

大成行业轮动混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019年8月27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。

基金托管人中国农业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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成行业轮动混合
基金主代码	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 8 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	93,291,396.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用行业轮动效应，优化行业配置，获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数
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

§ 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	9,017,001.28
本期利润	26,837,372.39
加权平均基金份额本期利润	0.2736
本期基金份额净值增长率	21.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4303
期末基金资产净值	137,250,521.42
期末基金份额净值	1.471

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。

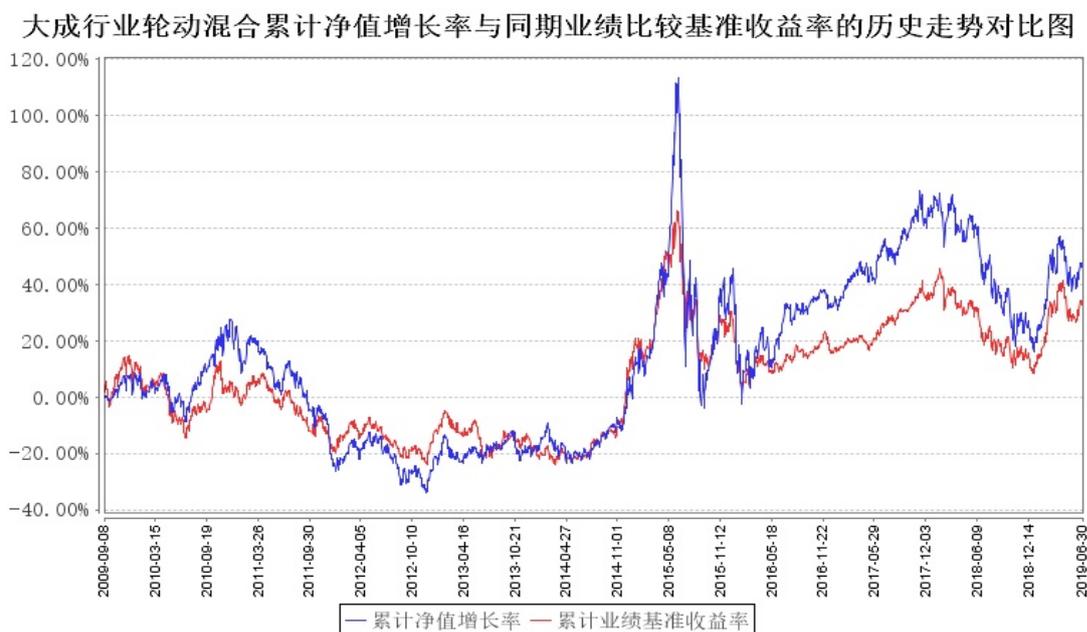
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.72%	1.10%	4.42%	0.93%	-1.70%	0.17%
过去三个月	-1.80%	1.44%	-0.72%	1.22%	-1.08%	0.22%
过去六个月	21.97%	1.52%	21.89%	1.24%	0.08%	0.28%
过去一年	0.07%	1.58%	8.87%	1.22%	-8.80%	0.36%
过去三年	15.55%	1.22%	20.08%	0.89%	-4.53%	0.33%
自基金合同生效起至今	47.10%	1.66%	33.79%	1.19%	13.31%	0.47%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注: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		
王磊	本基金基金经理	2015 年 12 月 14 日	-	16 年	<p>经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。</p> <p>2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。</p>

					<p>2014 年 12 月 9 日至 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 21 日至 2019 年 1 月 9 日任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日起任大成财富管理 2020 混合型证券投资基金基金经理。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

2019 年上半年，国内的权益市场整体上呈现了上行的态势。从国内的宏观经济态势看，由于国家从 2018 年下半年开始采取了一系列措施，如减税降费、减轻民营企业负担，降低社会融资成本等，提升了经济活力。这些措施在 2019 年呈现了较为明显的效果，整体经济企稳，民营企业的盈利能力和投资意愿均有明显改善。同时，一季度中美贸易谈判较为顺利，这些有利因素均对一季度权益的上行提供了坚实的基础。但到了二季度，中美贸易谈判出现反复，对权益市场造成了一定幅度的影响，但权益市场的下行幅度也较为有限，整体上呈现一个窄幅波动的格局。从市场指数看，2019 年上半年中证 100 指数上涨 28.81%，上证 50 指数上涨 27.80%，上证综指上涨 19.45%，创业板指数上涨 20.87%，大盘股指数表现相对较好。从行业指数上看，食品饮料、农林牧渔、非银金融等行业表现较好，传媒、轻工制造、汽车等行业表现略差。

2019 年上半年，本产品维持了一个较高的权益仓位，获得了一定的收益。

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 1.471 元；本报告期基金份额净值增长率为 21.97%，业

绩比较基准收益率为 21.89%。

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 年下半年，我们认为，权益市场仍然存在一定的投资机会。这是因为，从国内经济看，我国将继续坚持改革开放的政策，同时采取各种积极措施稳定经济，这将为国内企业盈利的好转提供较好的外部条件。同时，中美贸易谈判有望缓解，这将对我国的出口相关行业形成有力支撑。

2019 年下半年，我们将积极寻找业绩较好，有较大市场空间的行业和个股进行投资。在行业选择方面，消费、科技、新能源等行业将是我们的首选标的。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持。本基金将按照基金合同的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争为基金份额持有人获得与基金风险收益特征相一致的投资回报。

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

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成行业轮动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	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	25,922,712.50	22,540,018.08
结算备付金	635,928.37	649,940.16
存出保证金	142,819.83	94,656.23
交易性金融资产	112,363,096.04	110,160,370.12
其中：股票投资	111,946,401.54	110,160,370.12
基金投资	-	-
债券投资	416,694.50	-
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	-	-
应收证券清算款	695,904.91	-
应收利息	5,214.33	4,976.28
应收股利	-	-
应收申购款	5,756.60	7,496.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	139,771,432.58	133,457,457.29
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,781,595.93	3,210,797.38
应付赎回款	54,231.82	7,203.39
应付管理人报酬	165,286.45	169,961.38
应付托管费	27,547.73	28,326.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	398,315.42	212,948.12
应交税费	2.43	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	93,931.38	270,024.29
负债合计	2,520,911.16	3,899,261.45
所有者权益：		
实收基金	93,291,396.35	107,391,044.41
未分配利润	43,959,125.07	22,167,151.43
所有者权益合计	137,250,521.42	129,558,195.84
负债和所有者权益总计	139,771,432.58	133,457,457.29

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.471 元，基金份额总额 93,291,396.35 份。

6.2 利润表

会计主体：大成行业轮动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	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
一、收入	29,538,727.01	-20,904,076.54
1. 利息收入	84,134.93	85,415.26
其中：存款利息收入	83,927.91	85,415.26
债券利息收入	207.02	-
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）	11,617,735.28	7,640,449.26
其中：股票投资收益	10,520,103.47	6,210,714.71
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,097,631.81	1,429,734.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	17,820,371.11	-28,707,559.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	16,485.69	77,618.72
减：二、费用	2,701,354.62	3,230,484.48
1. 管理人报酬	1,021,430.17	1,648,634.36
2. 托管费	170,238.36	274,772.41
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	1,402,693.83	1,110,404.87
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.79	-
7. 其他费用	106,991.47	196,672.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	26,837,372.39	-24,134,561.02
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	26,837,372.39	-24,134,561.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成行业轮动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）	107,391,044.41	22,167,151.43	129,558,195.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,837,372.39	26,837,372.39
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）	-14,099,648.06	-5,045,398.75	-19,145,046.81
其中：1. 基金申购款	6,104,209.90	2,555,149.14	8,659,359.04
2. 基金赎回款	-20,203,857.96	-7,600,547.89	-27,804,405.85
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）	93,291,396.35	43,959,125.07	137,250,521.42

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）	137,660,866.45	92,144,579.87	229,805,446.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,134,561.02	-24,134,561.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,323,153.60	-16,622,655.59	-44,945,809.19
其中：1. 基金申购款	25,322,917.40	16,849,705.64	42,172,623.04
2. 基金赎回款	-53,646,071.00	-33,472,361.23	-87,118,432.23
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	109,337,712.85	51,387,363.26	160,725,076.11

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 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 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
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
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

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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	272,131,452.43	29.39	-	-

6.4.4.1.2 债券交易

无。

6.4.4.1.3 债券回购交易

无。

6.4.4.1.4 权证交易

无。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	248,014.96	29.39	248,014.96	62.27
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 (%)
-	-	0.00	-	0.00

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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	1,021,430.17
其中：支付销售机构的客户维护费	280,322.92	384,824.18

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	170,238.36	274,772.41

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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		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
中国农业银行	25,922,712.50	76,831.92	26,049,388.08	78,936.52

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.5.1.1 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
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	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST信威	2016年12月26日	重大事项	5.76	2019年07月12日	13.86	240,763	3,905,283.00	1,386,794.88	-

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

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

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	111,946,401.54	80.09
	其中：股票	111,946,401.54	80.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	416,694.50	0.30
	其中：债券	416,694.50	0.30
	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	26,558,640.87	19.00
8	其他各项资产	849,695.67	0.61
9	合计	139,771,432.58	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	15,499,948.23	11.29
B	采矿业	80,372.00	0.06
C	制造业	71,380,223.53	52.01
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	4,270,651.00	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	2,968,795.60	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,155,293.96	3.76
J	金融业	8,604,234.72	6.27
K	房地产业	2,924.00	0.00
L	租赁和商务服务业	3,915,782.40	2.85
M	科学研究和技术服务业	45,069.50	0.03
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	0.02
S	综合	-	-
	合计	111,946,401.54	81.56

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	600519	贵州茅台	11,828	11,638,752.00	8.48
2	002202	金风科技	808,300	10,047,169.00	7.32
3	000333	美的集团	166,100	8,613,946.00	6.28
4	601166	兴业银行	468,582	8,570,364.78	6.24
5	300498	温氏股份	219,068	7,855,778.48	5.72
6	002714	牧原股份	130,025	7,644,169.75	5.57
7	300122	智飞生物	171,700	7,400,270.00	5.39
8	002001	新和成	379,220	7,315,153.80	5.33
9	300770	新媒股份	59,107	5,112,755.50	3.73
10	002727	一心堂	149,900	4,270,651.00	3.11

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>）的半年度报告正文。

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	300498	温氏股份	15,806,854.30	12.20
2	000002	万科A	14,118,364.23	10.90
3	600048	保利地产	13,960,628.00	10.78
4	002202	金风科技	13,175,583.80	10.17
5	002714	牧原股份	12,018,103.32	9.28
6	002001	新和成	11,364,272.40	8.77
7	601166	兴业银行	11,028,649.00	8.51
8	000876	新希望	9,316,089.33	7.19
9	000333	美的集团	8,692,688.12	6.71
10	002157	正邦科技	8,440,561.00	6.51

11	601336	新华保险	8,233,287.00	6.35
12	300122	智飞生物	7,793,330.00	6.02
13	002304	洋河股份	7,788,588.00	6.01
14	002146	荣盛发展	7,006,979.00	5.41
15	000858	五粮液	6,970,506.95	5.38
16	600216	浙江医药	6,896,214.93	5.32
17	600703	三安光电	6,010,344.00	4.64
18	000776	广发证券	5,909,936.00	4.56
19	600030	中信证券	5,837,773.00	4.51
20	300770	新媒股份	5,701,522.96	4.40
21	600887	伊利股份	5,668,726.76	4.38
22	600999	招商证券	5,652,295.00	4.36
23	600266	北京城建	5,595,888.15	4.32
24	601211	国泰君安	5,552,415.00	4.29
25	600000	浦发银行	5,489,700.85	4.24
26	600340	华夏幸福	5,415,800.91	4.18
27	002385	大北农	5,413,747.75	4.18
28	600547	山东黄金	5,380,409.00	4.15
29	600104	上汽集团	5,253,150.32	4.05
30	002174	游族网络	5,225,126.00	4.03
31	002024	苏宁易购	5,192,765.00	4.01
32	002311	海大集团	5,175,638.59	3.99
33	002912	中新赛克	4,666,251.00	3.60
34	300308	中际旭创	4,642,284.00	3.58
35	600297	广汇汽车	4,517,043.41	3.49
36	603000	人民网	4,464,380.37	3.45
37	601607	上海医药	4,458,077.00	3.44
38	603008	喜临门	4,420,407.22	3.41
39	002727	一心堂	4,326,595.00	3.34
40	002234	民和股份	4,260,454.00	3.29
41	002458	益生股份	4,255,507.20	3.28
42	000063	中兴通讯	4,036,834.00	3.12
43	600438	通威股份	3,968,005.58	3.06
44	002124	天邦股份	3,501,403.00	2.70
45	603986	兆易创新	3,292,251.00	2.54
46	600975	新五丰	3,268,725.00	2.52
47	002042	华孚时尚	3,252,671.51	2.51
48	603363	傲农生物	3,202,591.00	2.47
49	601939	建设银行	3,019,835.18	2.33
50	601919	中远海控	2,990,599.51	2.31
51	000671	阳光城	2,976,883.00	2.30
52	002236	大华股份	2,974,718.00	2.30

53	300457	赢合科技	2,961,616.34	2.29
54	603517	绝味食品	2,942,548.76	2.27
55	600029	南方航空	2,938,680.40	2.27
56	600690	海尔智家	2,900,979.02	2.24
57	002258	利尔化学	2,898,382.00	2.24
58	300059	东方财富	2,887,559.00	2.23
59	600705	中航资本	2,884,038.31	2.23
60	300144	宋城演艺	2,871,542.74	2.22
61	603888	新华网	2,783,335.00	2.15
62	000732	泰禾集团	2,780,368.00	2.15
63	300601	康泰生物	2,736,601.00	2.11
64	300433	蓝思科技	2,722,666.46	2.10
65	600489	中金黄金	2,702,508.00	2.09
66	002352	顺丰控股	2,693,544.00	2.08
67	002867	周大生	2,692,533.00	2.08
68	603806	福斯特	2,654,419.00	2.05
69	002739	万达电影	2,653,753.00	2.05
70	300094	国联水产	2,653,594.00	2.05
71	600958	东方证券	2,649,286.00	2.04
72	300373	扬杰科技	2,629,024.00	2.03
73	002241	歌尔股份	2,627,200.00	2.03
74	603816	顾家家居	2,624,592.00	2.03
75	000568	泸州老窖	2,613,256.00	2.02

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	000002	万科A	20,731,401.20	16.00
2	600048	保利地产	16,992,374.84	13.12
3	300144	宋城演艺	13,374,200.70	10.32
4	002304	洋河股份	10,801,621.95	8.34
5	600887	伊利股份	9,804,094.58	7.57
6	601336	新华保险	8,879,434.60	6.85
7	300498	温氏股份	8,413,784.14	6.49
8	000876	新希望	7,700,296.25	5.94
9	600216	浙江医药	6,927,518.98	5.35
10	300760	迈瑞医疗	6,853,143.31	5.29
11	603000	人民网	6,758,203.91	5.22
12	002146	荣盛发展	6,644,580.49	5.13
13	600703	三安光电	6,365,911.65	4.91
14	600340	华夏幸福	6,274,634.83	4.84

15	300122	智飞生物	6,228,072.60	4.81
16	300408	三环集团	6,104,250.00	4.71
17	002157	正邦科技	5,978,760.06	4.61
18	600030	中信证券	5,945,098.00	4.59
19	000776	广发证券	5,929,096.00	4.58
20	600999	招商证券	5,745,484.00	4.43
21	600266	北京城建	5,721,210.35	4.42
22	002024	苏宁易购	5,701,575.20	4.40
23	600104	上汽集团	5,613,862.00	4.33
24	600547	山东黄金	5,604,258.60	4.33
25	002460	赣锋锂业	5,549,072.22	4.28
26	601211	国泰君安	5,532,226.51	4.27
27	002311	海大集团	5,505,654.84	4.25
28	002174	游族网络	5,308,721.28	4.10
29	600000	浦发银行	5,228,151.96	4.04
30	000333	美的集团	5,180,025.44	4.00
31	002385	大北农	4,996,938.42	3.86
32	600438	通威股份	4,885,929.37	3.77
33	600297	广汇汽车	4,850,696.00	3.74
34	002008	大族激光	4,840,501.00	3.74
35	300308	中际旭创	4,703,566.40	3.63
36	002714	牧原股份	4,584,116.20	3.54
37	002001	新和成	4,507,776.00	3.48
38	002422	科伦药业	4,463,851.92	3.45
39	600975	新五丰	4,285,080.45	3.31
40	600036	招商银行	4,270,862.63	3.30
41	601888	中国国旅	4,243,097.56	3.28
42	002458	益生股份	4,237,899.60	3.27
43	002202	金风科技	4,227,138.55	3.26
44	002583	海能达	4,123,884.09	3.18
45	601607	上海医药	4,061,653.00	3.14
46	002234	民和股份	3,894,028.70	3.01
47	603008	喜临门	3,846,595.61	2.97
48	600872	中炬高新	3,767,601.00	2.91
49	000858	五粮液	3,693,396.00	2.85
50	002912	中新赛克	3,585,585.60	2.77
51	600519	贵州茅台	3,540,037.12	2.73
52	300601	康泰生物	3,527,225.88	2.72
53	603986	兆易创新	3,522,534.19	2.72
54	601899	紫金矿业	3,486,005.56	2.69
55	002042	华孚时尚	3,358,001.36	2.59
56	603888	新华网	3,100,129.20	2.39

57	000732	泰禾集团	3,076,583.00	2.37
58	300661	圣邦股份	3,074,286.96	2.37
59	600958	东方证券	3,058,658.00	2.36
60	002124	天邦股份	3,055,520.00	2.36
61	002236	大华股份	3,042,559.00	2.35
62	002299	圣农发展	3,025,810.20	2.34
63	002739	万达电影	3,023,842.50	2.33
64	600690	海尔智家	3,023,816.62	2.33
65	300059	东方财富	3,002,777.44	2.32
66	600029	南方航空	2,984,141.96	2.30
67	601919	中远海控	2,938,124.00	2.27
68	300094	国联水产	2,936,449.00	2.27
69	601939	建设银行	2,933,170.00	2.26
70	601166	兴业银行	2,915,727.36	2.25
71	603363	傲农生物	2,897,342.95	2.24
72	600705	中航资本	2,892,087.00	2.23
73	300433	蓝思科技	2,883,397.60	2.23
74	300124	汇川技术	2,876,050.00	2.22
75	603806	福斯特	2,873,569.75	2.22
76	603517	绝味食品	2,868,434.00	2.21
77	300457	赢合科技	2,862,780.34	2.21
78	603816	顾家家居	2,850,112.00	2.20
79	600489	中金黄金	2,846,431.21	2.20
80	002241	歌尔股份	2,726,082.00	2.10
81	300373	扬杰科技	2,710,932.52	2.09
82	603337	杰克股份	2,672,818.40	2.06
83	002867	周大生	2,652,813.00	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	450,171,422.64
卖出股票收入(成交)总额	476,711,171.30

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）	416,694.50	0.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	416,694.50	0.30

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	910	93,566.20	0.07
2	110053	苏银转债	540	57,591.00	0.04
3	110057	现代转债	430	45,554.20	0.03
4	113026	核能转债	370	38,468.90	0.03
5	113025	明泰转债	370	36,951.90	0.03

7.7 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。

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	142,819.83
2	应收证券清算款	695,904.91
3	应收股利	-
4	应收利息	5,214.33
5	应收申购款	5,756.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	849,695.67

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 (%)
11,177	8,346.73	1,734,078.34	1.86	91,557,318.01	98.14

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	75,163.34	0.0806

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	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年9月8日） 基金份额总额	3,086,196,884.20
本报告期期初基金份额总额	107,391,044.41
本报告期基金总申购份额	6,104,209.90
减：本报告期基金总赎回份额	20,203,857.96
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	93,291,396.35

§ 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

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

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	272,131,452.43	29.39%	248,014.96	29.39%	-
东北证券	2	115,123,785.16	12.43%	104,917.24	12.43%	-
中信证券	2	104,918,723.77	11.33%	95,612.68	11.33%	-
国盛证券	1	86,797,484.05	9.37%	79,081.37	9.37%	-
华创证券	1	80,395,724.05	8.68%	73,282.72	8.68%	-
民生证券	1	73,148,550.12	7.90%	66,642.03	7.90%	-
银河证券	4	62,697,682.46	6.77%	57,131.99	6.77%	-
海通证券	1	46,145,164.25	4.98%	42,064.15	4.99%	-
西藏东财	1	32,715,852.52	3.53%	29,821.69	3.53%	-
华泰证券	1	23,113,827.88	2.50%	21,063.29	2.50%	-
广发证券	2	16,352,802.50	1.77%	14,907.01	1.77%	-
国泰君安	3	12,364,444.12	1.34%	11,270.21	1.34%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

注:1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序:

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。

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下:

本报告期内退租交易单元:无,

本报告期内新增交易单元:国泰君安。

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。

§ 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。

大成基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日