

大成核心双动力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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心双动力混合型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力混合
基金主代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 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	91,089,218.26 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用“核心-双卫星”策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的混合基金，预期风险收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95588
传真	0755-83199588	010-66105799
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 55 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 55 号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	刘卓	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
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

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	-4,811,558.03
本期利润	-13,527,933.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1368
本期加权平均净值利润率	-11.59%
本期基金份额净值增长率	-12.82%
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	-7,475,147.78
期末可供分配基金份额利润	-0.0821
期末基金资产净值	83,614,070.48
期末基金份额净值	0.918
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	49.21%

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、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交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.13%	1.31%	-5.63%	0.96%	-0.50%	0.35%
过去三个月	-9.89%	1.04%	-7.03%	0.85%	-2.86%	0.19%
过去六个月	-12.82%	1.05%	-8.80%	0.87%	-4.02%	0.18%
过去一年	-7.91%	0.87%	-1.99%	0.71%	-5.92%	0.16%
过去三年	-14.10%	1.44%	-12.94%	1.12%	-1.16%	0.32%
自基金合同	49.21%	1.32%	34.06%	1.10%	15.15%	0.22%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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、按基金合同规定，本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。

2、本基金于 2015 年 7 月 22 日由大成核心双动力股票型证券投资基金更名为大成核心双动力混合型证券投资基金。

§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		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 2 月 28 日	-	8 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013 年 3 月 25 日至 2015 年 1 月 14 日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理助理。2015 年 2 月 28 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015

					<p>年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、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及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部总监	2016 年 3 月 4 日	-	14 年	<p>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。</p>

					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
--	--	--	--	--	---

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

二季度在中美贸易摩擦升级、社融超预期下降和地产政策持续收紧等事件的影响下，A 股市场单边下跌，沪深 300 指数二季度下跌 9.9%，创业板指下跌 15.5%。受经济周期影响较大的传统制造和金融业以及出口收入占比高的电子元器件等行业普遍大幅下跌，食品饮料、餐饮旅游、医药、家电等稳定消费类股票受到追捧，二季度超额收益明显。

报告期内本基金基于基金契约，精选沪深 300 成分股构建了核心组合，同时选择业绩持续增长、估值合理的成长股作为进攻组合。

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 0.918 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.82%，业绩比较基准收益率为-8.80%。

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 2018 下半年，国内经济增长多方面承压。一方面，贸易战对出口的影响将逐渐体现，另一方面，受金融去杠杆和房地产调控影响，地产和基建投资增速难以维持。但我们认为下半年 A 股仍有结构性机会，近期监管在货币政策和财政政策上已经有放松趋势，利好上半年预期过度悲观的周期性板块和有减税新政支持的创新行业。

我们将继续精选受益于供给侧改革、消费升级等的蓝筹股构建核心组合，同时选择受益于经济结构调整、业绩持续增长、估值合理的成长个股进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括三名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大的事件，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。本报告期内已分配利润 4,520,408.17 元（每十份基金份额分红 0.500 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对大成核心双动力混合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，大成核心双动力混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，大成核心双动力混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 4,520,408.17 元。

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核心双动力混合型证券投资基金 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：大成核心双动力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
资产：			
银行存款	6.4.3.1	16,487,771.68	35,975,757.87
结算备付金		284,653.92	705,669.35
存出保证金		31,069.50	43,382.25
交易性金融资产	6.4.3.2	67,154,627.19	120,838,177.36
其中：股票投资		67,154,627.19	120,586,177.36
基金投资		-	-
债券投资		-	252,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	978,221.15
应收利息	6.4.3.5	2,737.85	3,737.30
应收股利		-	-
应收申购款		29,553.37	9,281.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		83,990,413.51	158,554,226.38
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	22,115,283.64
应付赎回款		2,218.89	1,995.28
应付管理人报酬		107,262.53	173,097.55
应付托管费		17,877.10	28,849.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	75,416.68	174,480.66

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	173,567.83	150,007.50
负债合计		376,343.03	22,643,714.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	91,089,218.26	122,962,728.26
未分配利润	6.4.3.10	-7,475,147.78	12,947,783.92
所有者权益合计		83,614,070.48	135,910,512.18
负债和所有者权益总计		83,990,413.51	158,554,226.38

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.918 元，基金份额总额 91,089,218.26 份。

6.2 利润表

会计主体：大成核心双动力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
一、收入		-12,037,884.01	4,805,634.42
1.利息收入		58,171.30	104,701.75
其中：存款利息收入	6.4.3.11	58,149.42	100,618.42
债券利息收入		21.88	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,083.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,422,788.78	-582,174.19
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-4,137,407.86	-1,379,763.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	36,219.38	-
资产支持证券投资收益		-	-
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	678,399.70	797,589.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-8,716,375.90	4,972,934.34
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	43,109.37	310,172.52

减：二、费用		1,490,049.92	1,497,875.05
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	780,386.16	745,893.15
2. 托管费	6.4.6.2.2	130,064.39	124,315.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	404,622.33	537,159.00
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	6.4.3.20	174,977.04	90,507.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,527,933.93	3,307,759.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,527,933.93	3,307,759.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力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）	122,962,728.26	12,947,783.92	135,910,512.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,527,933.93	-13,527,933.93
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）	-31,873,510.00	-2,374,589.60	-34,248,099.60
其中：1. 基金申购款	3,132,967.49	160,811.23	3,293,778.72
2. 基金赎回款	-35,006,477.49	-2,535,400.83	-37,541,878.32
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）	-	-4,520,408.17	-4,520,408.17
五、期末所有者权益	91,089,218.26	-7,475,147.78	83,614,070.48

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
	(基金净值)		
一、期初所有者权益 (基金净值)	309,489,012.68	678,399.81	310,167,412.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,307,759.37	3,307,759.37
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)	-187,578,544.58	1,639,498.71	-185,939,045.87
其中：1.基金申购款	62,090,801.82	2,340,067.47	64,430,869.29
2.基金赎回款	-249,669,346.40	-700,568.76	-250,369,915.16
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)	121,910,468.10	5,625,657.89	127,536,125.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 罗登攀 周立新 崔伟
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

(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。

(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。

(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	16,487,771.68
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：	16,487,771.68

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	73,752,120.27	67,154,627.19	-6,597,493.08
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	73,752,120.27	67,154,627.19	-6,597,493.08

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工具。

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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	2,607.92
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	115.29
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	-
应收申购款利息	2.13
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.51
合计	2,737.85

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	75,416.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	75,416.68

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	6.93
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	148,765.71
其他	-
合计	173,567.83

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	122,962,728.26	122,962,728.26
本期申购	3,132,967.49	3,132,967.49
本期赎回(以“-”号填列)	-35,006,477.49	-35,006,477.49
本期末	91,089,218.26	91,089,218.26

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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	23,641,301.85	-10,693,517.93	12,947,783.92
本期利润	-4,811,558.03	-8,716,375.90	-13,527,933.93
本期基金份额交易产生的变动数	-5,930,220.07	3,555,630.47	-2,374,589.60
其中：基金申购款	471,481.95	-310,670.72	160,811.23

基金赎回款	-6,401,702.02	3,866,301.19	-2,535,400.83
本期已分配利润	-4,520,408.17	-	-4,520,408.17
本期末	8,379,115.58	-15,854,263.36	-7,475,147.78

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	56,095.23
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	1,700.35
其他	353.84
合计	58,149.42

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	148,787,093.40
减：卖出股票成本总额	152,924,501.26
买卖股票差价收入	-4,137,407.86

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	338,769.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	302,500.00
减：应收利息总额	50.54
买卖债券差价收入	36,219.38

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	678,399.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	678,399.70

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	-8,716,375.90
——股票投资	-8,716,375.90
——债券投资	-
——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	-8,716,375.90

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	43,028.49
基金转换费收入	80.88
合计	43,109.37

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

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 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	404,622.33
银行间市场交易费用	-
合计	404,622.33

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	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	1,416.14
债券托管帐户维护费	-
合计	174,977.04

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**

截至本报告期末，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

截至财务报表批准报出日，本基金无需做披露的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。

6.4.5.2 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

6.4.6 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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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	780,386.16	745,893.15
其中：支付销售机构的客户维护费	91,985.24	108,426.42

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 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，支付日期顺延。

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	130,064.39	124,315.54

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 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

假日、休息日，支付日期顺延。

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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.6.4 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

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。

6.4.6.4.2 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
中国工商银行	16,487,771.68	56,095.23	21,296,862.52	97,490.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金于本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。

6.4.7 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018年5月23日	2018年5月23日	0.5000	3,672,308.07	848,100.10	4,520,408.17	
合计	-	-	0.5000	3,672,308.07	848,100.10	4,520,408.17	

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

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。

6.4.8.2 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
601727	上海电气	2018年6月7日	重大事项	6.34	2018年8月7日	5.71	157,200	920,495.00	996,648.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项	32.50	-	-	15,300	525,761.00	497,250.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项	4.30	-	-	67,600	301,306.51	290,680.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	26,794	283,732.00	254,275.06	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大事项	2.02	2018年8月16日	1.83	112,700	229,995.00	227,654.00	-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项	6.71	-	-	20,300	148,228.67	136,213.00	-
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	6,720	117,878.00	119,280.00	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	重大事项	3.94	-	-	29,100	112,158.00	114,654.00	-

		日	项							
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事件	6.40	-	-	12,600	99,540.00	80,640.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事件	10.64	-	-	3,100	56,018.92	32,984.00	-
300238	冠昊生物	2018年2月2日	重大事件	18.87	2018年7月18日	16.98	1,600	45,882.67	30,192.00	-
002464	众应互联	2018年2月2日	重大事件	21.19	2018年7月31日	19.07	980	19,523.00	20,766.20	-
603315	福鞍股份	2018年4月9日	重大事件	12.44	2018年8月1日	13.20	1,200	19,272.00	14,928.00	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事件	9.70	-	-	900	9,648.00	8,730.00	-
002113	天润数娱	2018年2月1日	重大事件	5.78	-	-	1,360	9,104.00	7,860.80	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事件	3.60	2018年7月3日	3.26	2,100	9,786.00	7,560.00	-
002609	捷顺科技	2018年6月19日	重大事件	9.52	2018年7月3日	8.57	700	9,926.00	6,664.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌
的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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(合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现而带来的变现困难。

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，约定在非正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同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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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	16,487,771.68	-	-	-	16,487,771.68
结算备付金	284,653.92	-	-	-	284,653.92
存出保证金	31,069.50	-	-	-	31,069.50
交易性金融资产	-	-	-	67,154,627.19	67,154,627.19
应收利息	-	-	-	2,737.85	2,737.85
应收申购款	-	-	-	29,553.37	29,553.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,803,495.10	-	-	67,186,918.41	83,990,413.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,218.89	2,218.89
应付管理人报酬	-	-	-	107,262.53	107,262.53
应付托管费	-	-	-	17,877.10	17,877.10
应付交易费用	-	-	-	75,416.68	75,416.68
其他负债	-	-	-	173,567.83	173,567.83
负债总计	-	-	-	376,343.03	376,343.03
利率敏感度缺口	16,803,495.10	-	-	66,810,575.38	83,614,070.48
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	35,975,757.87	-	-	-	35,975,757.87
结算备付金	705,669.35	-	-	-	705,669.35
存出保证金	43,382.25	-	-	-	43,382.25
交易性金融资产	-	22,200.00	229,800.00	120,586,177.36	120,838,177.36
应收证券清算款	-	-	-	978,221.15	978,221.15
应收利息	-	-	-	3,737.30	3,737.30
应收申购款	9.99	-	-	9,271.11	9,281.10
资产总计	36,724,819.46	22,200.00	229,800.00	121,577,406.92	158,554,226.38
负债					
应付证券清算款	-	-	-	22,115,283.64	22,115,283.64
应付赎回款	-	-	-	1,995.28	1,995.28

应付管理人报酬	-	-	-	173,097.55	173,097.55
应付托管费	-	-	-	28,849.57	28,849.57
应付交易费用	-	-	-	174,480.66	174,480.66
其他负债	-	-	-	150,007.50	150,007.50
负债总计	-	-	-	22,643,714.20	22,643,714.20
利率敏感度缺口	36,724,819.46	22,200.00	229,800.00	98,933,692.72	135,910,512.18

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2018 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。（2017 年 12 月 31 日：同）

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

		(%)		
交易性金融资产-股票投资	67,154,627.19	80.31	-	0.00
交易性金融资产-基金投资	-	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	67,154,627.19	80.31	-	0.00

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%	4,830,000.00	7,347,066.67
业绩比较基准下降 5%	-4,830,000.00	-7,347,066.67	

注：本基金的业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数

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	67,154,627.19	79.96
	其中：股票	67,154,627.19	79.96
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	16,772,425.60	19.97
7	其他各项资产	63,360.72	0.08
8	合计	83,990,413.51	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	418,230.00	0.50
B	采矿业	1,949,345.40	2.33
C	制造业	32,075,455.20	38.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,574,371.00	1.88
E	建筑业	2,002,203.00	2.39
F	批发和零售业	3,261,317.00	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,053,474.00	2.46
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,808,258.11	3.36
J	金融业	15,275,688.98	18.27
K	房地产业	3,633,434.00	4.35
L	租赁和商务服务业	709,303.50	0.85

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	461,083.00	0.55
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	932,464.00	1.12
S	综合	-	0.00
	合计	67,154,627.19	80.31

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601328	交通银行	368,800	2,116,912.00	2.53
2	601288	农业银行	582,300	2,003,112.00	2.40
3	600887	伊利股份	71,300	1,989,270.00	2.38
4	600690	青岛海尔	101,500	1,954,890.00	2.34
5	600015	华夏银行	255,700	1,904,965.00	2.28
6	601601	中国太保	58,300	1,856,855.00	2.22
7	000858	五粮液	24,300	1,846,800.00	2.21
8	601628	中国人寿	77,900	1,754,308.00	2.10
9	600837	海通证券	178,834	1,693,557.98	2.03
10	000963	华东医药	33,300	1,606,725.00	1.92
11	002008	大族激光	28,800	1,531,872.00	1.83
12	000001	平安银行	163,900	1,489,851.00	1.78
13	600048	保利地产	102,900	1,255,380.00	1.50
14	601688	华泰证券	72,200	1,080,834.00	1.29
15	601727	上海电气	157,200	996,648.00	1.19
16	000338	潍柴动力	106,700	933,625.00	1.12
17	601186	中国铁建	105,000	905,100.00	1.08
18	600104	上汽集团	25,600	895,744.00	1.07
19	000100	TCL 集团	271,500	787,350.00	0.94
20	000413	东旭光电	128,000	775,680.00	0.93
21	600352	浙江龙盛	64,100	765,995.00	0.92

22	600705	中航资本	159,000	742,530.00	0.89
23	002422	科伦药业	22,700	728,670.00	0.87
24	601006	大秦铁路	87,800	720,838.00	0.86
25	300122	智飞生物	13,700	626,638.00	0.75
26	002024	苏宁易购	42,600	599,808.00	0.72
27	600522	中天科技	67,200	592,032.00	0.71
28	002230	科大讯飞	18,300	586,881.00	0.70
29	600332	白云山	15,300	582,165.00	0.70
30	600795	国电电力	218,000	571,160.00	0.68
31	000898	鞍钢股份	100,000	557,000.00	0.67
32	000860	顺鑫农业	14,700	551,250.00	0.66
33	000157	中联重科	127,500	524,025.00	0.63
34	600188	兖州煤业	39,700	517,688.00	0.62
35	000425	徐工机械	121,600	515,584.00	0.62
36	300251	光线传媒	50,000	509,000.00	0.61
37	600271	航天信息	20,000	505,400.00	0.60
38	601857	中国石油	65,100	501,921.00	0.60
39	002602	世纪华通	15,300	497,250.00	0.59
40	601155	新城控股	15,900	492,423.00	0.59
41	600518	康美药业	21,500	491,920.00	0.59
42	002460	赣锋锂业	12,000	462,960.00	0.55
43	300070	碧水源	33,100	461,083.00	0.55
44	600050	中国联通	92,800	456,576.00	0.55
45	600029	南方航空	53,800	454,610.00	0.54
46	600801	华新水泥	29,600	444,888.00	0.53
47	600737	中粮糖业	56,700	427,518.00	0.51
48	002001	新和成	22,270	422,239.20	0.50
49	002299	圣农发展	27,000	418,230.00	0.50
50	002340	格林美	67,900	410,795.00	0.49
51	000060	中金岭南	84,450	410,427.00	0.49
52	600068	葛洲坝	55,200	397,992.00	0.48
53	600208	新潮中宝	100,000	382,000.00	0.46
54	000418	小天鹅A	5,500	381,425.00	0.46
55	000768	中航飞机	24,200	378,488.00	0.45
56	600426	华鲁恒升	20,700	364,113.00	0.44
57	000050	深天马A	25,400	361,188.00	0.43
58	601991	大唐发电	118,400	358,752.00	0.43
59	600884	杉杉股份	16,100	355,810.00	0.43
60	600325	华发股份	46,000	355,580.00	0.43

61	002146	荣盛发展	40,600	354,438.00	0.42
62	601618	中国中冶	105,800	352,314.00	0.42
63	601888	中国国旅	5,400	347,814.00	0.42
64	000636	风华高科	21,900	347,772.00	0.42
65	002013	中航机电	44,600	337,622.00	0.40
66	002195	二三四五	78,624	336,510.72	0.40
67	002233	塔牌集团	29,200	334,048.00	0.40
68	002174	游族网络	15,800	314,420.00	0.38
69	000830	鲁西化工	18,300	312,564.00	0.37
70	600585	海螺水泥	9,200	308,016.00	0.37
71	600673	东阳光科	29,500	304,735.00	0.36
72	000703	恒逸石化	20,160	299,980.80	0.36
73	600811	东方集团	67,600	290,680.00	0.35
74	300182	捷成股份	37,700	285,766.00	0.34
75	600260	凯乐科技	10,400	279,136.00	0.33
76	002373	千方科技	20,900	272,745.00	0.33
77	002078	太阳纸业	27,500	266,475.00	0.32
78	601216	君正集团	76,700	258,479.00	0.31
79	002127	南极电商	27,450	257,755.50	0.31
80	300324	旋极信息	26,794	254,275.06	0.30
81	603799	华友钴业	2,600	253,422.00	0.30
82	002517	恺英网络	34,950	251,290.50	0.30
83	000581	威孚高科	10,500	232,155.00	0.28
84	002465	海格通信	28,700	230,461.00	0.28
85	600410	华胜天成	26,100	228,375.00	0.27
86	600022	山东钢铁	112,700	227,654.00	0.27
87	000627	天茂集团	31,300	219,726.00	0.26
88	601333	广深铁路	50,500	214,625.00	0.26
89	601168	西部矿业	33,600	211,008.00	0.25
90	600643	爱建集团	22,300	209,620.00	0.25
91	000078	海王生物	42,700	205,387.00	0.25
92	600875	东方电气	27,600	204,516.00	0.24
93	300274	阳光电源	22,500	201,825.00	0.24
94	600755	厦门国贸	27,500	200,475.00	0.24
95	600216	浙江医药	15,600	199,212.00	0.24
96	002384	东山精密	8,300	199,200.00	0.24
97	002491	通鼎互联	17,800	197,046.00	0.24
98	600270	外运发展	9,300	194,928.00	0.23
99	002176	江特电机	19,800	192,456.00	0.23

100	600153	建发股份	21,000	188,790.00	0.23
101	600028	中国石化	28,500	184,965.00	0.22
102	600808	马钢股份	51,400	184,526.00	0.22
103	002385	大北农	44,500	183,785.00	0.22
104	000031	中粮地产	31,300	180,914.00	0.22
105	600073	上海梅林	27,100	179,944.00	0.22
106	601000	唐山港	75,660	177,801.00	0.21
107	002056	横店东磁	25,300	177,353.00	0.21
108	600823	世茂股份	42,200	176,396.00	0.21
109	000975	银泰资源	17,360	176,030.40	0.21
110	600704	物产中大	32,400	169,452.00	0.20
111	600664	哈药股份	42,400	168,328.00	0.20
112	600863	内蒙华电	74,000	167,980.00	0.20
113	600059	古越龙山	20,200	164,630.00	0.20
114	600017	日照港	51,000	163,710.00	0.20
115	000718	苏宁环球	43,600	160,012.00	0.19
116	002635	安洁科技	9,100	156,520.00	0.19
117	000926	福星股份	21,400	153,866.00	0.18
118	002332	仙琚制药	17,500	153,125.00	0.18
119	002440	闰土股份	12,900	150,801.00	0.18
120	000528	柳 工	13,900	148,869.00	0.18
121	002366	台海核电	9,800	139,748.00	0.17
122	600970	中材国际	20,800	138,944.00	0.17
123	601699	潞安环能	14,900	137,974.00	0.17
124	600757	长江传媒	24,200	137,698.00	0.16
125	002463	沪电股份	36,800	137,632.00	0.16
126	600291	西水股份	10,200	136,272.00	0.16
127	002431	棕榈股份	20,300	136,213.00	0.16
128	603515	欧普照明	2,800	130,872.00	0.16
129	600098	广州发展	19,900	128,355.00	0.15
130	600611	大众交通	31,900	126,962.00	0.15
131	600623	华谊集团	12,300	122,754.00	0.15
132	600565	迪马股份	41,500	122,425.00	0.15
133	000543	皖能电力	27,600	121,716.00	0.15
134	601678	滨化股份	19,600	121,128.00	0.14
135	603766	隆鑫通用	22,000	119,460.00	0.14
136	601016	节能风电	41,600	119,392.00	0.14
137	600750	江中药业	6,720	119,280.00	0.14
138	600759	洲际油气	29,100	114,654.00	0.14

139	002572	索菲亚	3,500	112,630.00	0.13
140	600580	卧龙电气	14,600	111,252.00	0.13
141	600765	中航重机	14,400	107,136.00	0.13
142	600578	京能电力	34,300	107,016.00	0.13
143	600348	阳泉煤业	14,700	105,105.00	0.13
144	600640	号百控股	10,200	103,734.00	0.12
145	300273	和佳股份	15,100	102,378.00	0.12
146	002118	紫鑫药业	13,500	96,525.00	0.12
147	601717	郑煤机	15,600	90,636.00	0.11
148	600277	亿利洁能	15,900	83,316.00	0.10
149	002011	盾安环境	12,600	80,640.00	0.10
150	600582	天地科技	21,800	80,006.00	0.10
151	603001	奥康国际	6,700	79,797.00	0.10
152	601777	力帆股份	14,100	73,743.00	0.09
153	000662	天夏智慧	11,181	71,893.83	0.09
154	002482	广田集团	12,000	71,640.00	0.09
155	002428	云南锗业	9,100	70,252.00	0.08
156	600908	无锡银行	11,400	67,146.00	0.08
157	002815	崇达技术	3,200	51,520.00	0.06
158	600485	信威集团	3,100	32,984.00	0.04
159	300238	冠昊生物	1,600	30,192.00	0.04
160	601718	际华集团	5,800	23,316.00	0.03
161	002464	众应互联	980	20,766.20	0.02
162	603315	福鞍股份	1,200	14,928.00	0.02
163	002512	达华智能	900	8,730.00	0.01
164	002113	天润数娱	1,360	7,860.80	0.01
165	002426	胜利精密	2,100	7,560.00	0.01
166	002609	捷顺科技	700	6,664.00	0.01
167	600309	万华化学	60	2,725.20	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	601688	华泰证券	2,831,706.00	2.08

2	601328	交通银行	2,301,312.00	1.69
3	600015	华夏银行	2,256,573.00	1.66
4	000725	京东方A	2,111,002.00	1.55
5	601601	中国太保	2,090,840.00	1.54
6	600519	贵州茅台	1,970,553.00	1.45
7	600887	伊利股份	1,882,597.00	1.39
8	000858	五粮液	1,871,370.00	1.38
9	600048	保利地产	1,799,500.00	1.32
10	002008	大族激光	1,492,648.04	1.10
11	600690	青岛海尔	1,471,251.00	1.08
12	600332	白云山	1,353,480.00	1.00
13	600837	海通证券	1,307,511.00	0.96
14	000001	平安银行	1,249,553.69	0.92
15	603160	汇顶科技	1,207,746.00	0.89
16	000963	华东医药	1,164,860.00	0.86
17	300122	智飞生物	1,134,287.00	0.83
18	601600	中国铝业	1,050,915.00	0.77
19	000413	东旭光电	1,026,661.00	0.76
20	600570	恒生电子	1,021,639.00	0.75

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	600519	贵州茅台	5,200,666.00	3.83
2	000858	五粮液	3,113,632.98	2.29
3	600703	三安光电	2,728,632.00	2.01
4	601939	建设银行	2,482,643.00	1.83
5	601009	南京银行	2,346,270.00	1.73
6	600816	安信信托	1,978,772.92	1.46
7	601601	中国太保	1,922,631.00	1.41
8	601155	新城控股	1,882,487.72	1.39
9	600999	招商证券	1,838,597.48	1.35
10	601688	华泰证券	1,697,844.03	1.25
11	600048	保利地产	1,693,486.00	1.25

12	000725	京东方 A	1,671,215.00	1.23
13	600436	片仔癀	1,666,468.00	1.23
14	601169	北京银行	1,625,096.40	1.20
15	601600	中国铝业	1,435,996.00	1.06
16	000513	丽珠集团	1,430,167.00	1.05
17	600518	康美药业	1,393,490.00	1.03
18	002065	东华软件	1,380,241.20	1.02
19	600900	长江电力	1,281,889.00	0.94
20	600498	烽火通信	1,247,969.49	0.92

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	108,209,326.99
卖出股票收入（成交）总额	148,787,093.40

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。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328）的发行主体交通银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018）1 号）。本基金认为，对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

本基金投资的前十名证券之一中国人寿（601628）的发行主体中国人寿保险股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018）5 号）。本基金认为，对中国人寿的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	31,069.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,737.85
5	应收申购款	29,553.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,360.72

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未存在流通受限情况。

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
3,167	28,761.99	56,885,860.09	62.45%	34,203,358.17	37.55%

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	13,063.20	0.0143%

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（2010年6月22日）基金份额总额	1,173,262,454.69
本报告期期初基金份额总额	122,962,728.26
本报告期基金总申购份额	3,132,967.49
减：本报告期基金总赎回份额	35,006,477.49
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	91,089,218.26

§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

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、托管人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			
长江证券	1	143,364,066.74	56.04%	130,628.68	56.04%	-
海通证券	1	67,136,294.86	26.25%	61,180.76	26.25%	-
申万宏源	1	45,302,118.35	17.71%	41,284.28	17.71%	-
中信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	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。

本报告期内退出交易单元：无。

本报告期内新增交易单元：海通证券。

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
海通证券	53,889.06	15.91%	-	0.00%	-	0.00%
申万宏源	284,880.86	84.09%	-	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
4	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
5	关于大成核心双动力混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 29 日
6	大成基金管理有限公司关于大成核心双动力混合型证券投资基金 2018 年第 1 次分红的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 22 日
7	关于大成核心双动力混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 19 日
8	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
9	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
10	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 5 月 3 日
11	大成核心双动力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
12	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
13	大成核心双动力混合型证券投资基金 2017 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 31 日
14	《大成核心双动力混合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
15	大成核心双动力混合基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日

16	大成核心双动力混合基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
17	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
18	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
19	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
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 2 月 10 日
22	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 2 月 7 日
23	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 2 月 6 日
24	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书-摘要（2017 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 2 月 6 日
25	大成核心双动力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
26	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

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	20180101-20180213	30,000,000.00	0.00	30,000,000.00	0.00	0.00%
	2	20180101-20180630	25,772,551.55	0.00	0.00	25,772,551.55	28.29%
	3	20180101-20180630	31,113,308.54	0.00	0.00	31,113,308.54	34.16%
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。

§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《大成核心双动力股票型证券投资基金》的文件；
- 2、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 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