

大成健康产业混合型证券投资基金 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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38

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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
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.....	44
§12 备查文件目录.....	44
12.1 备查文件目录.....	44
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	大成健康产业混合型证券投资基金
基金简称	大成健康产业混合
基金主代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 24 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,026,922.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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

2、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》的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,091,757.66
本期利润	3,530,121.00
加权平均基金份额本期利润	0.1340
本期加权平均净值利润率	16.69%
本期基金份额净值增长率	18.04%
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	-4,054,544.47
期末可供分配基金份额利润	-0.1558
期末基金资产净值	21,972,377.53
期末基金份额净值	0.844
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	-18.53%

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除

相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

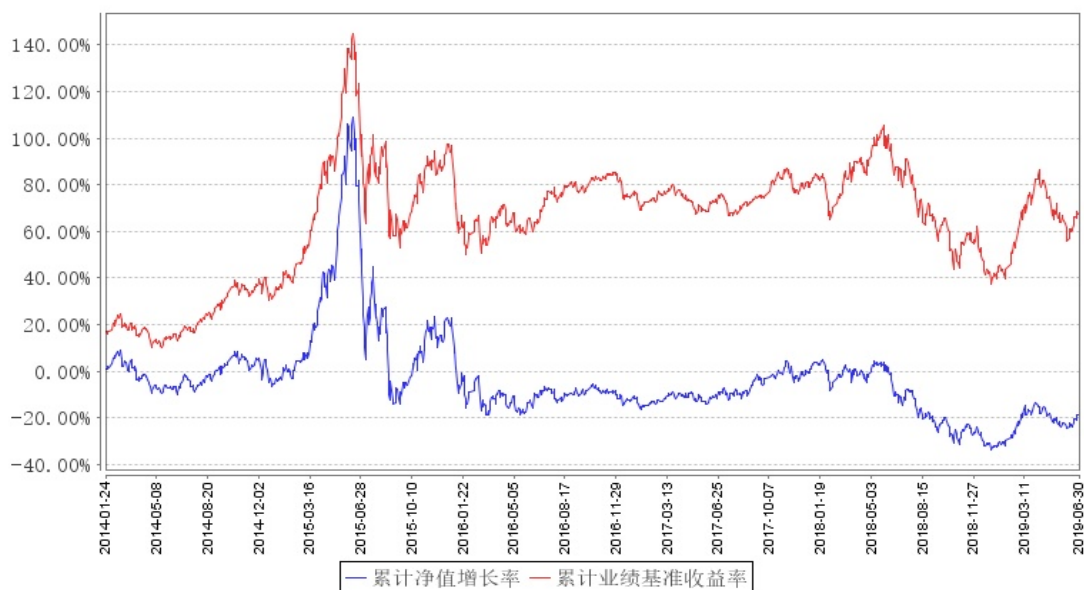
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.84%	0.99%	1.61%	1.11%	3.23%	-0.12%
过去三个月	-4.42%	1.21%	-5.94%	1.32%	1.52%	-0.11%
过去六个月	18.04%	1.42%	17.56%	1.37%	0.48%	0.05%
过去一年	-8.86%	1.54%	-10.48%	1.42%	1.62%	0.12%
过去三年	-9.73%	1.27%	-1.03%	1.06%	-8.70%	0.21%
自基金合同生效起至今	-18.53%	1.88%	44.91%	1.39%	-63.44%	0.49%

注：1. 根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

2. 本基金自 2014 年 1 月 24 日起由大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转为大成健康产业股票型证券投资基金，所涉及的相关数据计算起始日从本次年报开始由原大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金成立日变更为大成健康产业股票型证券投资基金合同生效日。

3.2.2 自基金转型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

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

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定,基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日(基金合同生效日)起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。

3、根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起,由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”;基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

4、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》的有关规定,经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十年的稳健发展，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		
杨挺	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 日	-	11 年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2012 年 8 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 26 日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成健康产业股票型证券投资基金）。2015 年 7 月 8 日任大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017

					<p>年 9 月 12 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理。</p> <p>2019 年 2 月 20 日起任大成国家安全主题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</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合规守信情况的说明

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

市场在 2019 年一季度走出单边上行的行情后，二季度指数波动性明显加剧。上证指数在 4 月份走出半年高点后，投资者对于经济现状的担忧导致大部分股票开始回调，5 月初中美贸易摩擦加剧，以通信为代表的科技板块加剧了调整，但是以白酒为代表的消费板块在此时表现突出，不少个股创出新高。市场进入 6 月后，伴随贸易摩擦缓和，市场整体人气又有回升。

在组合操作上，经过一季度疯狂的上涨，我们在 4 月判断到了市场可能出现的调整，对仓位进行了降低，但是 5 月初的贸易谈判仍然超出我们预期，之后我们对仓位进行了进一步控制，使得组合减少了一些损失。6 月后我们认为市场对于经济环境和贸易困难都有了充分的预期，因此开始提升仓位并对市场做出较为乐观的预期。目前我们的持仓以医疗器械，消费和通信电子为主，宏观经济数据和贸易谈判的进展是目前我们关注的主要方向。

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 0.844 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.04%，业绩比较基准收益率为 17.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先，我们认为在贴现利率驱动下的金融供给侧改革使市场具备可为的空间。“金融供给侧改革”的核心主旨在于：“让市场在资源配置中发挥更大的作用”。19 年 A 股“金融供给侧慢牛”核心驱动力来自于股票定价模型 DDM 模型的分母端贴现率，估值扩张的核心驱动来自于政策由破到立，从促进广谱利率下行和风险偏好提升两方面形成推动。市场主要分歧集中在“金融供给侧改革对改善经济的作用不大、对改善企业盈利的传导很慢，因此股票市场得不到积极映射”，我们认为这存在两点误区：第一，“经济差，则企业盈利差”可能是误认为需求=企业盈利，而忽视了企业盈利是供求关系的结果，事实上过去三年实体供给侧改革使得过剩产能大幅消化，供给收缩需求较弱的组合使得企业盈利虽然弹性不大但失速的可能性也很小；第二，“经济不佳，股市走熊”是过度看重分子端的影响，而忽视了本轮分母端贴现率的驱动力量更大，由于破旧立新的过程中风险偏好是波折渐进的，因此贴现率驱动的是“金融供给侧慢牛”。

其次，金融供给侧改革同时作用于实体端和金融端，通过调结构、促开放、防风险等手段引导实体和金融两端迎来“进化”：从金融的需求端（实体）来看，“民企纾困”将使所有制分化走向“弥合”，信贷资源向高质量、新经济领域倾斜带来产业链“升级”，“促开放、防风险”基调下会进一步鼓励优胜劣汰、使行业内部竞争“优化”；从金融的供给端来看，“大河有水小河满”的时代将一去不复返，银行间市场、实体领域以及股票市场流动性分层，而长线资金占比抬升、

金融供给侧改革加速风险定价标尺修正、风险定价体系重塑，使盈利偏好分层，盈利稳定性优于盈利高弹性。

最后，19 年 A 股市场有“三个确定”和“三个不确定”，行业配置围绕确定性，规避不确定性。1) 19 年盈利小年是确定趋势，业绩逆势向上行业个股易受追捧，但经济增长是否超预期因为变量很多并不确定；2) 外资加速流入是确定趋势，长线资金偏好的蓝筹股筹码供求结构较好，伪成长概念股上涨后是否遭遇产业资本减持是不确定的；3) 科创板启动及发酵时间是确定的，从而提升科技股风险偏好，但科创板上市后供给分流节奏是不确定的。因此，19 年的行业配置思路把握“不确定性中的确定性”。在行业比较思路，业绩景气跟踪的重要性上升；在资金供求端，长线资金偏爱的“中国优势”行业仍有保障；在科创风格上，需要甄别高质量倾斜的优质成长行业会受到风险偏好提振。

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

本基金管理人将严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成健康产业混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.3.1	3,334,172.38	5,912,095.35
结算备付金		128,422.72	37,291.39
存出保证金		12,750.89	9,743.22
交易性金融资产	6.4.3.2	18,741,660.28	13,458,296.95
其中：股票投资		18,696,797.78	13,458,296.95
基金投资		-	-
债券投资		44,862.50	-
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		-	-
应收利息	6.4.3.5	666.17	1,145.86
应收股利		-	-
应收申购款		8,107.50	6,179.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		22,225,779.94	19,424,752.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		108,667.64	94,807.55
应付赎回款		2,957.33	33,281.43
应付管理人报酬		26,197.14	25,114.55
应付托管费		4,366.20	4,185.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	75,488.23	27,993.75
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	35,725.87	145,006.00
负债合计		253,402.41	330,389.04
所有者权益：			

实收基金	6.4.3.9	26,026,922.00	26,710,181.41
未分配利润	6.4.3.10	-4,054,544.47	-7,615,818.43
所有者权益合计		21,972,377.53	19,094,362.98
负债和所有者权益总计		22,225,779.94	19,424,752.02

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.844 元，基金份额总额 26,026,922.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：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		3,984,833.29	-2,525,233.08
1. 利息收入		18,068.35	11,439.15
其中：存款利息收入	6.4.3.11	17,950.27	10,730.43
债券利息收入		34.98	57.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		83.10	651.63
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,522,411.78	974,912.08
其中：股票投资收益	6.4.3.12	1,405,233.55	794,677.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	14,988.70	489.31
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	102,189.53	179,745.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	2,438,363.34	-3,517,597.62
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	5,989.82	6,013.31
减：二、费用		454,712.29	471,461.81
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	156,608.08	196,804.81
2. 托管费	6.4.6.2.2	26,101.40	32,800.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	233,784.63	135,292.69

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.06	0.20
7. 其他费用	6.4.3.20	38,218.12	106,563.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,530,121.00	-2,996,694.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,530,121.00	-2,996,694.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：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）	26,710,181.41	-7,615,818.43	19,094,362.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,530,121.00	3,530,121.00
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）	-683,259.41	31,152.96	-652,106.45
其中：1. 基金申购款	5,254,991.77	-962,063.54	4,292,928.23
2. 基金赎回款	-5,938,251.18	993,216.50	-4,945,034.68
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）	26,026,922.00	-4,054,544.47	21,972,377.53
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）	26,604,157.95	1,215,981.38	27,820,139.33

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,996,694.89	-2,996,694.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-794,813.68	-119,235.77	-914,049.45
其中：1. 基金申购款	4,959,084.10	145,597.92	5,104,682.02
2. 基金赎回款	-5,753,897.78	-264,833.69	-6,018,731.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	25,809,344.27	-1,899,949.28	23,909,394.99

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

6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳；

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.2.2 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征

收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	3,334,172.38
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	3,334,172.38

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	17,178,804.26	18,696,797.78	1,517,993.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,862.50	862.50
	银行间市场	-	-
	合计	44,862.50	862.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	17,222,804.26	18,741,660.28	1,518,856.02

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

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	588.37
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	52.02
应收债券利息	20.56
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	5.22
合计	666.17

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	75,488.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	75,488.23

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	9.46
预提费用	35,716.41
合计	35,725.87

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	26,710,181.41	26,710,181.41
本期申购	5,254,991.77	5,254,991.77
本期赎回（以“-”号填列）	-5,938,251.18	-5,938,251.18
- 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	26,026,922.00	26,026,922.00
-----	---------------	---------------

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	-3,172,633.58	-4,443,184.85	-7,615,818.43
本期利润	1,091,757.66	2,438,363.34	3,530,121.00
本期基金份额交易产生的变动数	29,916.78	1,236.18	31,152.96
其中:基金申购款	-442,772.69	-519,290.85	-962,063.54
基金赎回款	472,689.47	520,527.03	993,216.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,050,959.14	-2,003,585.33	-4,054,544.47

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	16,852.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,007.99
其他	89.78
合计	17,950.27

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	77,458,385.64
减:卖出股票成本总额	76,053,152.09
买卖股票差价收入	1,405,233.55

6.4.3.13 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	74,003.70
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	59,000.00
减:应收利息总额	15.00
买卖债券差价收入	14,988.70

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	102,189.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	102,189.53

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	2,438,363.34
股票投资	2,437,500.84
债券投资	862.50
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	2,438,363.34

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	5,077.07
基金转换费收入	912.75
合计	5,989.82

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

(2) 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	233,784.63
银行间市场交易费用	-
合计	233,784.63

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	9,916.99
信息披露费	25,799.42
银行费用	2,501.71
合计	38,218.12

6.4.3.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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

无。

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**

无。

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”）	基金销售机构、基金管理人、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金销售机构、基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	87,780,137.24	56.16	5,026,014.10	5.62

6.4.6.1.2 债券交易

无。

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	80,006.90	56.16	36,979.31	48.99
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	4,579.67	5.62	4,579.67	11.45

注：(1) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

(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	156,608.08	196,804.81
其中：支付销售机构的客户维护费	53,646.35	66,478.63

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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	26,101.40	32,800.76

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 1 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.3036%	19.4700%

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		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
中国银行	3,334,172.38	16,852.50	2,731,932.24	10,078.83

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

无。

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

无。

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

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

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

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

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金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。本基金的活期银行

存款存放在本基金的托管行中国银行，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 0.20% (上年度末：0.00%)。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	28,048.80	-
AAA 以下	16,813.70	-
未评级	-	-
合计	44,862.50	-

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指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，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

本基金持有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、结算备付金及买入返售金融资产等。

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	3,334,172.38	-	-	-	3,334,172.38
结算备付金	128,422.72	-	-	-	128,422.72

存出保证金	12,750.89	-	-	-	12,750.89
交易性金融资产	-	-	44,862.50	18,696,797.78	18,741,660.28
应收利息	-	-	-	666.17	666.17
应收申购款	-	-	-	8,107.50	8,107.50
资产总计	3,475,345.99	-	44,862.50	18,705,571.45	22,225,779.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,957.33	2,957.33
应付管理人报酬	-	-	-	26,197.14	26,197.14
应付托管费	-	-	-	4,366.20	4,366.20
应付证券清算款	-	-	-	108,667.64	108,667.64
应付交易费用	-	-	-	75,488.23	75,488.23
其他负债	-	-	-	35,725.87	35,725.87
负债总计	-	-	-	253,402.41	253,402.41
利率敏感度缺口	3,475,345.99	-	44,862.50	18,452,169.04	21,972,377.53
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	5,912,095.35	-	-	-	5,912,095.35
结算备付金	37,291.39	-	-	-	37,291.39
存出保证金	9,743.22	-	-	-	9,743.22
交易性金融资产	-	-	-	13,458,296.95	13,458,296.95
应收利息	-	-	-	1,145.86	1,145.86
应收申购款	-	-	-	6,179.25	6,179.25
资产总计	5,959,129.96	-	-	13,465,622.06	19,424,752.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	33,281.43	33,281.43
应付管理人报酬	-	-	-	25,114.55	25,114.55
应付托管费	-	-	-	4,185.76	4,185.76
应付证券清算款	-	-	-	94,807.55	94,807.55
应付交易费用	-	-	-	27,993.75	27,993.75
其他负债	-	-	-	145,006.00	145,006.00
负债总计	-	-	-	330,389.04	330,389.04
利率敏感度缺口	5,959,129.96	-	-	13,135,233.02	19,094,362.98

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者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.20%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	18,696,797.78	85.09	13,458,296.95	70.48
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	18,696,797.78	85.09	13,458,296.95	70.48

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%	960,000.00	940,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-960,000.00	-940,000.00

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

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	18,696,797.78	84.12
	其中：股票	18,696,797.78	84.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,862.50	0.20
	其中：债券	44,862.50	0.20
	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	3,462,595.10	15.58
8	其他各项资产	21,524.56	0.10
9	合计	22,225,779.94	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	-	-
C	制造业	16,369,927.78	74.50
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	325,780.00	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	744,588.00	3.39
J	金融业	-	-

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	1,256,502.00	5.72
S	综合	-	-
	合计	18,696,797.78	85.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600529	山东药玻	73,360	1,671,140.80	7.61
2	300760	迈瑞医疗	9,979	1,628,572.80	7.41
3	002223	鱼跃医疗	53,900	1,327,018.00	6.04
4	300144	宋城演艺	54,300	1,256,502.00	5.72
5	002001	新和成	58,000	1,118,820.00	5.09
6	603501	韦尔股份	19,300	1,059,763.00	4.82
7	600276	恒瑞医药	14,500	957,000.00	4.36
8	600216	浙江医药	92,900	951,296.00	4.33
9	603517	绝味食品	24,320	946,291.20	4.31
10	300146	汤臣倍健	46,200	896,280.00	4.08
11	000063	中兴通讯	26,800	871,804.00	3.97
12	002916	深南电路	8,300	845,936.00	3.85
13	002463	沪电股份	60,400	822,648.00	3.74
14	603899	晨光文具	17,900	787,063.00	3.58
15	300383	光环新网	44,400	744,588.00	3.39
16	002422	科伦药业	24,611	731,685.03	3.33
17	603288	海天味业	5,400	567,000.00	2.58
18	002301	齐心集团	46,800	542,412.00	2.47
19	000858	五粮液	2,800	330,260.00	1.50
20	600004	白云机场	17,900	325,780.00	1.48
21	603186	华正新材	11,100	314,907.00	1.43
22	002002	鸿达兴业	5	30.95	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	603501	韦尔股份	3,338,885.69	17.49
2	002223	鱼跃医疗	2,165,862.00	11.34
3	600030	中信证券	2,066,776.00	10.82
4	300383	光环新网	1,974,961.00	10.34
5	603186	华正新材	1,973,560.00	10.34
6	000063	中兴通讯	1,950,768.00	10.22
7	600837	海通证券	1,948,593.00	10.21
8	300331	苏大维格	1,748,497.00	9.16
9	002916	深南电路	1,492,094.00	7.81
10	002555	三七互娱	1,491,358.00	7.81
11	603899	晨光文具	1,430,541.00	7.49
12	300601	康泰生物	1,254,812.00	6.57
13	002001	新和成	1,230,919.00	6.45
14	601688	华泰证券	1,152,593.00	6.04
15	002463	沪电股份	1,075,950.00	5.63
16	600216	浙江医药	1,068,065.00	5.59
17	603517	绝味食品	1,065,190.00	5.58
18	600055	万东医疗	1,047,893.80	5.49
19	002624	完美世界	980,386.00	5.13
20	000876	新希望	966,385.00	5.06
21	300413	芒果超媒	958,974.00	5.02
22	002430	杭氧股份	958,406.00	5.02
23	300146	汤臣倍健	951,355.00	4.98
24	002422	科伦药业	949,301.00	4.97
25	600276	恒瑞医药	929,454.00	4.87
26	600845	宝信软件	892,034.00	4.67
27	002230	科大讯飞	885,520.00	4.64
28	000783	长江证券	865,486.00	4.53
29	600004	白云机场	848,247.00	4.44
30	300702	天宇股份	838,743.07	4.39
31	603360	百傲化学	813,624.00	4.26
32	300098	高新兴	806,827.00	4.23
33	300686	智动力	800,080.00	4.19
34	002385	大北农	773,993.00	4.05
35	300373	扬杰科技	771,006.00	4.04
36	002847	盐津铺子	732,162.00	3.83
37	600332	白云山	725,459.00	3.80

38	601555	东吴证券	721,114.00	3.78
39	603026	石大胜华	697,750.00	3.65
40	600848	上海临港	692,505.00	3.63
41	002530	金财互联	683,309.00	3.58
42	600809	山西汾酒	674,630.00	3.53
43	002044	美年健康	673,086.00	3.53
44	300474	景嘉微	672,896.00	3.52
45	600273	嘉化能源	659,854.00	3.46
46	601689	拓普集团	655,581.00	3.43
47	300498	温氏股份	649,011.00	3.40
48	603008	喜临门	648,794.00	3.40
49	000858	五粮液	639,758.00	3.35
50	002912	中新赛克	617,129.00	3.23
51	600029	南方航空	579,085.00	3.03
52	000529	广弘控股	578,578.00	3.03
53	600115	东方航空	569,137.00	2.98
54	002146	荣盛发展	567,783.76	2.97
55	600085	同仁堂	566,348.00	2.97
56	300395	菲利华	563,128.00	2.95
57	000002	万科A	560,065.00	2.93
58	601607	上海医药	556,235.00	2.91
59	300496	中科创达	556,023.00	2.91
60	603444	吉比特	551,919.00	2.89
61	001979	招商蛇口	543,983.00	2.85
62	002271	东方雨虹	533,274.00	2.79
63	603288	海天味业	521,539.00	2.73
64	002301	齐心集团	520,471.00	2.73
65	000401	冀东水泥	506,420.00	2.65
66	300760	迈瑞医疗	502,562.00	2.63
67	600529	山东药玻	501,478.00	2.63
68	600048	保利地产	480,640.00	2.52
69	300400	劲拓股份	480,248.00	2.52
70	300284	苏交科	462,305.60	2.42
71	600111	北方稀土	458,972.00	2.40
72	002657	中科金财	458,794.00	2.40
73	600392	盛和资源	458,164.00	2.40
74	601888	中国国旅	456,731.00	2.39
75	300481	濮阳惠成	455,571.00	2.39
76	002550	千红制药	455,283.00	2.38
77	603806	福斯特	444,269.20	2.33
78	600741	华域汽车	442,854.00	2.32
79	002583	海能达	442,128.00	2.32

80	000150	宜华健康	440,862.00	2.31
81	300335	迪森股份	434,960.00	2.28
82	002563	森马服饰	429,694.00	2.25
83	603363	傲农生物	429,613.00	2.25
84	002124	天邦股份	425,788.00	2.23
85	000860	顺鑫农业	419,013.00	2.19
86	600519	贵州茅台	402,500.00	2.11

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	603501	韦尔股份	2,919,040.00	15.29
2	600030	中信证券	2,154,211.99	11.28
3	600837	海通证券	2,088,617.00	10.94
4	300331	苏大维格	1,884,723.00	9.87
5	603517	绝味食品	1,773,273.00	9.29
6	002044	美年健康	1,745,167.92	9.14
7	002555	三七互娱	1,740,318.38	9.11
8	603186	华正新材	1,655,785.00	8.67
9	300601	康泰生物	1,441,468.00	7.55
10	300383	光环新网	1,410,659.00	7.39
11	300122	智飞生物	1,373,335.16	7.19
12	002614	奥佳华	1,345,125.64	7.04
13	601688	华泰证券	1,287,245.00	6.74
14	600055	万东医疗	1,274,725.72	6.68
15	300498	温氏股份	1,206,518.00	6.32
16	300146	汤臣倍健	1,178,824.22	6.17
17	600845	宝信软件	1,032,610.00	5.41
18	300413	芒果超媒	1,026,819.53	5.38
19	000063	中兴通讯	1,025,112.00	5.37
20	300098	高新兴	996,847.00	5.22
21	002912	中新赛克	970,147.00	5.08
22	002624	完美世界	966,763.00	5.06
23	000876	新希望	959,224.00	5.02
24	300702	天宇股份	953,300.68	4.99
25	002223	鱼跃医疗	949,077.00	4.97
26	002430	杭氧股份	912,628.00	4.78
27	002230	科大讯飞	896,511.00	4.70
28	000783	长江证券	881,077.00	4.61
29	002916	深南电路	836,039.00	4.38
30	300628	亿联网络	831,329.00	4.35

31	300373	扬杰科技	829,002.47	4.34
32	300496	中科创达	824,056.00	4.32
33	300686	智动力	796,899.00	4.17
34	601555	东吴证券	759,622.00	3.98
35	601689	拓普集团	751,382.00	3.94
36	600848	上海临港	730,067.00	3.82
37	603899	晨光文具	727,971.00	3.81
38	300760	迈瑞医疗	727,462.03	3.81
39	000529	广弘控股	714,545.38	3.74
40	603026	石大胜华	703,116.00	3.68
41	603360	百傲化学	698,484.00	3.66
42	002847	盐津铺子	696,273.00	3.65
43	002530	金财互联	685,179.00	3.59
44	600809	山西汾酒	673,223.14	3.53
45	002385	大北农	671,107.00	3.51
46	300395	菲利华	659,753.00	3.46
47	300144	宋城演艺	648,889.00	3.40
48	600332	白云山	638,223.00	3.34
49	603337	杰克股份	629,933.15	3.30
50	603008	喜临门	620,521.99	3.25
51	300474	景嘉微	616,293.00	3.23
52	603444	吉比特	602,436.00	3.16
53	000002	万科A	592,702.00	3.10
54	603363	傲农生物	567,865.00	2.97
55	002146	荣盛发展	560,383.96	2.93
56	600085	同仁堂	551,306.00	2.89
57	600273	嘉化能源	538,258.00	2.82
58	001979	招商蛇口	515,239.00	2.70
59	601607	上海医药	514,589.00	2.69
60	600004	白云机场	499,516.00	2.62
61	002271	东方雨虹	498,661.00	2.61
62	600887	伊利股份	498,625.00	2.61
63	000401	冀东水泥	494,943.58	2.59
64	601888	中国国旅	487,630.00	2.55
65	603806	福斯特	485,009.80	2.54
66	002657	中科金财	482,962.00	2.53
67	300400	劲拓股份	476,862.00	2.50
68	600519	贵州茅台	451,250.00	2.36
69	600029	南方航空	448,979.00	2.35
70	600111	北方稀土	444,882.00	2.33
71	600392	盛和资源	442,208.00	2.32
72	300481	濮阳惠成	441,106.00	2.31

73	600048	保利地产	439,491.00	2.30
74	600115	东方航空	438,851.00	2.30
75	601766	中国中车	437,788.00	2.29
76	300284	苏交科	424,997.00	2.23
77	002563	森马服饰	410,404.00	2.15
78	002550	千红制药	410,080.00	2.15
79	600741	华域汽车	409,148.00	2.14
80	000150	宜华健康	402,742.00	2.11
81	002583	海能达	394,920.00	2.07
82	300335	迪森股份	391,038.00	2.05

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	78,854,152.08
卖出股票收入（成交）总额	77,458,385.64

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	44,862.50	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,862.50	0.20

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	127012	招路转债	140	14,394.80	0.07
2	110057	现代转债	70	7,415.80	0.03
3	113026	核能转债	60	6,238.20	0.03
4	113025	明泰转债	60	5,992.20	0.03

5	113530	大丰转债	40	3,968.00	0.02
---	--------	------	----	----------	------

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内受到公开谴责、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	12,750.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	666.17
5	应收申购款	8,107.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	21,524.56
---	----	-----------

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,393	10,876.27	5,024,120.60	19.30	21,002,801.40	80.70

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	9,916.82	0.0381

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 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年1月24日）基金份额总额	22,376,979.98
本报告期期初基金份额总额	26,710,181.41
本报告期基金总申购份额	5,254,991.77
减：本报告期基金总赎回份额	5,938,251.18

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	26,026,922.00

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门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	
光大证券	2	87,780,137.24	56.16%	80,006.90	56.16%	-
长江证券	2	46,663,293.48	29.85%	42,522.76	29.85%	-
西南证券	1	11,702,207.00	7.49%	10,663.85	7.49%	-
太平洋证券	1	5,850,295.00	3.74%	5,330.61	3.74%	-
国都证券	1	4,316,605.00	2.76%	3,934.40	2.76%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注:1、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。

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：无。退出交易单元：民族证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	74,003.70	100.00%	900,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	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
4	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
5	大成健康产业混合型证券投资基金 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
6	大成健康产业混合型证券投资基金 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
7	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
8	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
9	大成健康产业混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要(2019 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-08
10	大成健康产业混合型证券投资基金 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
11	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 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3、《大成健康产业股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 4、《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《大成健康产业混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 7、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