
7	其他各项资产	62,198.19	0.26
8	合计	24,222,907.01	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	-	0.00
C	制造业	18,144,069.04	75.89
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	1,859,154.00	7.78
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	730,925.08	3.06
S	综合	-	0.00
	合计	20,734,148.12	86.72

### 7.2.2 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

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	002614	奥佳华	96,800	2,002,792.00	8.38
2	603108	润达医疗	165,700	1,859,154.00	7.78
3	600332	白云山	41,600	1,582,880.00	6.62
4	603579	荣泰健康	22,173	1,551,223.08	6.49
5	600195	中牧股份	64,200	1,248,690.00	5.22
6	002422	科伦药业	37,000	1,187,700.00	4.97
7	000960	锡业股份	90,000	1,080,900.00	4.52
8	600867	通化东宝	40,860	979,414.20	4.10
9	002294	信立泰	26,200	973,854.00	4.07
10	603517	绝味食品	21,900	929,655.00	3.89
11	300596	利安隆	36,900	904,050.00	3.78
12	603337	杰克股份	21,205	824,238.35	3.45
13	603515	欧普照明	17,600	822,624.00	3.44
14	603456	九洲药业	86,400	781,920.00	3.27
15	300138	晨光生物	104,200	734,610.00	3.07
16	300144	宋城演艺	31,100	730,850.00	3.06
17	000650	仁和药业	103,400	657,624.00	2.75
18	002304	洋河股份	4,000	526,400.00	2.20

19	603008	喜临门	24,400	482,632.00	2.02
20	300146	汤臣倍健	24,100	369,453.00	1.55
21	000858	五粮液	3,300	250,800.00	1.05
22	000661	长春高新	1,100	250,470.00	1.05
23	300072	三聚环保	72	1,676.16	0.01
24	603806	福斯特	20	440.20	0.00
25	002343	慈文传媒	4	75.08	0.00
26	002002	鸿达兴业	5	23.05	0.00

## 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	600332	白云山	1,607,904.95	5.78
2	603108	润达医疗	1,574,506.00	5.66
3	000960	锡业股份	1,346,962.00	4.84
4	002343	慈文传媒	1,289,942.00	4.64
5	002422	科伦药业	1,200,126.00	4.31
6	603993	洛阳钼业	1,196,816.00	4.30
7	002223	鱼跃医疗	1,159,724.00	4.17
8	600282	南钢股份	1,152,903.00	4.14
9	600525	长园集团	1,050,986.00	3.78
10	600867	通化东宝	1,032,832.00	3.71
11	603517	绝味食品	1,006,288.00	3.62
12	600285	羚锐制药	992,388.00	3.57
13	000002	万科A	952,629.00	3.42
14	000426	兴业矿业	949,636.00	3.41
15	603515	欧普照明	949,012.00	3.41
16	300138	晨光生物	939,486.00	3.38
17	300596	利安隆	916,526.00	3.29
18	603806	福斯特	915,302.00	3.29
19	603883	老百姓	905,039.00	3.25

20	600623	华谊集团	833,195.00	2.99
21	300601	康泰生物	825,697.00	2.97
22	603456	九洲药业	824,039.00	2.96
23	600028	中国石化	788,932.00	2.84
24	300072	三聚环保	780,007.50	2.80
25	300144	宋城演艺	703,038.00	2.53
26	000650	仁和药业	686,155.00	2.47
27	600048	保利地产	682,385.00	2.45
28	601225	陕西煤业	671,298.00	2.41
29	300188	美亚柏科	670,631.60	2.41
30	600352	浙江龙盛	663,266.00	2.38
31	000932	华菱钢铁	659,069.00	2.37
32	000961	中南建设	617,967.00	2.22
33	002304	洋河股份	572,630.00	2.06

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	300633	开立医疗	2,712,708.00	9.75
2	000661	长春高新	2,519,950.80	9.06
3	603993	洛阳钼业	2,043,893.68	7.35
4	300188	美亚柏科	1,455,436.00	5.23
5	601636	旗滨集团	1,446,240.76	5.20
6	600196	复星医药	1,256,833.93	4.52
7	002343	慈文传媒	1,231,008.04	4.42
8	300601	康泰生物	1,183,729.00	4.25
9	002061	浙江交科	1,178,438.01	4.24
10	600763	通策医疗	1,159,664.93	4.17
11	002223	鱼跃医疗	1,068,083.72	3.84
12	600282	南钢股份	1,062,910.85	3.82
13	000910	大亚圣象	1,010,776.00	3.63
14	600285	羚锐制药	983,376.59	3.53
15	002001	新和成	959,115.00	3.45
16	603883	老百姓	947,652.00	3.41

17	603328	依顿电子	921,360.00	3.31
18	600048	保利地产	893,133.34	3.21
19	603806	福斯特	873,228.04	3.14
20	600525	长园集团	869,992.08	3.13
21	000717	韶钢松山	862,817.00	3.10
22	601100	恒立液压	855,647.00	3.08
23	000002	万科A	838,797.00	3.02
24	600585	海螺水泥	833,474.81	3.00
25	600623	华谊集团	759,198.00	2.73
26	000932	华菱钢铁	712,074.00	2.56
27	600028	中国石化	710,043.62	2.55
28	601225	陕西煤业	707,546.00	2.54
29	000426	兴业矿业	673,100.00	2.42
30	600741	华域汽车	627,587.00	2.26
31	600352	浙江龙盛	626,463.00	2.25
32	300072	三聚环保	609,263.58	2.19
33	603228	景旺电子	573,962.00	2.06

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	43,531,545.88
卖出股票收入（成交）总额	45,875,335.20

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 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。

## 7.8 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贵金属投资明细

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

本基金本报告期末投资股指期货。

## 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	8,031.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	898.05
5	应收申购款	53,268.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,198.19

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
2,370	10,890.02	5,024,120.60	19.47%	20,785,223.67	80.53%

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

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,915.53	0.0384%

### 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（2014年1月24日）基金份额总额	22,376,979.98
本报告期期初基金份额总额	26,604,157.95
本报告期基金总申购份额	4,959,084.10
减：本报告期基金总赎回份额	5,753,897.78
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	25,809,344.27

## §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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
银河证券	1	24,474,120.44	27.37%	22,295.18	27.37%	-
民生证券	1	23,287,259.45	26.05%	21,220.45	26.05%	-
华鑫证券	1	17,058,027.29	19.08%	15,546.60	19.08%	-
国信证券	1	8,342,395.80	9.33%	7,601.46	9.33%	-
长江证券	1	6,121,126.00	6.85%	5,580.02	6.85%	-
中信建投	1	5,097,938.00	5.70%	4,646.12	5.70%	-
光大证券	2	5,026,014.10	5.62%	4,579.67	5.62%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	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%	-
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	2	-	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%	-
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%	-

中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	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%	-

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
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	32,511.40	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	600,000.00	100.00%	-	0.00%
中信建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	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%
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%
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%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	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%

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月22日
3	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月20日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月16日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月9日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年5月17日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年5月4日
8	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年4月21日
9	大成健康产业混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年4月20日
10	关于大成基金管理有限公司南京分公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年4月3日
11	大成健康产业混合型证券投资基金 2017 年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月31日
12	《大成健康产业混合型证券投资基金（原大成健康产业股票型证券投资基金）基金合同》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年3月27日

13	大成健康产业混合基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
14	大成健康产业混合基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
15	关于调整公司旗下证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
16	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开通直销平台基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 10 日
18	大成健康产业混合型证券投资基金更新招募说明书(2018 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 9 日
19	大成健康产业混合型证券投资基金更新招募说明书-摘要(2018 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 9 日
20	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 3 日
21	大成健康产业混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 20 日
22	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 5 日

## §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

无。

### 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3、《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《大成健康产业混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2018 年 8 月 29 日