

# 大成积极成长混合型证券投资基金 2018 年年度报告 摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 29 日

## 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成积极成长混合
基金主代码	519017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 1 月 16 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	931,661,644.19 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在优化组合投资基础上，主要投资于有良好成长潜力的上市公司，尽可能规避投资风险，谋求基金财产长期增值。
投资策略	本基金主要根据 GDP 增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A 股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数 CPI 增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标以及国家政策的变化，对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量、定性分析，作出资产配置决策。本基金还力争通过财务指标分析、成长型筛选、估值比较、实地调研等深入、科学的基本面分析，挖掘具有良好成长性的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 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，属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	0755-83199588	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-91,675,322.07	121,848,031.57	18,781,206.42
本期利润	-284,155,206.80	190,235,325.15	-163,936,355.92
加权平均基金份额本期利润	-0.3058	0.1840	-0.1535
本期基金份额净值增长率	-28.18%	18.17%	-9.01%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2178	0.2232	0.0922
期末基金资产净值	728,740,196.01	1,104,865,117.48	1,225,586,571.85
期末基金份额净值	0.782	1.223	1.092

注:1、本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

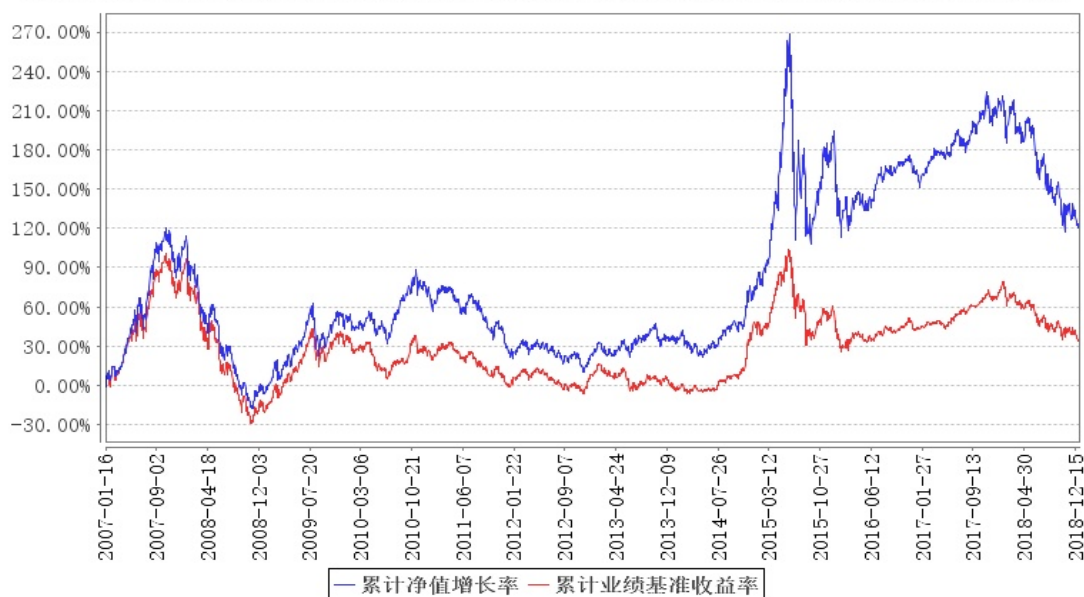
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-12.72%	1.79%	-9.51%	1.31%	-3.21%	0.48%
过去六个月	-18.20%	1.59%	-10.68%	1.20%	-7.52%	0.39%
过去一年	-28.18%	1.47%	-19.28%	1.07%	-8.90%	0.40%
过去三年	-22.78%	1.33%	-13.32%	0.94%	-9.46%	0.39%
过去五年	61.97%	1.67%	32.69%	1.23%	29.28%	0.44%
自基金合同生效起至今	122.54%	1.63%	34.85%	1.43%	87.69%	0.20%

### 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

大成积极成长混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注： 1、按基金合同规定，大成积极成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起 3 个月内为建仓期。截至建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

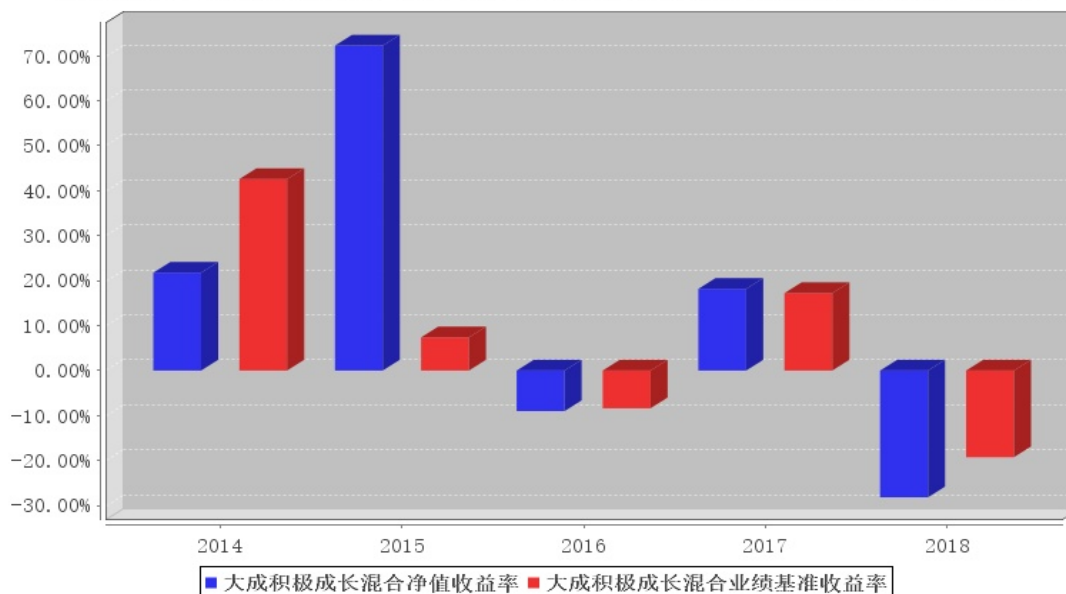
2、本基金业绩比较基准自 2009 年 2 月 2 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中证综合债券指数×20%，本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从 2007 年 1 月 15 日（基金合同生效暨基金转型日）至 2009 年 2 月 1 日为原业绩比较基准（新华富时 600 成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%）的走势，2009 年 2 月 2 日起为变更后的业绩比较基准的走势。

3. 本基金于 2007 年 1 月 16 日由景业证券投资基金转型为积极成长股票型证券投资基金。

4. 本基金于 2015 年 7 月 3 日由积极成长股票型证券投资基金更名为积极成长混合型证券投资基金。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成积极成长混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018 年	1.3400	55,598,207.62	63,321,833.76	118,920,041.38	-
2017 年	0.5550	33,593,654.34	28,598,171.46	62,191,825.80	-
2016 年	4.6090	244,971,522.59	168,744,409.19	413,715,931.78	-
合计	6.5040	334,163,384.55	260,664,414.41	594,827,798.96	-

## § 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII以及QFLP等资格。

历经二十年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、

境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2018 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 81 只。

#### 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		
王磊	本基金基金经理	2017 年 6 月 9 日	-	15	<p>经济学硕士。</p> <p>2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 日到 2016 年 3 月 25 日</p>

					<p>任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2014 年 12 月 9 日至 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 21 日至 2019 年 1 月 9 日任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日起任大成财富管理 2020 混合型证券投资基金投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
齐炜中	本基金基金经理助理	2017 年 2 月 20 日	-	6	<p>金融学硕士。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员、</p>



					<p>社保基金及机构投资部基金经理助理。2017年2月20日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
孙丹	本基金基金经理助理	2018年3月12日	-	10	<p>经济学硕士。2008年至2012年就职于景顺长城产品开发部任产品经理。2012年至2014年就职于华夏基金机构债券投资部任研究员。2014年5月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2018年3月12日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合</p>

					<p>型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2018 年 5 月 25 日任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 31 日起任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日起任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。</p> <p>2017 年 6 月 6 日起任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>30 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2018 年 5 月 26 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

##### 4.3.2 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较大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较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，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。

#### 4.3.3 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 3 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，我国宏观经济的外部环境和内部环境均出现了一定的不确定性。从外部环境看，受美国贸易战的影响，我国部分出口行业出现了较大的下行压力。从内部环境看，我国从 2018 年开始，采取了金融去杠杆政策和部分行业去产能政策。这些措施延续到今年上半年取得了明显成效，有效的缓解了金融风险，化解了部分周期行业的过剩产能，但其客观上也对部分行业的经营产生了一定的压力，其盈利能力从 2018 年第三季度开始出现明显下行。从 2018 年第三季度开始，我国政府关注到经济下行的压力，及时调整了政策并采取一系列措施来提振经济。这些措施包括实施降税减费，加强信贷投放，出台改善民营企业融资难等一系列政策以提升整体经济活力。这些措施对宏观经济和资本市场的信心起到很好的提振作用。

从市场整体上看，2018 年 A 股市场整体表现不佳。上证综指全年跌幅 24.59%，深证综指全年跌幅 33.25%，创业板指数全年跌幅 28.65%。从行业上看，休闲服务、银行、食品饮料跌幅相对较少。

#### 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 0.782 元；本报告期基金份额净值增长率为-28.18%，业绩比较基准收益率为-19.28%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，我国资本市场所面临的外部环境和内部环境都有望继续改善。从外部环境看，我

国同美国的贸易战有望和解。从内部看，我国在 2018 年下半年所采取的一系列稳经济和稳信心的措施将进一步落地，为我国的经济提供支撑。因此，2019 年 A 股市场的机会大概率好于 2018 年。从行业和投资主题上，我们倾向于受益于国家产业升级政策的行业以及必需消费品行业。同时，具有确定性成长潜力的科技创新类公司也是我们重点关注的方向。

#### 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、交易管理部、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五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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

118,920,041.38 元（每十份基金份额分红 1.340 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成积极成长混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	136,135,604.99	108,065,089.33
结算备付金	3,648,792.17	2,119,176.92
存出保证金	452,854.73	802,558.99
交易性金融资产	609,732,253.88	952,865,061.36
其中：股票投资	609,732,253.88	952,865,061.36
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	-	49,970,194.96
应收证券清算款	-	-
应收利息	29,854.26	59,968.99
应收股利	-	-
应收申购款	21,011.31	39,229.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	752,904,883.98	1,116,805,793.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	18,090,199.65	5,469,030.50
应付赎回款	109,449.98	297,345.17
应付管理人报酬	954,000.36	1,397,994.36
应付托管费	159,000.06	232,999.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,366,342.66	1,057,561.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,485,695.26	3,485,745.41
负债合计	24,164,687.97	11,940,675.60
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	931,661,644.19	903,276,023.98
未分配利润	-202,921,448.18	201,589,093.50
所有者权益合计	728,740,196.01	1,104,865,117.48
负债和所有者权益总计	752,904,883.98	1,116,805,793.08

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.782 元，基金份额总额 931,661,644.19 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成积极成长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-259,296,380.89	220,803,703.51
1. 利息收入	1,061,921.45	1,777,263.88
其中：存款利息收入	1,055,793.25	1,292,944.79
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,128.20	484,319.09
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-67,927,134.85	150,322,204.42
其中：股票投资收益	-78,349,300.92	138,305,683.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	10,422,166.07	12,016,521.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-192,479,884.73	68,387,293.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	48,717.24	316,941.63
减：二、费用	24,858,825.91	30,568,378.36
1. 管理人报酬	13,414,769.98	17,524,776.79
2. 托管费	2,235,795.02	2,920,796.07
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,756,359.16	9,658,265.53
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	451,901.75	464,539.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-284,155,206.80	190,235,325.15
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-284,155,206.80	190,235,325.15

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成积极成长混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	903,276,023.98	201,589,093.50	1,104,865,117.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-284,155,206.80	-284,155,206.80
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)	28,385,620.21	-1,435,293.50	26,950,326.71
其中: 1. 基金申购款	127,650,632.23	6,383,690.42	134,034,322.65
2. 基金赎回款	-99,265,012.02	-7,818,983.92	-107,083,995.94
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)	-	-118,920,041.38	-118,920,041.38
五、期末所有者权益(基金净值)	931,661,644.19	-202,921,448.18	728,740,196.01
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	1, 122, 110, 449. 31	103, 476, 122. 54	1, 225, 586, 571. 85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	190, 235, 325. 15	190, 235, 325. 15
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）	-218, 834, 425. 33	-29, 930, 528. 39	-248, 764, 953. 72
其中：1. 基金申购款	138, 230, 382. 60	12, 435, 443. 84	150, 665, 826. 44
2. 基金赎回款	-357, 064, 807. 93	-42, 365, 972. 23	-399, 430, 780. 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）	-	-62, 191, 825. 80	-62, 191, 825. 80
五、期末所有者权益（基金净值）	903, 276, 023. 98	201, 589, 093. 50	1, 104, 865, 117. 48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1.1 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。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等

增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 7.4.3 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 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12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	286,529,186.21	4.93	407,549,596.38	6.42

###### 7.4.4.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	120,000,000.00	25.26

###### 7.4.4.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.4.1.5 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12月31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	261,121.21	4.93	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	371,404.13	6.42	109,112.78	10.32

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,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。

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,414,769.98	17,524,776.79
其中:支付销售机构的客户维护费	2,465,110.38	2,957,846.53

注:支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50%/ 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,235,795.02	2,920,796.07

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数。

## 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 7.4.4.4.2 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

无。

## 7.4.4.5 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12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	136,135,604.99	1,009,307.41	108,065,089.33	1,234,565.36

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	新股 流通 受限	13.77	10.97	703,067	9,681,232.59	7,712,644.99	-
601860	紫	2018-12-20	2019-01-03	新股	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

	金 银 行			认购						
--	-------------	--	--	----	--	--	--	--	--	--

注:基金可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	609,732,253.88	80.98
	其中:股票	609,732,253.88	80.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	139,784,397.16	18.57
8	其他各项资产	3,388,232.94	0.45
9	合计	752,904,883.98	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	-	-
B	采矿业	31,630,400.52	4.34
C	制造业	389,617,957.65	53.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,258,045.32	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	18,632,600.60	2.56
K	房地产业	49,745,921.85	6.83
L	租赁和商务服务业	53,803,672.04	7.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	57,043,655.90	7.83
S	综合	-	-
	合计	609,732,253.88	83.67

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300144	宋城演艺	2,671,834	57,043,655.90	7.83
2	600519	贵州茅台	83,200	49,088,832.00	6.74
3	300408	三环集团	1,733,557	29,331,784.44	4.02
4	002027	分众传媒	5,407,071	28,333,052.04	3.89
5	000002	万科A	1,184,148	28,206,405.36	3.87
6	600887	伊利股份	1,228,896	28,117,140.48	3.86
7	300122	智飞生物	701,175	27,177,543.00	3.73
8	601888	中国国旅	423,100	25,470,620.00	3.50
9	002008	大族激光	820,572	24,912,565.92	3.42
10	002422	科伦药业	1,171,921	24,200,168.65	3.32

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>)的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300122	智飞生物	76,532,807.94	6.93
2	600048	保利地产	63,840,578.61	5.78
3	300144	宋城演艺	61,315,930.71	5.55
4	600438	通威股份	58,038,690.43	5.25
5	600519	贵州茅台	54,388,241.60	4.92
6	601899	紫金矿业	54,288,462.76	4.91
7	601888	中国国旅	53,276,746.33	4.82
8	000002	万科A	52,007,508.31	4.71
9	000960	锡业股份	51,379,055.07	4.65
10	603986	兆易创新	50,701,092.25	4.59
11	601012	隆基股份	50,306,890.20	4.55
12	002456	欧菲科技	50,291,424.00	4.55
13	600383	金地集团	50,051,282.26	4.53
14	000069	华侨城A	48,495,029.58	4.39
15	600885	宏发股份	48,275,342.28	4.37
16	000001	平安银行	46,985,374.10	4.25
17	000333	美的集团	46,677,898.31	4.22
18	600887	伊利股份	45,649,061.84	4.13
19	300033	同花顺	44,904,956.24	4.06
20	002146	荣盛发展	40,247,541.33	3.64
21	000063	中兴通讯	39,160,089.80	3.54
22	300308	中际旭创	36,971,212.45	3.35
23	300408	三环集团	35,512,495.74	3.21
24	600271	航天信息	34,770,509.30	3.15
25	300476	胜宏科技	33,513,285.66	3.03
26	002422	科伦药业	31,752,639.04	2.87
27	000858	五粮液	30,930,484.34	2.80
28	002821	凯莱英	30,012,498.08	2.72
29	002304	洋河股份	29,882,527.18	2.70
30	601336	新华保险	29,754,641.25	2.69
31	002008	大族激光	29,743,111.14	2.69
32	002081	金螳螂	29,427,511.00	2.66
33	600547	山东黄金	28,741,742.00	2.60
34	002466	天齐锂业	27,049,174.53	2.45
35	002460	赣锋锂业	26,916,312.34	2.44
36	000910	大亚圣象	26,416,700.64	2.39

37	600623	华谊集团	23,825,269.37	2.16
38	600409	三友化工	22,540,277.00	2.04
39	002714	牧原股份	22,496,891.76	2.04
40	601211	国泰君安	22,439,408.49	2.03
41	002589	瑞康医药	22,420,252.39	2.03

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。

#### 8.4.2 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	000858	五粮液	89,305,328.68	8.08
2	002032	苏泊尔	67,557,406.60	6.11
3	601888	中国国旅	66,298,426.19	6.00
4	002050	三花智控	65,651,814.29	5.94
5	002466	天齐锂业	65,166,122.09	5.90
6	600885	宏发股份	63,885,816.21	5.78
7	002146	荣盛发展	63,379,954.09	5.74
8	002236	大华股份	60,568,940.00	5.48
9	300122	智飞生物	59,348,439.73	5.37
10	002640	跨境通	58,201,747.68	5.27
11	601012	隆基股份	54,886,930.14	4.97
12	600438	通威股份	54,349,126.04	4.92
13	002456	欧菲科技	54,059,928.50	4.89
14	000063	中兴通讯	52,505,958.80	4.75
15	000069	华侨城 A	49,843,830.41	4.51
16	603986	兆易创新	49,564,201.13	4.49
17	002294	信立泰	47,157,220.87	4.27
18	002648	卫星石化	45,539,420.57	4.12
19	300033	同花顺	41,956,691.36	3.80
20	600383	金地集团	38,023,903.82	3.44
21	002460	赣锋锂业	37,920,579.90	3.43
22	300308	中际旭创	37,628,306.35	3.41
23	600271	航天信息	36,488,327.13	3.30
24	000960	锡业股份	35,383,071.72	3.20
25	300476	胜宏科技	33,424,300.41	3.03
26	000568	泸州老窖	33,393,662.77	3.02
27	000100	TCL 集团	33,246,339.72	3.01
28	600048	保利地产	32,812,409.55	2.97
29	601899	紫金矿业	31,721,759.33	2.87
30	000001	平安银行	31,597,714.74	2.86
31	002821	凯莱英	31,089,233.86	2.81
32	600547	山东黄金	29,745,401.99	2.69

33	601336	新华保险	28,999,776.83	2.62
34	000910	大亚圣象	28,582,159.31	2.59
35	002241	歌尔股份	26,605,118.38	2.41
36	002081	金螳螂	26,598,391.70	2.41
37	000002	万科A	25,362,726.72	2.30
38	600623	华谊集团	24,407,334.53	2.21
39	002589	瑞康医药	23,618,346.04	2.14
40	600036	招商银行	22,674,957.08	2.05
41	002508	老板电器	22,456,489.52	2.03
42	002714	牧原股份	22,250,436.86	2.01

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。

#### 8.4.3 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	2,876,604,846.83
卖出股票收入(成交)总额	2,948,908,468.66

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 8.6 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

无。

#### 8.7 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

无。

#### 8.8 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

无。

#### 8.9 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

无。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

无。

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

**8.12.3 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	452,854.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,854.26
5	应收申购款	21,011.31
6	其他应收款	2,884,512.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,388,232.94

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**8.12.6 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。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 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 (%)
41,588	22,402.17	32,618,753.74	3.50	899,042,890.45	96.50

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

**9.2 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	1.08	0.0000

**9.3 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 1 月 16 日） 基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	903,276,023.98
本报告期基金总申购份额	127,650,632.23
减：本报告期基金总赎回份额	99,265,012.02
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	931,661,644.19

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 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

一、基金管理人的重大人事变动

无

二、基金托管人的重大人事变动

本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 10 万元。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。

## 11.6 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、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
中信建投	2	1,008,161,834.76	17.36%	918,734.73	17.36%	-
万和证券	1	477,930,688.53	8.23%	435,527.09	8.23%	-
华创证券	1	420,364,249.20	7.24%	383,084.03	7.24%	-
中泰证券	1	412,263,331.10	7.10%	375,685.51	7.10%	-
中金公司	3	386,577,780.77	6.66%	352,293.96	6.66%	-
兴业证券	2	377,183,895.46	6.50%	343,730.19	6.50%	-
国泰君安	2	373,612,118.52	6.43%	340,505.58	6.43%	-
国信证券	1	331,288,774.57	5.70%	301,886.56	5.70%	-
国金证券	2	323,918,415.47	5.58%	295,190.71	5.58%	-
光大证券	2	286,529,186.21	4.93%	261,121.21	4.93%	-
招商证券	2	240,277,224.06	4.14%	218,965.33	4.14%	-
广发证券	2	224,146,533.97	3.86%	204,264.84	3.86%	-
天风证券	2	186,585,297.59	3.21%	170,029.93	3.21%	-
东吴证券	1	165,693,316.49	2.85%	151,006.25	2.85%	-
第一创业	1	156,284,792.25	2.69%	142,433.68	2.69%	-
中信证券	2	119,798,969.13	2.06%	109,164.22	2.06%	-
国盛证券	1	107,822,667.39	1.86%	98,259.73	1.86%	-
西藏东财	1	87,714,826.12	1.51%	79,935.87	1.51%	-
银河证券	4	47,350,424.02	0.82%	43,149.54	0.82%	-
华西证券	1	33,079,162.32	0.57%	30,147.06	0.57%	-
方正证券	1	18,033,187.71	0.31%	16,431.91	0.31%	-

浙商证券	1	13,233,780.98	0.23%	12,060.60	0.23%	-
华泰证券	1	9,370,408.27	0.16%	8,539.50	0.16%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

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。

本基金本报告期内新增交易单元：无。 本基金本报告期内退租交易单元：英大证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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

2019 年 03 月 29 日