

# 大成中证红利指数证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39

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.....	40
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.....	40
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12	投资组合报告附注.....	40
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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情况.....	41
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4	基金投资策略的改变.....	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8	其他重大事件.....	43
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	44
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	45
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1	备查文件目录.....	45
12.2	存放地点.....	45
12.3	查阅方式.....	45

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证红利指数证券投资基金
基金简称	大成中证红利指数
基金主代码	090010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 2 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	715,658,790.88 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及其他特殊情况（如成份股流动性不足）对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人可以使用其他适当的方法进行调整，以实现跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证红利指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益水平高于混合基金、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	中国建设银行股份有限公司
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	010-67595096
传真	0755-83199588	010-66275853
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	刘卓	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	24,982,186.42
本期利润	46,968,414.10
加权平均基金份额本期利润	0.1200
本期加权平均净值利润率	6.73%
本期基金份额净值增长率	16.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	464,003,026.81
期末可供分配基金份额利润	0.6484
期末基金资产净值	1,179,661,817.69
期末基金份额净值	1.648
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	80.67%

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

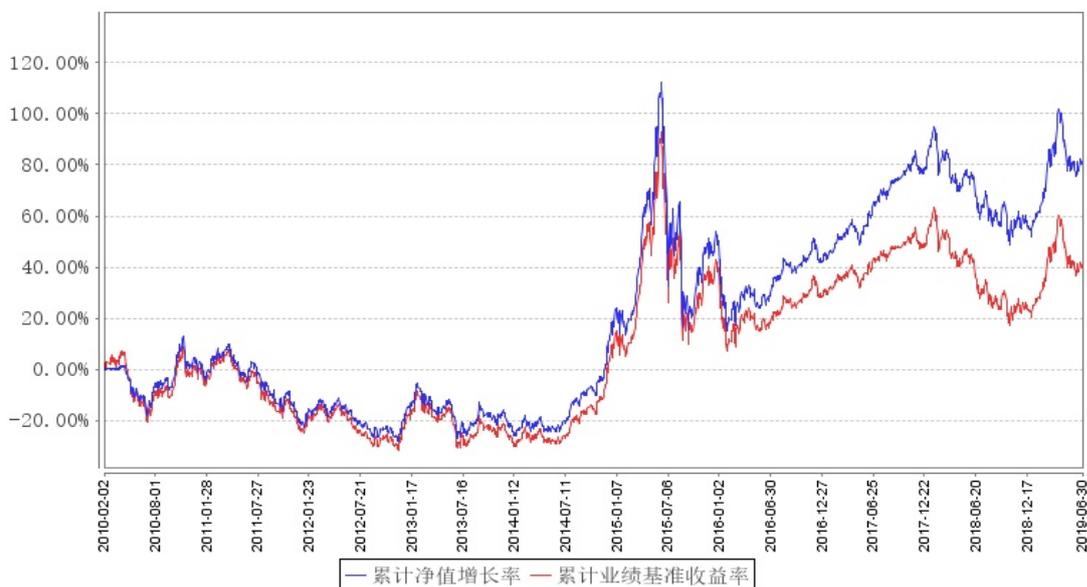
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	-0.24%	0.93%	-1.33%	0.96%	1.09%	-0.03%
过去三个月	-4.51%	1.31%	-6.71%	1.34%	2.20%	-0.03%
过去六个月	16.56%	1.27%	14.14%	1.30%	2.42%	-0.03%
过去一年	9.36%	1.24%	5.11%	1.28%	4.25%	-0.04%
过去三年	39.51%	0.93%	18.24%	0.95%	21.27%	-0.02%
自基金合同生效起至今	80.67%	1.40%	39.94%	1.40%	40.73%	0.00%

### 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

大成中证红利指数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：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。

## § 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。

经过二十年的稳健发展，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 2019 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 68 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		
夏高	本基金基金经理	2014 年 12 月 6 日	-	8 年	工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理，现任数量与指数投资部总监助理。2014 年 12 月 6 日起任大成中证红利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 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日起任大成智慧量化多策略灵活配置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
--	--	--	--	--	--

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；部分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些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。

### 4.3.2 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不存在同日反向交易。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不存在同日反向交易。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

今年上半年，A股市场总体呈现大幅上涨之后回落调整的格局。今年初，随着市场估值接近历史底部、政策宽松预期形成、中美贸易摩擦改善以及外资流入等利好因素的刺激下，A股开始走出一轮上涨行情。细分来看，年初至四月中旬的股市上涨行情可以分为三个主要阶段。第一阶段是年初至春节前，市场上涨的主要推动因素是外资流入，涨幅居前的板块是低估值、高盈利的消费股等。第二阶段是春节后至二月底，涨幅居前的是证券和TMT等高弹性板块。第三阶段是三月份至四月中旬，涨幅居前的是农林牧渔、食品饮料和TMT等板块。四月下旬至六月上旬，受到宏观政策边际调整、经济回落以及中美贸易冲突加剧的影响，股市经历了一轮幅度不小的调整，投资者情绪趋于谨慎。六月中下旬，市场阶段性调整接近尾声，投资者情绪逐步恢复，在大盘蓝筹股的带动下，股市开始震荡攀升。今年上半年，上证指数上涨19.45%，沪深300指数上涨27.07%，中证红利指数上涨14.86%。

在本报告期内，本基金严格按照中证红利指数的成分及其权重构建投资组合，较好地跟踪了基准指数，日均跟踪偏离度和年化跟踪误差均符合基金合同的要求。在符合法律法规和基金合同的前提下，本基金参与了传统A股新股申购和科创板新股申购，增强了基金收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.648元；本报告期基金份额净值增长率为16.56%，业绩比较基准收益率为14.14%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，我国GDP同比增长6.3%，增速继续回落；上半年全国规模以上工业企业利润总额同比下降2.4%，企业经营面临压力；社会消费品零售总额同比增长8.4%，增速比上年同期回落1.0个百分点；全国固定资产投资（不含农户）同比增长5.8%，增速比上年同期回落0.2个百分点。面对稳定经济增长的压力，我们预计国家将持续完善宏观经济调控，加快经济转型升级，加大民生投入和基础设施投资力度，进一步推进减税降费，降低实体经济融资成本，促进消费升级，让经济增长保持在合理区间。A股市场经历了二季度的充分调整，随着宏观经济的优化、流动性的合理充裕、中美贸易关系的缓和以及科创板成功推出的政策支持，我们对下半年的市场保持谨慎乐观的态度。

本基金将坚持被动型、全复制的指数化投资理念，严格按照基准指数的成分及其权重构建投资组合，继续深入研究更加高效的交易策略和风险控制方法，积极应对大额频繁申购赎回及其他突发事件的影响，以期更好地跟踪基准指数，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专

业化服务。

#### 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 103,013,051.40 元（每十份基金份额分红 1.5600 元），符合基金同规定的分红比例。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 103,013,051.40 元，符合基金合同的规定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：大成中证红利指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	39,240,821.25	18,057,726.28
结算备付金		2,258,524.45	171,383.79
存出保证金		237,378.03	23,095.98
交易性金融资产	6.4.3.2	1,135,129,400.73	261,880,246.18
其中：股票投资		1,105,141,400.73	261,880,246.18
基金投资		-	-
债券投资		29,988,000.00	-
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		-	40,104.49
应收利息	6.4.3.5	373,584.61	3,709.99
应收股利		-	-
应收申购款		5,935,707.82	2,242,874.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,183,175,416.89	282,419,141.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,816,709.48	220,948.92
应付管理人报酬		692,657.72	165,574.66
应付托管费		138,531.55	33,114.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	770,504.82	219,428.78
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	95,195.63	250,527.35
负债合计		3,513,599.20	889,594.65
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	715,658,790.88	181,624,826.65
未分配利润	6.4.3.10	464,003,026.81	99,904,720.03
所有者权益合计		1,179,661,817.69	281,529,546.68
负债和所有者权益总计		1,183,175,416.89	282,419,141.33

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.648 元，基金份额总额 715,658,790.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成中证红利指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
一、收入		51,370,957.71	-16,940,208.69

1. 利息收入		301,670.20	55,350.43
其中：存款利息收入	6.4.3.11	128,393.49	55,290.47
债券利息收入		173,276.71	59.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,754,566.00	8,977,231.21
其中：股票投资收益	6.4.3.12	4,136,693.03	5,868,010.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-10,086.36
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	24,617,872.97	3,119,306.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	21,986,227.68	-26,054,186.65
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	328,493.83	81,396.32
减：二、费用		4,402,543.61	1,232,666.92
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	2,573,941.44	763,216.32
2. 托管费	6.4.6.2.2	514,788.28	152,643.26
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	1,214,686.79	140,693.50
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	99,127.10	176,113.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,968,414.10	-18,172,875.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,968,414.10	-18,172,875.61

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证红利指数证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	181,624,826.65	99,904,720.03	281,529,546.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,968,414.10	46,968,414.10
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）	534,033,964.23	420,142,944.08	954,176,908.31
其中：1. 基金申购款	661,944,291.31	526,539,909.31	1,188,484,200.62
2. 基金赎回款	-127,910,327.08	-106,396,965.23	-234,307,292.31
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）	-	-103,013,051.40	-103,013,051.40
五、期末所有者权益（基金净值）	715,658,790.88	464,003,026.81	1,179,661,817.69
项目	上年度可比期间 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）	107,409,158.87	85,720,950.86	193,130,109.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,172,875.61	-18,172,875.61
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）	15,960,893.14	12,836,727.77	28,797,620.91

其中：1. 基金申购款	59,313,438.34	47,493,070.08	106,806,508.42
2. 基金赎回款	-43,352,545.20	-34,656,342.31	-78,008,887.51
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）	123,370,052.01	80,384,803.02	203,754,855.03

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：

谭晓冈

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

## 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

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。

(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。

### 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	39,240,821.25
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	39,240,821.25

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票	1,105,583,455.44	1,105,141,400.73	-442,054.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	29,991,990.00	29,988,000.00
	合计	29,991,990.00	29,988,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,135,575,445.44	1,135,129,400.73	-446,044.71

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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

无。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	9,318.94
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	914.76
应收债券利息	363,254.79
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	96.12
合计	373,584.61

#### 6.4.3.6 其他资产

无。

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	770,279.82
银行间市场应付交易费用	225.00
合计	770,504.82

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,338.62
预提费用	88,857.01
合计	95,195.63

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	181,624,826.65	181,624,826.65
本期申购	661,944,291.31	661,944,291.31
本期赎回（以“-”号填列）	-127,910,327.08	-127,910,327.08
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	715,658,790.88	715,658,790.88

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

## 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	191,460,453.79	-91,555,733.76	99,904,720.03
本期利润	24,982,186.42	21,986,227.68	46,968,414.10
本期基金份额交易产生的变动数	563,570,965.76	-143,428,021.68	420,142,944.08
其中：基金申购款	698,080,929.34	-171,541,020.03	526,539,909.31
基金赎回款	-134,509,963.58	28,112,998.35	-106,396,965.23
本期已分配利润	-103,013,051.40	-	-103,013,051.40
本期末	677,000,554.57	-212,997,527.76	464,003,026.81

## 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	116,280.06
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	11,209.62
其他	903.81
合计	128,393.49

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	133,130,254.00
减：卖出股票成本总额	128,993,560.97
买卖股票差价收入	4,136,693.03

#### 6.4.3.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	24,617,872.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	24,617,872.97

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	21,986,227.68
股票投资	21,990,217.68
债券投资	-3,990.00
资产支持证券投资	-

基金投资	-
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	21,986,227.68

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	316,120.36
基金转换费收入	12,373.47
合计	328,493.83

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. 基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分不低于 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
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	1,214,461.79
银行间市场交易费用	225.00
合计	1,214,686.79

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,104.23
银行费用	9,910.09
其他	360.00
合计	99,127.10

#### 6.4.3.21 分部报告

无。

#### 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

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

根据我司《关于大成中证红利指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自 2019 年 8 月 2 日起，对大成中证红利指数证券投资基金（以下简称“本基金”）增设收取销售服务费的 C 类基金份额类别并对本基金的基金合同、托管协议作出相应修改。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	431,219,149.25	39.88	36,377,781.06	35.75

###### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
光大证券	-	-	122,773.60	100.00

#### 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.6.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	392,981.61	39.88	310,150.80	40.26
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	33,151.84	35.75	16,136.92	35.65

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。

#### 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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,573,941.44	763,216.32

其中：支付销售机构的客户维护费	822,426.29	195,572.38
-----------------	------------	------------

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 0.75% 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 × 0.75% / 当年天数。

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	514,788.28	152,643.26

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 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

无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

无。

##### 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

无。

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
中国建设银行	39,240,821.25	116,280.06	16,173,565.69	53,729.76

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。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

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	2019年06月19日	2019年6月19日	1.5600	59,763,342.07	43,249,709.33	103,013,051.40	-
合计	-	-	1.5600	59,763,342.07	43,249,709.33	103,013,051.40	-

#### 6.4.8 期末(2019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

金额单位:人民币元

6.4.8.1.1 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
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年07月05日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年07月05日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 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

无。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金采用完全复制法跟踪标的指数，力争本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

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。

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

#### 6.4.9.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(上年度末：无)。

#### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,988,000.00	-
合计	29,988,000.00	-

注：上述未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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而带来的变现困难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。

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”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。

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

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

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	39,240,821.25	-	-	-	39,240,821.25
结算备付金	2,258,524.45	-	-	-	2,258,524.45
存出保证金	237,378.03	-	-	-	237,378.03
交易性金融资产	29,988,000.00	-	-	-1,105,141,400.73	1,135,129,400.73
应收利息	-	-	-	373,584.61	373,584.61
应收申购款	21,490.13	-	-	5,914,217.69	5,935,707.82
资产总计	71,746,213.86	-	-	-1,111,429,203.03	1,183,175,416.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,816,709.48	1,816,709.48
应付管理人报酬	-	-	-	692,657.72	692,657.72
应付托管费	-	-	-	138,531.55	138,531.55
应付交易费用	-	-	-	770,504.82	770,504.82
其他负债	-	-	-	95,195.63	95,195.63
负债总计	-	-	-	3,513,599.20	3,513,599.20
利率敏感度缺口	71,746,213.86	-	-	-1,107,915,603.83	1,179,661,817.69
上年度末 2018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	18,057,726.28	-	-	-	18,057,726.28
结算备付金	171,383.79	-	-	-	171,383.79
存出保证金	23,095.98	-	-	-	23,095.98
交易性金融资产	-	-	-	261,880,246.18	261,880,246.18
应收利息	-	-	-	3,709.99	3,709.99
应收申购款	15,764.96	-	-	2,227,109.66	2,242,874.62
应收证券清算款	-	-	-	40,104.49	40,104.49

资产总计	18,267,971.01	-	-	264,151,170.32	282,419,141.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	220,948.92	220,948.92
应付管理人报酬	-	-	-	165,574.66	165,574.66
应付托管费	-	-	-	33,114.94	33,114.94
应付交易费用	-	-	-	219,428.78	219,428.78
其他负债	-	-	-	250,527.35	250,527.35
负债总计	-	-	-	889,594.65	889,594.65
利率敏感度缺口	18,267,971.01	-	-	263,261,575.67	281,529,546.68

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变动量的变动	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(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	利率上升25个基点	-38,901.00	-
利率下降25个基点	39,004.00	-	

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价,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,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金以降低基金的跟踪误差为目的,在考虑流动性风险的前提下,构建债券投资组合。确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	1,105,141,400.73	93.68	261,880,246.18	93.02
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,105,141,400.73	93.68	261,880,246.18	93.02

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	57,460,000.00	13,600,000.00
	业绩比较基准下降5%	-57,460,000.00	-13,600,000.00

#### 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	1,105,141,400.73	93.40
	其中：股票	1,105,141,400.73	93.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,988,000.00	2.53
	其中：债券	29,988,000.00	2.53
	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	41,499,345.70	3.51
8	其他各项资产	6,546,670.46	0.55
9	合计	1,183,175,416.89	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	57,109,858.56	4.84
C	制造业	540,499,467.29	45.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,598,912.68	6.32
E	建筑业	14,842,611.60	1.26
F	批发和零售业	22,752,763.34	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	111,354,700.41	9.44
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	127,997,744.72	10.85
K	房地产业	155,375,394.75	13.17
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,104,531,453.35	93.63

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	363,431.25	0.03
C	制造业	149,935.83	0.01
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	-	-
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	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	-	-
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	609,947.38	0.05

## 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

## 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	2,057,591	41,933,704.58	3.55
2	000550	江铃汽车	2,096,400	40,649,196.00	3.45
3	600664	哈药股份	5,876,400	24,328,296.00	2.06
4	000876	新希望	1,337,710	23,236,022.70	1.97
5	002601	龙蟒佰利	1,333,629	19,777,718.07	1.68
6	000157	中联重科	2,959,044	17,783,854.44	1.51
7	000338	潍柴动力	1,336,900	16,430,501.00	1.39
8	002367	康力电梯	2,216,200	16,355,556.00	1.39
9	600507	方大特钢	1,606,987	15,716,332.86	1.33
10	600376	首开股份	1,756,229	15,683,124.97	1.33
11	600873	梅花生物	3,242,600	15,532,054.00	1.32
12	600383	金地集团	1,291,317	15,405,411.81	1.31
13	600028	中国石化	2,774,434	15,176,153.98	1.29
14	603328	依顿电子	1,474,796	15,146,154.92	1.28
15	600325	华发股份	1,864,945	14,565,220.45	1.23
16	601566	九牧王	1,166,081	14,366,117.92	1.22
17	600104	上汽集团	558,135	14,232,442.50	1.21
18	601166	兴业银行	765,478	14,000,592.62	1.19
19	000036	华联控股	2,688,530	13,738,388.30	1.16
20	002478	常宝股份	2,233,500	13,512,675.00	1.15
21	600900	长江电力	751,369	13,449,505.10	1.14
22	600741	华域汽车	621,716	13,429,065.60	1.14
23	601328	交通银行	2,141,735	13,107,418.20	1.11
24	601288	农业银行	3,629,729	13,067,024.40	1.11
25	601398	工商银行	2,213,127	13,035,318.03	1.11
26	601988	中国银行	3,457,434	12,930,803.16	1.10
27	000895	双汇发展	493,700	12,288,193.00	1.04
28	600377	宁沪高速	1,122,600	12,056,724.00	1.02
29	000429	粤高速 A	1,594,138	12,035,741.90	1.02
30	002083	孚日股份	2,103,501	11,884,780.65	1.01
31	000631	顺发恒业	3,938,500	11,815,500.00	1.00
32	600897	厦门空港	489,538	11,802,761.18	1.00
33	002146	荣盛发展	1,232,600	11,574,114.00	0.98

34	600162	香江控股	4,716,700	11,508,748.00	0.98
35	600398	海澜之家	1,252,200	11,357,454.00	0.96
36	600036	招商银行	312,375	11,239,252.50	0.95
37	601998	中信银行	1,872,300	11,177,631.00	0.95
38	601009	南京银行	1,350,322	11,153,659.72	0.95
39	601636	旗滨集团	2,863,300	11,138,237.00	0.94
40	600177	雅戈尔	1,746,282	11,088,890.70	0.94
41	000848	承德露露	1,306,600	10,883,978.00	0.92
42	000625	长安汽车	1,637,200	10,854,636.00	0.92
43	002110	三钢闽光	1,165,200	10,836,360.00	0.92
44	600688	上海石化	2,050,200	10,579,032.00	0.90
45	600183	生益科技	696,687	10,485,139.35	0.89
46	002001	新和成	538,268	10,383,189.72	0.88
47	000726	鲁泰A	1,081,891	10,342,877.96	0.88
48	600642	申能股份	1,701,344	10,225,077.44	0.87
49	002016	世荣兆业	1,246,200	10,218,840.00	0.87
50	601158	重庆水务	1,810,768	10,140,300.80	0.86
51	603766	隆鑫通用	2,396,400	10,040,916.00	0.85
52	600704	物产中大	1,848,849	10,020,761.58	0.85
53	601006	大秦铁路	1,235,137	9,992,258.33	0.85
54	001872	招商港口	609,310	9,937,846.10	0.84
55	000541	佛山照明	1,856,636	9,728,772.64	0.82
56	600660	福耀玻璃	425,093	9,662,363.89	0.82
57	002372	伟星新材	551,218	9,591,193.20	0.81
58	600033	福建高速	2,923,508	9,559,871.16	0.81
59	603001	奥康国际	939,154	9,523,021.56	0.81
60	000568	泸州老窖	117,676	9,511,751.08	0.81
61	002713	东易日盛	936,680	9,432,367.60	0.80
62	600585	海螺水泥	224,500	9,316,750.00	0.79
63	600019	宝钢股份	1,430,239	9,296,553.50	0.79
64	600887	伊利股份	277,000	9,254,570.00	0.78
65	000402	金融街	1,178,928	9,242,795.52	0.78
66	600066	宇通客车	708,411	9,223,511.22	0.78
67	000488	晨鸣纸业	1,685,429	9,033,899.44	0.77
68	002142	宁波银行	372,631	9,032,575.44	0.77
69	600020	中原高速	1,704,200	8,947,050.00	0.76
70	000002	万科A	307,400	8,548,794.00	0.72
71	600269	赣粤高速	1,894,000	8,409,360.00	0.71
72	600350	山东高速	1,730,900	8,308,320.00	0.70
73	600023	浙能电力	1,873,200	8,279,544.00	0.70
74	000656	金科股份	1,368,500	8,252,055.00	0.70
75	000333	美的集团	159,000	8,245,740.00	0.70

76	002206	海利得	1,931,712	7,977,970.56	0.68
77	600674	川投能源	887,900	7,902,310.00	0.67
78	002543	万和电气	573,230	7,692,746.60	0.65
79	600018	上港集团	1,106,872	7,548,867.04	0.64
80	600048	保利地产	583,500	7,445,460.00	0.63
81	600016	民生银行	1,160,158	7,367,003.30	0.62
82	000828	东莞控股	781,800	7,169,106.00	0.61
83	000600	建投能源	1,062,976	7,121,939.20	0.60
84	600795	国电电力	2,793,599	7,095,741.46	0.60
85	002304	洋河股份	54,500	6,625,020.00	0.56
86	002419	天虹股份	496,700	6,486,902.00	0.55
87	600312	平高电气	843,200	6,484,208.00	0.55
88	600743	华远地产	2,505,200	6,288,052.00	0.53
89	601601	中国太保	171,985	6,279,172.35	0.53
90	600153	建发股份	703,277	6,245,099.76	0.53
91	601877	正泰电器	270,196	6,238,825.64	0.53
92	600563	法拉电子	144,511	5,949,517.87	0.50
93	000776	广发证券	408,100	5,607,294.00	0.48
94	600012	皖通高速	882,590	5,586,794.70	0.47
95	600835	上海机电	335,679	5,572,271.40	0.47
96	600011	华能国际	873,016	5,438,889.68	0.46
97	601668	中国建筑	940,912	5,410,244.00	0.46
98	600886	国投电力	636,500	4,945,605.00	0.42

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.03
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
7	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	000550	江铃汽车	40,458,966.55	14.37
2	601088	中国神华	34,428,022.67	12.23

3	600664	哈药股份	22,754,505.65	8.08
4	002601	龙鳞佰利	17,198,061.71	6.11
5	000876	新希望	16,881,403.60	6.00
6	600507	方大特钢	16,081,801.46	5.71
7	002367	康力电梯	14,566,545.05	5.17
8	600873	梅花生物	13,483,135.13	4.79
9	601566	九牧王	13,240,855.18	4.70
10	603328	依顿电子	13,081,059.75	4.65
11	000338	潍柴动力	13,009,472.00	4.62
12	600383	金地集团	12,892,979.76	4.58
13	600376	首开股份	12,886,253.46	4.58
14	600325	华发股份	12,565,793.00	4.46
15	000036	华联控股	12,434,924.00	4.42
16	600104	上汽集团	12,268,817.40	4.36
17	600028	中国石化	12,196,461.00	4.33
18	000429	粤高速 A	11,512,194.47	4.09
19	601288	农业银行	11,366,507.90	4.04
20	000157	中联重科	11,323,523.39	4.02
21	600741	华域汽车	11,210,823.17	3.98
22	601328	交通银行	11,134,915.51	3.96
23	601988	中国银行	11,060,470.00	3.93
24	002478	常宝股份	11,038,567.98	3.92
25	000631	顺发恒业	10,864,290.89	3.86
26	000625	长安汽车	10,814,174.88	3.84
27	601166	兴业银行	10,716,673.00	3.81
28	600900	长江电力	10,620,578.73	3.77
29	601398	工商银行	10,599,303.00	3.76
30	000895	双汇发展	10,564,915.55	3.75
31	002110	三钢闽光	10,372,328.72	3.68
32	002146	荣盛发展	10,217,706.27	3.63
33	002083	孚日股份	10,024,776.14	3.56
34	600162	香江控股	9,998,293.50	3.55
35	601636	旗滨集团	9,897,524.00	3.52
36	002016	世荣兆业	9,849,584.99	3.50
37	600897	厦门空港	9,811,503.52	3.49
38	600377	宁沪高速	9,572,855.66	3.40
39	600398	海澜之家	9,532,874.59	3.39
40	601998	中信银行	9,518,933.12	3.38
41	000848	承德露露	9,480,441.07	3.37
42	000656	金科股份	9,477,271.53	3.37
43	603766	隆鑫通用	9,312,621.50	3.31
44	000726	鲁泰 A	9,301,623.32	3.30

45	600177	雅戈尔	9,288,302.89	3.30
46	601009	南京银行	9,156,546.00	3.25
47	600688	上海石化	9,047,536.94	3.21
48	601158	重庆水务	8,886,489.00	3.16
49	000541	佛山照明	8,842,009.87	3.14
50	601006	大秦铁路	8,750,883.03	3.11
51	002713	东易日盛	8,732,091.78	3.10
52	001872	招商港口	8,671,741.80	3.08
53	600036	招商银行	8,639,429.11	3.07
54	600704	物产中大	8,565,425.65	3.04
55	002001	新和成	8,507,442.90	3.02
56	600660	福耀玻璃	8,478,077.86	3.01
57	600019	宝钢股份	8,400,128.27	2.98
58	000488	晨鸣纸业	8,384,510.50	2.98
59	600033	福建高速	8,175,749.25	2.90
60	600642	申能股份	8,106,940.84	2.88
61	600066	宇通客车	8,053,342.33	2.86
62	603001	奥康国际	7,927,704.43	2.82
63	000402	金融街	7,746,348.04	2.75
64	600183	生益科技	7,552,649.25	2.68
65	600020	中原高速	7,484,167.85	2.66
66	600023	浙能电力	7,394,708.00	2.63
67	000002	万科A	7,257,003.05	2.58
68	002372	伟星新材	7,234,629.32	2.57
69	600585	海螺水泥	7,213,297.37	2.56
70	600269	赣粤高速	7,132,052.81	2.53
71	600350	山东高速	6,974,497.83	2.48
72	002206	海利得	6,933,911.00	2.46
73	600887	伊利股份	6,813,027.00	2.42
74	002543	万和电气	6,712,747.00	2.38
75	600674	川投能源	6,701,509.40	2.38
76	000333	美的集团	6,656,057.87	2.36
77	002142	宁波银行	6,639,830.73	2.36
78	600018	上港集团	6,566,451.14	2.33
79	000568	泸州老窖	6,520,438.00	2.32
80	600048	保利地产	6,401,880.20	2.27
81	600153	建发股份	6,258,545.35	2.22
82	000600	建投能源	6,171,452.00	2.19
83	600795	国电电力	6,147,673.00	2.18
84	600016	民生银行	6,106,536.00	2.17
85	000828	东莞控股	6,004,263.00	2.13
86	600743	华远地产	5,865,193.67	2.08

87	600312	平高电气	5,762,460.00	2.05
88	601877	正泰电器	5,663,168.00	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。

#### 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	000550	江铃汽车	5,373,879.00	1.91
2	000656	金科股份	3,242,358.90	1.15
3	600664	哈药股份	3,225,483.60	1.15
4	000876	新希望	3,015,124.11	1.07
5	002601	龙蟠佰利	2,686,418.00	0.95
6	000338	潍柴动力	2,154,044.00	0.77
7	600153	建发股份	2,049,555.28	0.73
8	600873	梅花生物	1,948,556.00	0.69
9	600507	方大特钢	1,940,950.00	0.69
10	600383	金地集团	1,914,674.00	0.68
11	000036	华联控股	1,890,885.00	0.67
12	002367	康力电梯	1,864,316.00	0.66
13	600325	华发股份	1,857,001.00	0.66
14	600376	首开股份	1,849,187.00	0.66
15	603328	依顿电子	1,821,758.00	0.65
16	601566	九牧王	1,744,593.00	0.62
17	600104	上汽集团	1,673,751.00	0.59
18	601288	农业银行	1,662,102.00	0.59
19	600886	国投电力	1,653,044.00	0.59
20	601328	交通银行	1,601,140.00	0.57

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)填列,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	950,264,497.84
卖出股票收入(成交)总额	133,130,254.00

注:本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	29,988,000.00	2.54
	其中：政策性金融债	29,988,000.00	2.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,988,000.00	2.54

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190201	19 国开 01	300,000	29,988,000.00	2.54

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 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内受到公开谴责、处罚处罚的情形

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2 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。

**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	237,378.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	373,584.61
5	应收申购款	5,935,707.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,546,670.46

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.00	新股流通受限

**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 (%)
132,843	5,387.25	119,407,287.84	16.68	596,251,503.04	83.32

注:持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户数。

## 8.2 期末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	1,871,951.57	0.2616

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
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 2 月 2 日) 基金份额总额	1,869,829,259.37
本报告期期初基金份额总额	181,624,826.65
本报告期基金总申购份额	661,944,291.31
减:本报告期基金总赎回份额	127,910,327.08
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	715,658,790.88

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自 2019 年 7 月 6 日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

无。

**10.4 基金投资策略的改变**

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(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、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	650,091,023.17	60.12%	592,431.18	60.12%	-
光大证券	1	431,219,149.25	39.88%	392,981.61	39.88%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

注：中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各

投资组合证券交易需要；

（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金新增席位：兴业证券。本报告期内本基金退租席位：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 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	关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-28
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-22
3	关于大成中证红利指数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	2019-06-20
4	大成基金管理有限公司关于大成中证红利指数证券投资基金 2019 年第 1 次分红的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-18
5	关于大成中证红利指数证券投资基金暂停大额申购（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	2019-06-14
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储证券有限责任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	2019-05-21
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众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	2019-04-25
8	大成基金管理有限公司关于通过大成钱柜交易实施费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-25
9	大成中证红利指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-19
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏江南农村商业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	2019-04-04
11	大成中证红利指数证券投资基金 2018 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-29

12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晋城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	2019-03-28
13	关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-19
14	大成中证红利指数证券投资基金更新招募说明书及摘要（2019 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-15
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京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	2019-03-07
16	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险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	2019-03-05
17	关于大成中证红利指数证券投资基金增加中国民生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	2019-02-23
18	大成中证红利指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-19
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰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	2019-01-19

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我司发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过，自 2019 年 7 月 6 日起，公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中证红利指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证红利指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、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

2019年8月27日