

# 大成景阳领先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	大成景阳领先混合
基金主代码	519019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 12 月 11 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	1,617,224,127.03 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产长期增值
投资策略	本基金将通过定量与定性分析相结合的方式，选择代表我国新兴经济体特点、具有核心竞争力的领先上市公司进行投资，分享中国经济高速增长果实，获取超额收益。还将在基金合同允许的范围内，根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平，阶段性不断调整股票资产和其它资产之间的大类资产配置比例。其中，全球主要股市的市盈率比较、我国 GDP 增速、上市公司总体盈利增长速度、股市和债市的预期收益率比较以及利率水平，是确定大类资产配置比例的主要因素。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中债综合指数
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	-70,738,783.76	353,015,151.88	129,039,977.65
本期利润	-435,098,001.90	521,195,972.31	21,609,285.36
加权平均基金份额本期利润	-0.2567	0.2485	0.0145
本期基金份额净值增长率	-30.71%	30.38%	1.47%
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	-0.0489	0.3346	0.3041
期末基金资产净值	993,409,942.55	2,094,210,905.18	1,673,491,077.85
期末基金份额净值	0.614	1.052	0.967

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

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

#### 3.2 基金净值表现

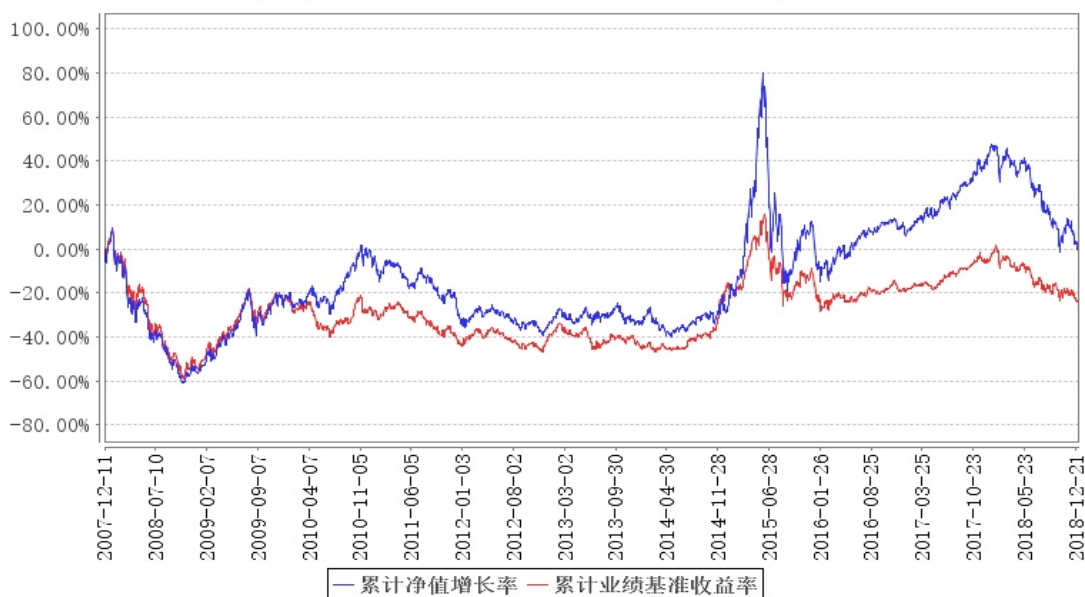
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-10.89%	1.53%	-9.50%	1.31%	-1.39%	0.22%
过去六个月	-22.77%	1.35%	-10.64%	1.20%	-12.13%	0.15%

过去一年	-30.71%	1.25%	-19.26%	1.07%	-11.45%	0.18%
过去三年	-8.33%	1.17%	-13.35%	0.94%	5.02%	0.23%
过去五年	50.29%	1.74%	32.18%	1.23%	18.11%	0.51%
自基金合同生效起至今	0.10%	1.64%	-23.48%	1.39%	23.58%	0.25%

### 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

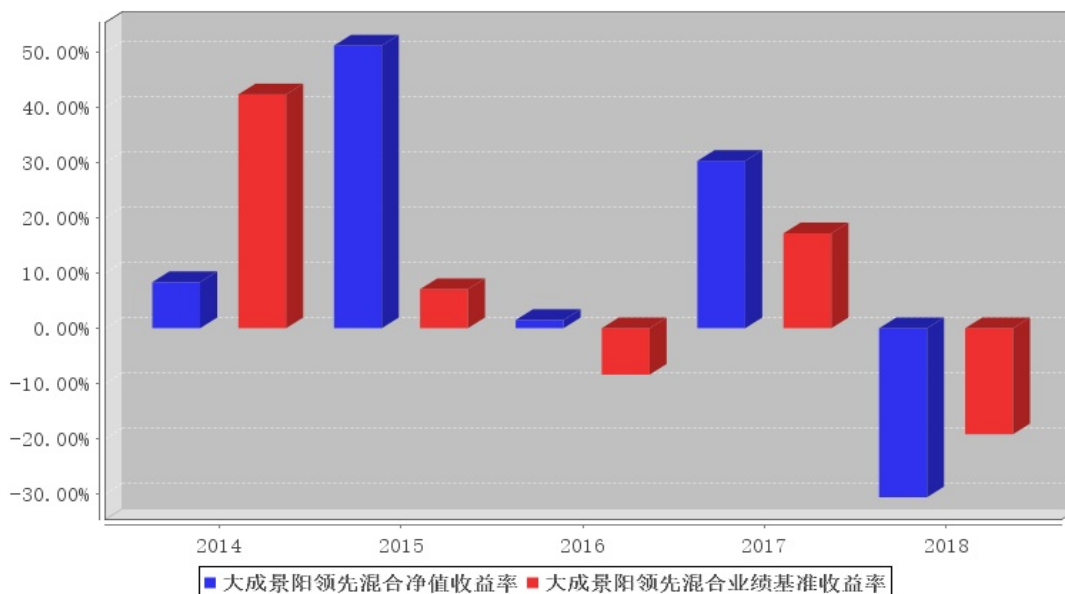
大成景阳领先混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、按基金合同规定,大成景阳领先混合型证券投资基金(原大成景阳领先股票型证券投资基金)应自基金合同生效(暨基金转型)之日2007年12月11日起3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、本基金业绩比较基准自2015年9月14日起由原“沪深300指数×80%+中信标普全债指数×20%”变更为“沪深300指数×80%+中债综合指数×20%”。3、根据中国证监会2014年7月7日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)的有关规定,经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,自2015年7月3日起本基金名称变更为“大成景阳领先混合型证券投资基金”;基金简称变更为“大成景阳领先混合”;基金类别变更为“混合型”。基金代码保持不变,仍为519019。

### 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

大成景阳领先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	1.6730	253,941,234.47	77,981,850.98	331,923,085.45	-
2017 年	1.5400	218,392,857.59	58,284,665.18	276,677,522.77	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	3.2130	472,334,092.06	136,266,516.16	608,600,608.22	-

## § 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		
周志超	本基金基金经理	2018 年 12 月 26 日	-	12	经济学硕士。2006 年 7 月至 2007 年 7 月任诺安基金管理有限公司研究部研究员。2007 年 7 月至 2009 年 10 月任信达澳银基金管理有限公司研究部研究员。2009 年 10 月至 2011 年 5 月任广发基金管理有限公司研究部研究员。2011 年 5 月至 2015 年 11 月任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司权益投资部基金经理。2015 年 11 月至 2018 年 8 月任博时基金管理有限公司股票投资部基金经理。2018 年 8 月加入大成基金管理有限公司。2018 年 12 月 26 日起任大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
徐彦	本基金基金经理	2012 年 10 月 31 日	2018 年 9 月 11 日	12	管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部。2007 年加入大成基金研究部，曾

					<p>担任研究部任中游制造行业研究主管、景宏证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。</p> <p>2012 年 10 月 31 日至 2015 年 7 月 21 日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日至 2018 年 9 月 11 日任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2014 年 4 月 25 日至 2015 年 7 月 21 日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日至 2018 年 9 月 11 日任大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 3 日至 2018 年 9 月 11 日任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 9 月 15 日至 2018 年 9 月 11 日任大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
李本刚	本基金基金经理，股票投资部总监	2018 年 9 月 7 日	-	17	<p>管理学硕士。2001 年至 2010 年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。</p>



					<p>2010 年 8 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部高级研究员、行业研究主管，现任股票投资部总监。</p> <p>2012 年 9 月 4 日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成内需增长股票型证券投资基金）。</p> <p>2014 年 4 月 16 日至 2015 年 10 月 21 日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成消费主题股票型证券投资基金）。2014 年 5 月 14 日至 2015 年 5 月 25 日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理，</p> <p>2015 年 9 月 18 日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 9 月 13 日至 2018 年 9 月 26 日任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>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。2017 年 12 月 20 日起担任大成盛世精选灵活配置混合证券投资基金基金经理。2018 年 9 月 7 日起担任大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型</p>
--	--	--	--	--	---

					证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

					<p>(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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。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 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</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

纵观 2018 年的宏观经济，地产方面，过去几年受棚改货币化的强力推动实现了一轮非常强劲的增长周期，居民部门的杠杆率也迅速提升。为抑制房价的大幅上涨，2018 年对于地产的政策调控力度空前，这导致了今年房地产行业高开低走。基建方面，较高的基数效应，以及地方政府的财政硬约束导致了基建投资增长缓慢。制造业方面，东南亚制造业的兴起，以及中美贸易战的爆发，对于出口部门的负面影响在逐渐显现。金融市场方面，中央政府的强力去杠杆政策叠加股市的下跌，导致很多上市公司大股东出现股票质押危机。总的来说，2018 年我国经济处于短周期的下行阶段。2018 年是宏观经济逐渐下行，风险偏好逐渐上升的一年，尽管全年上市公司盈利整体还略有增长，但是估值大幅下降，导致 A 股整体表现很差。全年上证综指、深成指和创业板指数分别下跌 24.59%、34.42%、28.65%，无论蓝筹还是成长表现都不好。但是，由于部分行业的盈利还处于惯性增长阶段，而部分行业已经出现明显的拐点，所以股价分化也比较大。行业方面，全年表现较好（跌幅较小）的行业有餐饮旅游、银行、食品饮料、石油石化等，表现较差的行业有综合、电子、有色金属、传媒等。年初银行地产联袂上涨，但是持续时间很短，之后大幅回调。而石油石化、医药两个板块在 18 年走出了非常明显的倒 V 型，上半年受益于油价持续上涨，石油石化（包括油服）板块表现良好，年底油价暴跌股价回调。医药板块上半年业绩增速靓丽，股价同样表现很好，但是带量采购政策的推出令真个行业出现崩塌式下跌。总的来说，2018 年，本基金变更了基金经理，为应对复杂变化的内外部经济环境持仓结构有所调整，持仓股票主要分布在制造业。

#### 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 0.614 元；本报告期基金份额净值增长率为-30.71%，业绩比较基准收益率为-19.26%。

#### 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 2019 年，我国的宏观经济预计还会继续处于探底阶段。宏观经济的低迷对于 A 股的影响是全局性的，大多数行业的盈利预测都要下调，很多公司的业绩还会出现负增长。我们对于 2019 年的股票市场，虽然不乐观，但是也不会太悲观。我们还会继续秉承价值投资的理念，主要关注以下三种投资机会：第一，深度挖掘未来几年业绩增速确定的好公司；第二，寻找一些政策导向型的机会，比如房地产政策的放松，我们认为将是大概率事件，地产股的估值有望得到向上的修复；第三，高股息企业的投资机会，过去经济快速增长时期企业的资金留存较少，大都用于扩产，而随着行业天花板的临近，很多公司的资本支出将会大幅减少，分红能力将会大幅提升。

#### 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。本报告期内本基金已分配利润 331,923,085.45 元（每十份基金份额分红 1.673 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 年年度财务报表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:大成景阳领先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	109,492,650.73	148,845,432.51
结算备付金	5,670,014.84	1,164,037.48
存出保证金	788,573.04	420,136.21
交易性金融资产	870,070,688.35	1,806,847,198.01
其中:股票投资	870,070,688.35	1,803,708,310.41
基金投资	-	-
债券投资	-	3,138,887.60
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	-	150,047,925.07
应收证券清算款	11,763,751.33	-
应收利息	25,869.49	102,972.98
应收股利	-	-
应收申购款	41,644.15	164,610.16
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	997,853,191.93	2,107,592,312.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	148,938.22	7,275,399.36
应付赎回款	255,504.88	2,045,498.88
应付管理人报酬	1,336,542.96	2,498,697.85
应付托管费	222,757.16	416,449.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,153,791.41	819,148.53
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	325,714.75	326,213.01
负债合计	4,443,249.38	13,381,407.24
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,072,557,064.67	1,320,661,741.40
未分配利润	-79,147,122.12	773,549,163.78
所有者权益合计	993,409,942.55	2,094,210,905.18
负债和所有者权益总计	997,853,191.93	2,107,592,312.42

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.614 元，基金份额总额 1,617,224,127.03 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成景阳领先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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-401,361,322.12	560,970,125.37
1. 利息收入	1,731,918.36	3,758,114.56
其中：存款利息收入	1,532,764.65	2,138,112.38
债券利息收入	9,528.43	12,649.29
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	189,625.28	1,607,352.89
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-39,223,124.23	388,121,974.01
其中：股票投资收益	-58,694,307.76	362,073,221.55
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-55,293.73	882,812.96
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	19,526,477.26	25,165,939.50
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	-364,359,218.14	168,180,820.43
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	489,101.89	909,216.37
减：二、费用	33,736,679.78	39,774,153.06
1. 管理人报酬	20,188,544.20	28,331,970.56
2. 托管费	3,364,757.36	4,721,995.11
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,706,227.51	6,228,310.42
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产 支出	-	-
6. 税金及附加	34.30	-
7. 其他费用	477,116.41	491,876.97
三、利润总额(亏损总额以“- ”号填列)	-435,098,001.90	521,195,972.31
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)	-435,098,001.90	521,195,972.31

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景阳领先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）	1,320,661,741.40	773,549,163.78	2,094,210,905.18
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	-435,098,001.90	-435,098,001.90
三、本期基金份	-248,104,676.73	-85,675,198.55	-333,779,875.28

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	232,350,237.70	53,564,573.25	285,914,810.95
2. 基金赎回款	-480,454,914.43	-139,239,771.80	-619,694,686.23
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)	-	-331,923,085.45	-331,923,085.45
五、期末所有者权益(基金净值)	1,072,557,064.67	-79,147,122.12	993,409,942.55
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)	1,147,394,921.44	526,096,156.41	1,673,491,077.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	521,195,972.31	521,195,972.31
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)	173,266,819.96	2,934,557.83	176,201,377.79
其中: 1. 基金申购款	854,107,815.76	266,063,843.68	1,120,171,659.44
2. 基金赎回款	-680,840,995.80	-263,129,285.85	-943,970,281.65
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)	-	-276,677,522.77	-276,677,522.77
五、期末所有者权益(基金净值)	1,320,661,741.40	773,549,163.78	2,094,210,905.18

--	--	--	--

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>刘亚林</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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和其他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	701,680,470.52	11.15	286,424,755.73	7.05

## 7.4.4.1.2 债券交易

无。

## 7.4.4.1.3 债券回购交易

无。

## 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	639,434.53	11.15	258,043.59	11.98
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	261,011.99	7.05	132,578.27	16.20

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	20,188,544.20	28,331,970.56
其中：支付销售机构的客户维护费	3,461,213.12	4,060,026.53

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

##### 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	3,364,757.36	4,721,995.11

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：

$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

##### 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	109,492,650.73	1,484,641.83	148,845,432.51	2,036,831.50

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
002352	顺丰控股	2017-08-22	2019-08-23	增 发 流 通 受 限	35.19	31.06	426,258	15,000,019.02	13,239,573.48	-
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	新 股 流 通 受 限	13.77	10.97	1,054,601	14,521,855.77	11,568,972.97	-
601860	紫	2018-12-20	2019-01-03	新	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-



	金 银 行			股 流 通 受 限						
--	-------------	--	--	-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：

- 基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。
- 基金还可作为特定投资者，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	870,070,688.35	87.19
	其中：股票	870,070,688.35	87.19
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	115,162,665.57	11.54
8	其他各项资产	12,619,838.01	1.26
9	合计	997,853,191.93	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	97,586,864.39	9.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	515,359,186.88	51.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,979,888.40	8.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	22,468,254.20	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	13,362,123.98	1.35
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	50,145.80	0.01
K	房地产业	117,776,769.45	11.86
L	租赁和商务服务业	-	-
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	23,487,455.25	2.36
S	综合	-	-
	合计	870,070,688.35	87.58

### 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	000902	新洋丰	9,400,000	84,224,000.00	8.48
2	000671	阳光城	15,800,000	82,002,000.00	8.25
3	300199	翰宇药业	8,700,000	81,258,000.00	8.18
4	600856	中天能源	21,499,970	79,979,888.40	8.05
5	603707	健友股份	4,200,000	78,834,000.00	7.94
6	002382	蓝帆医疗	5,200,000	77,272,000.00	7.78
7	002332	仙琚制药	8,000,000	49,040,000.00	4.94
8	300476	胜宏科技	4,000,000	46,800,000.00	4.71
9	600873	梅花生物	11,000,000	46,420,000.00	4.67
10	002675	东诚药业	5,000,000	39,350,000.00	3.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

## 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	000671	阳光城	98,542,447.94	4.71
2	603707	健友股份	98,412,932.25	4.70
3	600856	中天能源	97,660,634.10	4.66
4	300199	翰宇药业	96,009,021.15	4.58
5	002146	荣盛发展	95,208,182.95	4.55
6	002382	蓝帆医疗	93,946,426.38	4.49
7	601398	工商银行	93,733,263.34	4.48
8	600028	中国石化	88,945,378.93	4.25
9	000902	新洋丰	88,624,802.81	4.23
10	601139	深圳燃气	84,983,321.47	4.06
11	001979	招商蛇口	83,504,936.98	3.99
12	600048	保利地产	82,952,742.53	3.96
13	600352	浙江龙盛	71,596,685.42	3.42
14	002588	史丹利	58,998,744.03	2.82
15	300476	胜宏科技	55,791,783.66	2.66
16	002332	仙琚制药	54,263,701.28	2.59
17	601186	中国铁建	48,799,230.00	2.33
18	600987	航民股份	48,682,188.53	2.32
19	000002	万科A	48,499,409.45	2.32
20	603393	新天然气	47,659,088.16	2.28
21	600873	梅花生物	46,034,105.07	2.20

22	002142	宁波银行	44,903,946.06	2.14
23	002675	东诚药业	44,777,111.25	2.14
24	002458	益生股份	44,079,086.00	2.10
25	601128	常熟银行	43,351,314.40	2.07
26	603708	家家悦	43,326,905.30	2.07
27	601800	中国交建	42,551,240.04	2.03
28	002304	洋河股份	42,180,198.74	2.01
29	002016	世荣兆业	42,165,651.14	2.01

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	600340	华夏幸福	193,905,472.12	9.26
2	002202	金风科技	165,047,844.31	7.88
3	002294	信立泰	151,863,607.96	7.25
4	300144	宋城演艺	136,563,264.68	6.52
5	601398	工商银行	96,292,482.09	4.60
6	600028	中国石化	93,731,724.05	4.48
7	600048	保利地产	88,166,703.41	4.21
8	603556	海兴电力	84,591,695.42	4.04
9	001979	招商蛇口	83,540,964.45	3.99
10	600143	金发科技	80,940,735.86	3.86
11	601139	深圳燃气	73,842,944.01	3.53
12	002518	科士达	73,446,142.79	3.51
13	002244	滨江集团	68,566,008.52	3.27
14	600352	浙江龙盛	66,111,048.79	3.16
15	002146	荣盛发展	65,733,704.78	3.14
16	002050	三花智控	63,263,068.57	3.02
17	300607	拓斯达	61,392,470.56	2.93
18	601336	新华保险	61,254,341.15	2.92
19	601899	紫金矿业	55,205,870.59	2.64
20	002001	新和成	53,902,025.10	2.57
21	000002	万科A	52,467,522.21	2.51
22	002042	华孚时尚	50,440,263.58	2.41
23	002304	洋河股份	49,740,742.87	2.38
24	601186	中国铁建	49,020,737.00	2.34
25	002142	宁波银行	47,695,230.47	2.28
26	603393	新天然气	46,876,170.23	2.24
27	601128	常熟银行	46,327,363.87	2.21

28	601800	中国交建	41,902,384.46	2.00
----	--------	------	---------------	------

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	2,903,303,653.44
卖出股票收入（成交）总额	3,413,733,637.20

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。

#### 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	788,573.04
2	应收证券清算款	11,763,751.33
3	应收股利	-
4	应收利息	25,869.49
5	应收申购款	41,644.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,619,838.01

### 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 (%)
48,666	33,231.09	437,406,261.50	27.05	1,179,817,865.53	72.95

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	121,501.74	0.0075

**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12月11日） 基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,991,408,202.42
本报告期基金总申购份额	350,363,114.34
减：本报告期基金总赎回份额	724,547,189.73
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	1,617,224,127.03

**§ 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、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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 125,000.00 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	
海通证券	1	797,063,776.61	12.67%	726,353.71	12.67%	-
天风证券	2	765,811,554.15	12.17%	697,862.77	12.17%	-
光大证券	2	701,680,470.52	11.15%	639,434.53	11.15%	-
招商证券	2	625,267,378.94	9.94%	569,840.47	9.94%	-
国泰君安	2	585,007,290.15	9.30%	533,136.18	9.30%	-
中金公司	3	561,567,874.61	8.92%	511,818.60	8.93%	-
银河证券	4	478,782,444.42	7.61%	436,296.88	7.61%	-
申万宏源	1	429,597,159.70	6.83%	391,491.03	6.83%	-
兴业证券	2	248,999,517.21	3.96%	226,926.47	3.96%	-
第一创业	1	227,846,280.46	3.62%	207,658.51	3.62%	-
东吴证券	1	164,817,750.65	2.62%	150,176.44	2.62%	-
民生证券	1	138,718,576.70	2.20%	126,418.45	2.20%	-
中信建投	2	130,101,956.15	2.07%	118,554.16	2.07%	-
广发证券	2	107,084,510.60	1.70%	97,580.30	1.70%	-
中泰证券	1	96,769,187.68	1.54%	88,171.57	1.54%	-
国盛证券	1	81,911,241.46	1.30%	74,649.56	1.30%	-
国金证券	2	59,645,434.25	0.95%	54,356.64	0.95%	-



联讯证券	1	47,371,463.95	0.75%	43,178.50	0.75%	-
国信证券	1	38,042,880.95	0.60%	34,661.22	0.60%	-
华泰证券	1	6,000,882.35	0.10%	5,468.11	0.10%	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	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:

- (1) 财务状况良好,最近一年无重大违规行为;
- (2) 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;
- (3) 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;
- (4) 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;
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;
- (6) 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专用席位。本报告期内本基金退租的交易单元:英大证券,新增交易单元:无。

### 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

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
兴业证券	3,243,769.00	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	150,000,000.00	100.00%	-	-

## § 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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

		到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	201801-20180531	616,407,147.26	-	408,471,046.10	207,936,101.16	12.86
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。							

## 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