

大成沪深 300 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：中国农业银行股份有限公司

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.....	5
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遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46

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.....	46
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.....	46
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12	投资组合报告附注.....	46
§ 8	基金份额持有人信息.....	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	49
§ 9	开放式基金份额变动.....	49
§ 10	重大事件揭示.....	49
10.1	基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4	基金投资策略的改变.....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	52
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§ 12	备查文件目录.....	54
12.1	备查文件目录.....	54
12.2	存放地点.....	54
12.3	查阅方式.....	54

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	大成沪深 300 指数	
基金主代码	519300	
前端交易代码	519300	
后端交易代码	519301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,944,038,848.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	519300	007096
报告期末下属分级基金的份额总额	1,943,993,781.29 份	45,067.47 份

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，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

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	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		刘卓	周慕冰

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	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 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)	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
本期已实现收益	16,790,854.12	-67.20
本期利润	378,939,707.21	-386.57
加权平均基金份额本期利润	0.1986	-0.0158
本期加权平均净值利润率	20.21%	-1.58%
本期基金份额净值增长率	24.28%	3.19%

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	62,952,737.74	1,436.10
期末可供分配基金份额利润	0.0324	0.0319
期末基金资产净值	2,006,946,519.03	46,503.57
期末基金份额净值	1.0324	1.0319
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	198.07%	3.19%

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

2. 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。

4. 本基金于 2019 年 3 月 11 日起增设 C 类份额。

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

大成沪深 300 指数 A

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	5.15%	1.09%	5.39%	1.16%	-0.24%	-0.07%
过去三个月	-1.88%	1.43%	-1.21%	1.53%	-0.67%	-0.10%
过去六个月	24.28%	1.46%	27.07%	1.55%	-2.79%	-0.09%
过去一年	7.55%	1.43%	8.96%	1.53%	-1.41%	-0.10%
过去三年	20.42%	1.03%	21.30%	1.11%	-0.88%	-0.08%

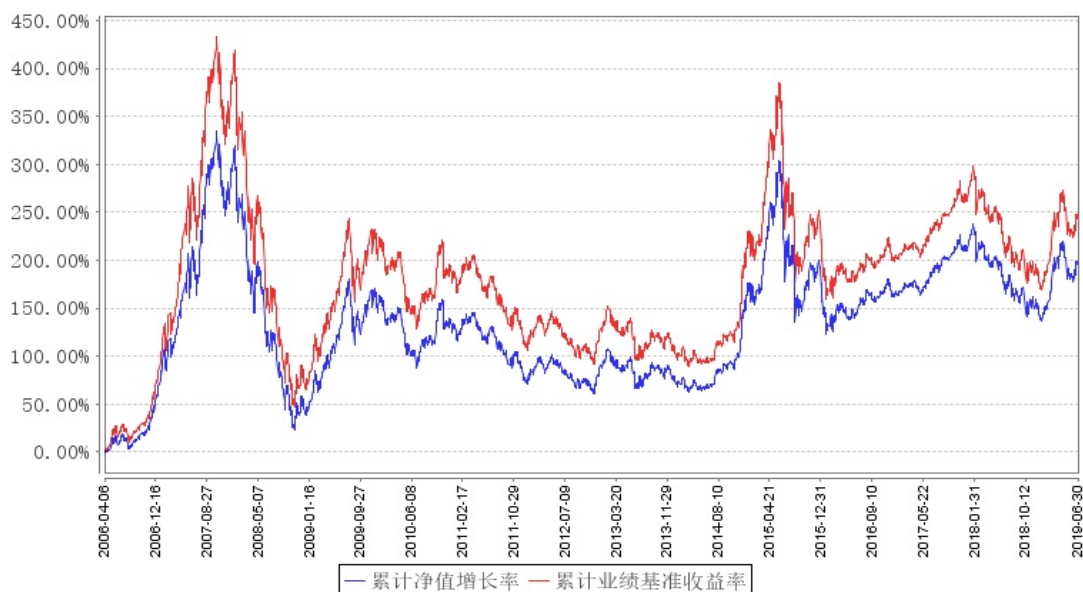
自基金合同生效起至今	198.07%	1.68%	246.76%	1.77%	-48.69%	-0.09%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	--------

大成沪深 300 指数 C

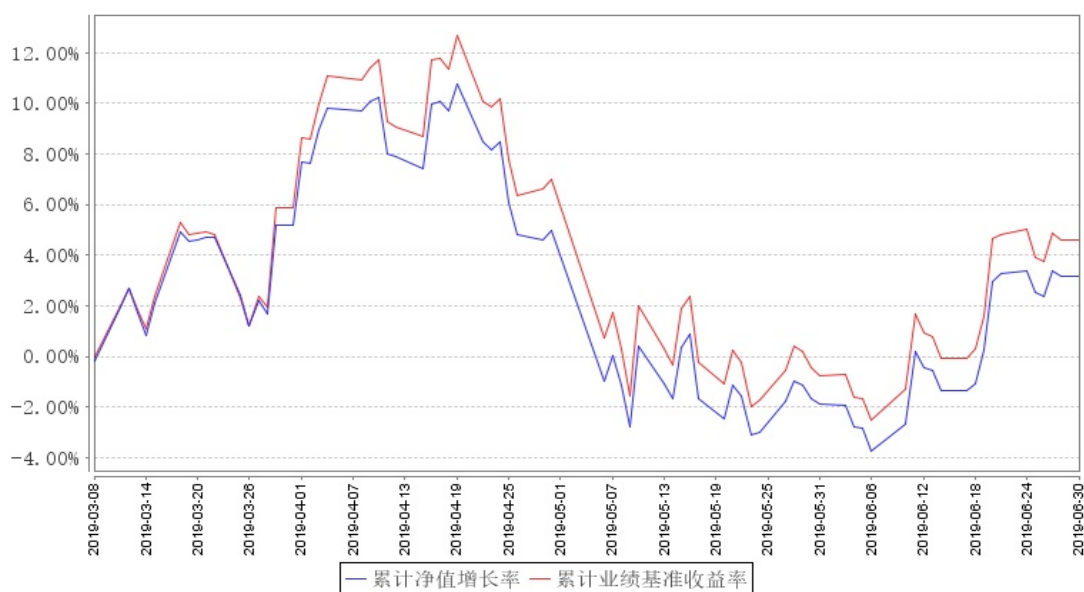
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.15%	1.09%	5.39%	1.16%	-0.24%	-0.07%
过去三个月	-1.90%	1.43%	-1.21%	1.53%	-0.69%	-0.10%
自基金合同生效起至今	3.19%	1.44%	4.59%	1.54%	-1.40%	-0.10%

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

大成沪深300指数A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



大成沪深300指数C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、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。

2、本基金于 2019 年 3 月 11 日起增设 C 类份额。

§ 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		
张钟玉	本基金基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	9 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理助理。2015 年 2 月 28 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金）。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监	2016 年 3 月 4 日	-	15 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理

					<p>助理，现任数量与指数投资部副总监。</p> <p>2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。</p> <p>2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。</p> <p>2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。</p> <p>2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起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 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型</p>
--	--	--	--	--	---

					证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒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，国内经济增长延续弱格局，二季度 GDP 同比增速 6.2%，较一季度小幅回落，创下了过去 27 年的新低。中美贸易摩擦进一步升级，加大了中美两国经济增长的不确定性，近期双方同意重启经贸磋商，美方表示不再对中国出口产品加征新的关税，贸易摩擦有缓和趋势。上半年 A 股在多因素影响下震荡上行，沪深 300 指数上涨 27.1%，创业板指上涨 20.9%。

报告期内本基金基本保持高仓位运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 1.0324 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.28%，同期业绩比较基准收益率为 27.07%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.0319 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.19%，同期业绩比较基准收益率为 4.59%。

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，国内政策侧重于供给侧改革，不会大规模放水，海外经济疲弱，贸易摩擦不断。国内经济增长多方面承压，经济增速预计进一步下行。但我们同时看到 A 股估值在全球来看已处于非常低的位置，受 MSCI 纳入 A 股权重加大等影响，外资长期稳定流入 A 股市场。近期支持企业持续经营发展的货币政策和税收政策不断出台，个人所得税调整增加居民收入刺激消费。有核心竞争力的行业龙头公司有望在经济下行中走出结构性行情。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

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的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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：大成沪深 300 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
资产：			
银行存款	6.4.3.1	33,395,202.68	16,120,421.72
结算备付金		-	1,179,923.53
存出保证金		126,643.96	123,996.90
交易性金融资产	6.4.3.2	1,975,749,017.52	1,579,951,358.10
其中：股票投资		1,895,781,017.52	1,499,751,358.10
基金投资		-	-
债券投资		79,968,000.00	80,200,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.3.5	974,688.41	2,699,184.16
应收股利		-	-
应收申购款		388,231.01	1,008,464.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,010,633,783.58	1,601,083,348.56
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		-	-
应付赎回款		1,648,318.17	304,499.47
应付管理人报酬		1,199,040.08	1,047,893.28
应付托管费		239,808.02	209,578.65
应付销售服务费		4.25	-
应付交易费用	6.4.3.7	429,772.17	603,525.97
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	123,818.29	331,170.16
负债合计		3,640,760.98	2,496,667.53
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	1,944,038,848.76	1,924,467,464.27
未分配利润	6.4.3.10	62,954,173.84	-325,880,783.24
所有者权益合计		2,006,993,022.60	1,598,586,681.03
负债和所有者权益总计		2,010,633,783.58	1,601,083,348.56

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,944,038,848.76 份，其中大成沪深 300 指数 A 基金份额总额为 1,943,993,781.29 份，基金份额净值 1.0324 元；大成沪深 300 指数 C 基金份额总额为 45,067.47 份，基金份额净值 1.0319 元。

6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 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		389,144,793.12	-201,125,925.75
1. 利息收入		1,334,248.27	1,484,748.20
其中：存款利息收入	6.4.3.11	187,859.23	340,419.43
债券利息收入		1,146,389.04	1,144,328.77
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		25,283,760.73	45,100,646.89

列)			
其中：股票投资收益	6.4.3.12	7,412,982.39	29,740,718.12
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-232,480.00	604,890.00
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	18,103,258.34	14,755,038.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	362,148,533.72	-247,768,662.45
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	378,250.40	57,341.61
减：二、费用		10,205,472.48	9,951,804.04
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	6,961,986.92	6,960,515.66
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,392,397.41	1,392,103.16
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	7.84	-
4. 交易费用	6.4.3.19	1,718,947.10	1,373,330.41
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	132,133.21	225,854.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		378,939,320.64	-211,077,729.79
减：所得税费用			
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		378,939,320.64	-211,077,729.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成沪深 300 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）	1,924,467,464.27	-325,880,783.24	1,598,586,681.03
二、本期经营活 动产生的基金净	-	378,939,320.64	378,939,320.64

值变动数（本期利润）			
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）	19,571,384.49	9,895,636.44	29,467,020.93
其中：1. 基金申购款	382,674,665.48	6,957,219.78	389,631,885.26
2. 基金赎回款	-363,103,280.99	2,938,416.66	-360,164,864.33
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）	1,944,038,848.76	62,954,173.84	2,006,993,022.60
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）	1,761,734,011.22	286,387,808.87	2,048,121,820.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-211,077,729.79	-211,077,729.79
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）	-17,822,117.35	-5,557,768.80	-23,379,886.15
其中：1. 基金申购款	162,630,077.96	14,822,483.29	177,452,561.25
2. 基金赎回款	-180,452,195.31	-20,380,252.09	-200,832,447.40
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	-	-139,683,717.59	-139,683,717.59

填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,743,911,893.87	-69,931,407.31	1,673,980,486.56

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	33,395,202.68
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	33,395,202.68

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	1,700,073,507.05	1,895,781,017.52	195,707,510.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	79,950,960.00	79,968,000.00
	合计	79,950,960.00	79,968,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,780,024,467.05	1,975,749,017.52	195,724,550.47

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	5,957.66
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	-
应收债券利息	968,679.45
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	51.30
合计	974,688.41

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	429,772.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	429,772.17

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	5,206.69
预提费用	118,611.60
合计	123,818.29

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成沪深 300 指数 A

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	1,924,467,464.27	1,924,467,464.27
本期申购	382,610,426.10	382,610,426.10
本期赎回(以“-”号填列)	-363,084,109.08	-363,084,109.08
本期末	1,943,993,781.29	1,943,993,781.29

大成沪深 300 指数 C

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	-	-
本期申购	64,239.38	64,239.38
本期赎回(以“-”号填列)	-19,171.91	-19,171.91
本期末	45,067.47	45,067.47

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

大成沪深 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	838,445,030.74	-1,164,325,813.98	-325,880,783.24
本期利润	16,790,854.12	362,148,853.09	378,939,707.21
本期基金份额 交易产生的 变动数	10,118,480.44	-224,666.67	9,893,813.77
其中：基金 申购款	168,763,250.99	-161,808,351.83	6,954,899.16
基金赎 回款	-158,644,770.55	161,583,685.16	2,938,914.61
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	865,354,365.30	-802,401,627.56	62,952,737.74
大成沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-67.20	-319.37	-386.57
本期基金份额 交易产生的变 动数	20,090.44	-18,267.77	1,822.67
其中：基金申 购款	28,551.47	-26,230.85	2,320.62
基金赎 回款	-8,461.03	7,963.08	-497.95
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	20,023.24	-18,587.14	1,436.10

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	177,569.74
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	9,378.32
其他	911.17
合计	187,859.23

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	564,945,261.53

减：卖出股票成本总额	557,532,279.14
买卖股票差价收入	7,412,982.39

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	83,280,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	80,232,480.00
减：应收利息总额	3,280,000.00
买卖债券差价收入	-232,480.00

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	18,103,258.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,103,258.34

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	362,148,533.72
股票投资	362,099,013.72
债券投资	49,520.00
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	362,148,533.72

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	378,250.40
合计	378,250.40

注：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。

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	1,718,597.10
银行间市场交易费用	350.00
合计	1,718,947.10

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	59,507.37
信息披露费	59,104.23
账户维护费	9,000.00
银行费用	4,521.61
合计	132,133.21

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
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	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。

6.4.6 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	795,061,761.70	68.92	497,757,875.52	56.33

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	724,540.92	68.92	206,540.86	48.06
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	453,583.15	56.32	210,935.20	65.10

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

手续费后的净额列示。

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	6,961,986.92	6,960,515.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,645,751.10	1,722,419.36

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 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.2 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	1,392,397.41	1,392,103.16

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 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	7.84	7.84
合计	-	7.84	7.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C	合计
大成基金	-	-	-
合计	-	-	-

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给大成基金,再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.10%。其计算公式为:

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.10%/当年天数。

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

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
中国农业银行	33,395,202.68	177,569.74	21,514,127.22	331,270.66

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

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

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7月12日	13.86	257,554	5,930,287.55	1,483,511.04	-

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。

6.4.8.3 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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：0.00%)。

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	79,968,000.00	-
合计	79,968,000.00	-

注：未评级部分为政策性金融债。

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》、《货币市场基金监督

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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、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，除在复制“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），均能够及时变现。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、结算备付金及债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2019 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	33,395,202.68	-	-	-	33,395,202.68
存出保证金	126,643.96	-	-	-	126,643.96
交易性金融资产	79,968,000.00	-	-	-1,895,781,017.52	1,975,749,017.52
应收利息	-	-	-	974,688.41	974,688.41
应收申购款	7,726.68	-	-	380,504.33	388,231.01
资产总计	113,497,573.32	-	-	-1,897,136,210.26	2,010,633,783.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,648,318.17	1,648,318.17
应付管理人报酬	-	-	-	1,199,040.08	1,199,040.08
应付托管费	-	-	-	239,808.02	239,808.02
应付销售服务费	-	-	-	4.25	4.25
应付交易费用	-	-	-	429,772.17	429,772.17
其他负债	-	-	-	123,818.29	123,818.29
负债总计	-	-	-	3,640,760.98	3,640,760.98
利率敏感度缺口	113,497,573.32	-	-	-1,893,495,449.28	2,006,993,022.60
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	16,120,421.72	-	-	-	16,120,421.72
结算备付金	1,179,923.53	-	-	-	1,179,923.53
存出保证金	123,996.90	-	-	-	123,996.90
交易性金融资产	80,200,000.00	-	-	-1,499,751,358.10	1,579,951,358.10
应收利息	-	-	-	2,699,184.16	2,699,184.16
应收申购款	17,206.03	-	-	991,258.12	1,008,464.15
资产总计	97,641,548.18	-	-	-1,503,441,800.38	1,601,083,348.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	304,499.47	304,499.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,047,893.28	1,047,893.28
应付托管费	-	-	-	209,578.65	209,578.65
应付交易费用	-	-	-	603,525.97	603,525.97
其他负债	-	-	-	331,170.16	331,170.16
负债总计	-	-	-	2,496,667.53	2,496,667.53
利率敏感度缺口	97,641,548.18	-	-	-1,500,945,132.85	1,598,586,681.03

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

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)

		月 30 日)	12 月 31 日)
	利率上升 25 个基点	-103,705.00	-40,000.00
	利率下降 25 个基点	103,979.00	40,000.00

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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	1,895,781,017.52	94.46	1,499,751,358.10	93.82
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	1,895,781,017.52	94.46	1,499,751,358.10	93.82

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%	93,940,000.00	73,760,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-93,940,000.00	-73,760,000.00

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	1,895,781,017.52	94.29
	其中：股票	1,895,781,017.52	94.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,968,000.00	3.98
	其中：债券	79,968,000.00	3.98
	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	33,395,202.68	1.66
8	其他各项资产	1,489,563.38	0.07
9	合计	2,010,633,783.58	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	19,846,230.05	0.99
B	采矿业	63,292,063.46	3.15

C	制造业	790,280,137.36	39.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,283,599.02	2.41
E	建筑业	60,251,871.64	3.00
F	批发和零售业	36,681,150.45	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	63,937,638.89	3.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,125,151.18	3.49
J	金融业	595,163,281.95	29.65
K	房地产业	89,723,119.58	4.47
L	租赁和商务服务业	29,403,362.67	1.47
M	科学研究和技术服务业	2,140,996.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	2,534,764.73	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,464,585.06	0.42
R	文化、体育和娱乐业	13,559,607.06	0.68
S	综合	-	-
	合计	1,893,687,559.10	94.35

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	0.02
C	制造业	1,633,446.87	0.08
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	-
J	金融业	33,869.94	-

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	-
S	综合	-	-
	合计	2,093,458.42	0.10

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	601318	中国平安	1,094,325	96,968,138.25	4.83
2	600519	贵州茅台	55,493	54,605,112.00	2.72
3	600036	招商银行	1,017,142	36,596,769.16	1.82
4	601328	交通银行	5,344,608	32,709,000.96	1.63
5	000858	五粮液	275,744	32,524,004.80	1.62
6	000651	格力电器	568,889	31,288,895.00	1.56
7	601988	中国银行	7,091,940	26,523,855.60	1.32
8	000333	美的集团	510,708	26,485,316.88	1.32
9	601166	兴业银行	1,279,115	23,395,013.35	1.17
10	600016	民生银行	3,469,772	22,033,052.20	1.10
11	600887	伊利股份	629,206	21,021,772.46	1.05
12	600030	中信证券	817,632	19,467,817.92	0.97
13	600015	华夏银行	2,356,663	18,146,305.10	0.90
14	600276	恒瑞医药	268,123	17,696,118.00	0.88
15	601601	中国太保	472,893	17,265,323.43	0.86
16	601668	中国建筑	2,923,394	16,809,515.50	0.84
17	300498	温氏股份	417,703	14,978,829.58	0.75
18	600000	浦发银行	1,250,128	14,601,495.04	0.73
19	601398	工商银行	2,441,418	14,379,952.02	0.72

20	000001	平安银行	1,041,718	14,354,874.04	0.72
21	601939	建设银行	1,899,962	14,135,717.28	0.70
22	000002	万科A	502,319	13,969,491.39	0.70
23	600900	长江电力	707,062	12,656,409.80	0.63
24	600837	海通证券	888,393	12,606,296.67	0.63
25	600585	海螺水泥	299,468	12,427,922.00	0.62
26	002475	立讯精密	494,519	12,259,126.01	0.61
27	600919	江苏银行	1,665,300	12,090,078.00	0.60
28	601888	中国国旅	135,675	12,027,588.75	0.60
29	000338	潍柴动力	974,592	11,977,735.68	0.60
30	601169	北京银行	2,006,380	11,857,705.80	0.59
31	600809	山西汾酒	170,700	11,786,835.00	0.59
32	000568	泸州老窖	144,400	11,671,852.00	0.58
33	603288	海天味业	111,000	11,655,000.00	0.58
34	000100	TCL 集团	3,495,722	11,640,754.26	0.58
35	600031	三一重工	884,006	11,562,798.48	0.58
36	002304	洋河股份	94,415	11,477,087.40	0.57
37	601688	华泰证券	513,175	11,454,066.00	0.57
38	601009	南京银行	1,384,479	11,435,796.54	0.57
39	600999	招商证券	633,754	10,830,855.86	0.54
40	002415	海康威视	385,442	10,630,490.36	0.53
41	600104	上汽集团	408,943	10,428,046.50	0.52
42	601555	东吴证券	1,011,848	10,371,442.00	0.52
43	600048	保利地产	775,887	9,900,318.12	0.49
44	600009	上海机场	116,079	9,725,098.62	0.48
45	603156	养元饮品	261,451	9,694,603.08	0.48
46	600050	中国联通	1,565,336	9,642,469.76	0.48
47	002007	华兰生物	314,827	9,599,075.23	0.48
48	601336	新华保险	174,325	9,593,104.75	0.48
49	601211	国泰君安	520,739	9,555,560.65	0.48
50	600028	中国石化	1,743,169	9,535,134.43	0.48
51	600690	海尔智家	548,934	9,491,068.86	0.47
52	000063	中兴通讯	286,120	9,307,483.60	0.46
53	002736	国信证券	692,500	9,113,300.00	0.45
54	000725	京东方A	2,644,263	9,096,264.72	0.45
55	601766	中国中车	1,064,704	8,613,455.36	0.43
56	600170	上海建工	2,236,879	8,410,665.04	0.42
57	601229	上海银行	688,186	8,155,004.10	0.41
58	002142	宁波银行	332,678	8,064,114.72	0.40
59	600109	国金证券	823,680	8,006,169.60	0.40
60	600926	杭州银行	954,948	7,954,716.84	0.40
61	601006	大秦铁路	978,757	7,918,144.13	0.39

62	600570	恒生电子	114,642	7,812,852.30	0.39
63	601881	中国银河	637,775	7,812,743.75	0.39
64	600606	绿地控股	1,141,594	7,797,087.02	0.39
65	601628	中国人寿	273,233	7,737,958.56	0.39
66	603160	汇顶科技	55,601	7,717,418.80	0.38
67	000157	中联重科	1,260,957	7,578,351.57	0.38
68	600309	万华化学	176,314	7,544,476.06	0.38
69	000895	双汇发展	298,519	7,430,137.91	0.37
70	601989	中国重工	1,309,695	7,281,904.20	0.36
71	600886	国投电力	932,990	7,249,332.30	0.36
72	601012	隆基股份	312,200	7,214,942.00	0.36
73	600340	华夏幸福	219,620	7,153,023.40	0.36
74	601155	新城控股	179,120	7,130,767.20	0.36
75	601857	中国石油	1,001,456	6,890,017.28	0.34
76	002032	苏泊尔	90,700	6,877,781.00	0.34
77	300059	东方财富	506,833	6,867,587.15	0.34
78	000961	中南建设	779,900	6,753,934.00	0.34
79	600019	宝钢股份	1,028,252	6,683,638.00	0.33
80	002202	金风科技	536,659	6,670,671.37	0.33
81	600522	中天科技	726,350	6,660,629.50	0.33
82	600111	北方稀土	514,954	6,612,009.36	0.33
83	002024	苏宁易购	573,825	6,587,511.00	0.33
84	601838	成都银行	745,700	6,584,531.00	0.33
85	000963	华东医药	250,910	6,513,623.60	0.32
86	001979	招商蛇口	304,279	6,359,431.10	0.32
87	002230	科大讯飞	191,174	6,354,623.76	0.32
88	000876	新希望	365,458	6,348,005.46	0.32
89	601901	方正证券	877,911	6,241,947.21	0.31
90	300122	智飞生物	143,989	6,205,925.90	0.31
91	002594	比亚迪	122,041	6,189,919.52	0.31
92	000661	长春高新	18,300	6,185,400.00	0.31
93	600025	华能水电	1,490,342	6,065,691.94	0.30
94	000415	渤海租赁	1,540,996	6,040,704.32	0.30
95	002311	海大集团	193,300	5,972,970.00	0.30
96	600383	金地集团	495,800	5,914,894.00	0.29
97	600352	浙江龙盛	374,974	5,913,339.98	0.29
98	002271	东方雨虹	260,300	5,898,398.00	0.29
99	601390	中国中铁	890,545	5,806,353.40	0.29
100	600011	华能国际	930,500	5,797,015.00	0.29
101	601877	正泰电器	250,611	5,786,607.99	0.29
102	600438	通威股份	410,600	5,773,036.00	0.29
103	601111	中国国航	599,699	5,739,119.43	0.29

104	601899	紫金矿业	1,513,299	5,705,137.23	0.28
105	601933	永辉超市	558,174	5,698,956.54	0.28
106	000425	徐工机械	1,270,546	5,666,635.16	0.28
107	000776	广发证券	409,902	5,632,053.48	0.28
108	600436	片仔癀	48,711	5,611,507.20	0.28
109	000783	长江证券	717,232	5,601,581.92	0.28
110	601088	中国神华	270,446	5,511,689.48	0.27
111	601186	中国铁建	552,853	5,500,887.35	0.27
112	000413	东旭光电	1,043,100	5,361,534.00	0.27
113	000538	云南白药	63,926	5,332,706.92	0.27
114	600362	江西铜业	338,615	5,329,800.10	0.27
115	600958	东方证券	495,100	5,287,668.00	0.26
116	600741	华域汽车	243,855	5,267,268.00	0.26
117	300015	爱尔眼科	169,578	5,251,830.66	0.26
118	600010	宝钢股份	3,096,256	5,232,672.64	0.26
119	300144	宋城演艺	225,237	5,211,984.18	0.26
120	000166	申万宏源	1,038,310	5,201,933.10	0.26
121	600547	山东黄金	126,050	5,189,478.50	0.26
122	300142	沃森生物	182,300	5,170,028.00	0.26
123	600637	东方明珠	482,280	5,083,231.20	0.25
124	600660	福耀玻璃	221,184	5,027,512.32	0.25
125	600339	中油工程	1,183,300	4,993,526.00	0.25
126	002146	荣盛发展	531,515	4,990,925.85	0.25
127	600489	中金黄金	475,484	4,883,220.68	0.24
128	601225	陕西煤业	528,408	4,882,489.92	0.24
129	002714	牧原股份	82,793	4,867,400.47	0.24
130	002027	分众传媒	912,068	4,824,839.72	0.24
131	002179	中航光电	143,910	4,815,228.60	0.24
132	601377	兴业证券	709,961	4,785,137.14	0.24
133	600705	中航资本	880,458	4,772,082.36	0.24
134	600498	烽火通信	168,978	4,707,727.08	0.23
135	600588	用友网络	172,624	4,640,133.12	0.23
136	600177	雅戈尔	729,355	4,631,404.25	0.23
137	601607	上海医药	253,137	4,594,436.55	0.23
138	601669	中国电建	861,446	4,557,049.34	0.23
139	002001	新和成	236,060	4,553,597.40	0.23
140	300003	乐普医疗	197,317	4,542,237.34	0.23
141	600153	建发股份	501,847	4,456,401.36	0.22
142	600406	国电南瑞	237,942	4,435,238.88	0.22
143	601117	中国化学	730,300	4,396,406.00	0.22
144	600398	海澜之家	475,713	4,314,716.91	0.21
145	600795	国电电力	1,651,305	4,194,314.70	0.21

146	000069	华侨城 A	594,929	4,134,756.55	0.21
147	601600	中国铝业	1,041,643	4,083,240.56	0.20
148	600038	中直股份	98,924	4,057,862.48	0.20
149	600089	特变电工	555,826	4,029,738.50	0.20
150	601727	上海电气	748,900	4,029,082.00	0.20
151	600703	三安光电	356,802	4,024,726.56	0.20
152	002602	世纪华通	367,904	4,017,511.68	0.20
153	000627	天茂集团	612,789	3,977,000.61	0.20
154	300033	同花顺	40,300	3,963,908.00	0.20
155	000938	紫光股份	144,468	3,936,753.00	0.20
156	000786	北新建材	213,800	3,876,194.00	0.19
157	601800	中国交建	341,488	3,865,644.16	0.19
158	002008	大族激光	112,246	3,859,017.48	0.19
159	002422	科伦药业	128,800	3,829,224.00	0.19
160	600196	复星医药	151,301	3,827,915.30	0.19
161	603858	步长制药	148,350	3,822,979.50	0.19
162	600332	白云山	92,933	3,807,465.01	0.19
163	002236	大华股份	260,949	3,788,979.48	0.19
164	600977	中国电影	241,878	3,787,809.48	0.19
165	603993	洛阳钼业	953,744	3,776,826.24	0.19
166	601919	中远海控	746,670	3,748,283.40	0.19
167	600188	兖州煤业	344,730	3,747,215.10	0.19
168	600271	航天信息	162,150	3,737,557.50	0.19
169	601985	中国核电	670,310	3,726,923.60	0.19
170	000709	河钢股份	1,245,141	3,722,971.59	0.19
171	600029	南方航空	477,240	3,684,292.80	0.18
172	600487	亨通光电	218,840	3,667,758.40	0.18
173	300136	信维通信	148,951	3,641,851.95	0.18
174	601998	中信银行	597,784	3,568,770.48	0.18
175	300124	汇川技术	155,500	3,562,505.00	0.18
176	000768	中航飞机	225,188	3,546,711.00	0.18
177	300408	三环集团	181,632	3,532,742.40	0.18
178	600219	南山铝业	1,555,590	3,515,633.40	0.18
179	600221	海航控股	1,729,221	3,510,318.63	0.17
180	600115	东方航空	557,520	3,495,650.40	0.17
181	002456	欧菲光	444,180	3,482,371.20	0.17
182	002508	老板电器	127,800	3,468,492.00	0.17
183	600004	白云机场	189,400	3,447,080.00	0.17
184	600233	圆通速递	278,800	3,437,604.00	0.17
185	002673	西部证券	336,783	3,394,772.64	0.17
186	600867	通化东宝	219,500	3,380,300.00	0.17
187	601198	东兴证券	284,100	3,375,108.00	0.17

188	002241	歌尔股份	375,982	3,342,479.98	0.17
189	600018	上港集团	487,547	3,325,070.54	0.17
190	600998	九州通	268,900	3,323,604.00	0.17
191	600023	浙能电力	748,474	3,308,255.08	0.16
192	600100	同方股份	363,363	3,288,435.15	0.16
193	002352	顺丰控股	96,700	3,283,932.00	0.16
194	000728	国元证券	357,222	3,275,725.74	0.16
195	601997	贵阳银行	378,434	3,273,454.10	0.16
196	600893	航发动力	143,809	3,265,902.39	0.16
197	603833	欧派家居	30,118	3,241,299.16	0.16
198	600583	海油工程	577,086	3,231,681.60	0.16
199	002044	美年健康	258,260	3,212,754.40	0.16
200	600390	五矿资本	338,915	3,195,968.45	0.16
201	000402	金融街	402,538	3,155,897.92	0.16
202	600482	中国动力	132,355	3,126,225.10	0.16
203	000703	恒逸石化	226,800	3,098,088.00	0.15
204	002050	三花智控	292,838	3,089,440.90	0.15
205	601618	中国中冶	1,014,138	3,082,979.52	0.15
206	601018	宁波港	701,302	3,078,715.78	0.15
207	600176	中国巨石	320,400	3,053,412.00	0.15
208	000630	铜陵有色	1,232,535	3,032,036.10	0.15
209	600068	葛洲坝	485,897	3,027,138.31	0.15
210	601360	三六零	141,305	3,021,100.90	0.15
211	600369	西南证券	599,492	2,961,490.48	0.15
212	600816	安信信托	584,561	2,952,033.05	0.15
213	600297	广汇汽车	660,500	2,945,830.00	0.15
214	600516	方大炭素	239,434	2,942,643.86	0.15
215	600760	中航沈飞	101,254	2,939,403.62	0.15
216	002460	赣锋锂业	124,350	2,913,520.50	0.15
217	600674	川投能源	326,224	2,903,393.60	0.14
218	600066	宇通客车	221,974	2,890,101.48	0.14
219	002081	金螳螂	280,042	2,887,233.02	0.14
220	601878	浙商证券	309,600	2,879,280.00	0.14
221	300017	网宿科技	266,279	2,870,487.62	0.14
222	002065	东华软件	401,654	2,807,561.46	0.14
223	002555	三七互娱	206,929	2,803,887.95	0.14
224	000423	东阿阿胶	70,383	2,802,651.06	0.14
225	600118	中国卫星	123,068	2,775,183.40	0.14
226	603260	合盛硅业	58,627	2,758,986.62	0.14
227	002493	荣盛石化	226,300	2,729,178.00	0.14
228	601898	中煤能源	567,100	2,722,080.00	0.14
229	601828	美凯龙	223,500	2,715,525.00	0.14

230	601066	中信建投	128,500	2,708,780.00	0.13
231	600061	国投资本	193,300	2,708,133.00	0.13
232	002153	石基信息	74,723	2,704,225.37	0.13
233	601992	金隅集团	719,000	2,703,440.00	0.13
234	600085	同仁堂	92,887	2,693,723.00	0.13
235	600415	小商品城	653,474	2,692,312.88	0.13
236	002625	光启技术	288,880	2,683,695.20	0.13
237	002466	天齐锂业	105,015	2,654,779.20	0.13
238	300024	机器人	171,846	2,617,214.58	0.13
239	601138	工业富联	214,500	2,584,725.00	0.13
240	600704	物产中大	472,470	2,560,787.40	0.13
241	601021	春秋航空	56,462	2,540,790.00	0.13
242	300070	碧水源	325,387	2,534,764.73	0.13
243	600566	济川药业	83,032	2,500,093.52	0.12
244	002410	广联达	75,900	2,496,351.00	0.12
245	600208	新湖中宝	794,845	2,495,813.30	0.12
246	603019	中科曙光	70,800	2,485,080.00	0.12
247	600346	恒力石化	204,260	2,483,801.60	0.12
248	002252	上海莱士	355,678	2,471,962.10	0.12
249	603986	兆易创新	28,300	2,453,610.00	0.12
250	002120	韵达股份	79,508	2,450,436.56	0.12
251	601633	长城汽车	292,698	2,420,612.46	0.12
252	300296	利亚德	308,900	2,418,687.00	0.12
253	600535	天士力	144,850	2,397,267.50	0.12
254	600027	华电国际	631,900	2,382,263.00	0.12
255	600688	上海石化	457,966	2,363,104.56	0.12
256	000671	阳光城	363,726	2,356,944.48	0.12
257	000898	鞍钢股份	620,100	2,350,179.00	0.12
258	002558	巨人网络	128,404	2,333,100.68	0.12
259	002624	完美世界	88,663	2,288,392.03	0.11
260	000625	长安汽车	341,000	2,260,830.00	0.11
261	601808	中海油服	230,900	2,223,567.00	0.11
262	002468	申通快递	88,740	2,213,175.60	0.11
263	601108	财通证券	200,400	2,200,392.00	0.11
264	601238	广汽集团	199,880	2,184,688.40	0.11
265	601216	君正集团	653,832	2,151,107.28	0.11
266	603259	药明康德	24,700	2,140,996.00	0.11
267	002601	龙蟠佰利	140,518	2,083,881.94	0.10
268	603799	华友钴业	96,554	2,057,565.74	0.10
269	002294	信立泰	91,300	2,043,294.00	0.10
270	601212	白银有色	453,100	1,989,109.00	0.10
271	300433	蓝思科技	280,326	1,953,872.22	0.10

272	000408	藏格控股	236,200	1,953,374.00	0.10
273	300072	三聚环保	243,130	1,928,020.90	0.10
274	002310	东方园林	318,000	1,908,000.00	0.10
275	601228	广州港	450,400	1,882,672.00	0.09
276	000553	安道麦 A	174,900	1,874,928.00	0.09
277	300251	光线传媒	275,418	1,872,842.40	0.09
278	600372	中航电子	125,242	1,858,591.28	0.09
279	002411	延安必康	100,762	1,753,258.80	0.09
280	002739	万达电影	93,400	1,722,296.00	0.09
281	002773	康弘药业	51,090	1,681,882.80	0.08
282	000629	攀钢钒钛	482,500	1,635,675.00	0.08
283	600663	陆家嘴	98,828	1,531,834.00	0.08
284	002925	盈趣科技	39,200	1,529,192.00	0.08
285	000596	古井贡酒	12,900	1,528,779.00	0.08
286	000656	金科股份	239,900	1,446,597.00	0.07
287	601319	中国人保	119,600	1,135,004.00	0.06
288	002010	传化智联	146,400	1,102,392.00	0.05
289	300413	芒果超媒	23,500	964,675.00	0.05
290	002938	鹏鼎控股	28,600	839,696.00	0.04
291	002939	长城证券	38,300	639,227.00	0.03
292	601162	天风证券	58,200	630,888.00	0.03
293	002945	华林证券	30,300	560,550.00	0.03
294	601298	青岛港	54,500	457,255.00	0.02
295	601577	长沙银行	42,300	403,542.00	0.02
296	600733	北汽蓝谷	47,100	389,046.00	0.02
297	600299	安迪苏	33,100	343,247.00	0.02

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	600485	*ST 信威	257,554	1,483,511.04	0.07
2	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
3	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
4	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
5	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
6	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
7	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
8	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	300498	温氏股份	16,202,969.25	1.01
2	601318	中国平安	13,012,601.00	0.81
3	601328	交通银行	12,861,633.00	0.80
4	600519	贵州茅台	12,168,150.00	0.76
5	600015	华夏银行	9,725,238.64	0.61
6	603156	养元饮品	9,655,805.06	0.60
7	000100	TCL 集团	8,376,718.00	0.52
8	601555	东吴证券	7,902,439.00	0.49
9	601668	中国建筑	6,241,512.00	0.39
10	600999	招商证券	5,982,170.00	0.37
11	600170	上海建工	5,698,230.14	0.36
12	600016	民生银行	5,459,941.00	0.34
13	600109	国金证券	5,428,326.00	0.34
14	002007	华兰生物	5,294,871.00	0.33
15	601988	中国银行	5,192,581.50	0.32
16	000338	潍柴动力	5,099,647.06	0.32
17	603160	汇顶科技	5,082,144.00	0.32
18	601881	中国银河	4,980,116.54	0.31
19	002736	国信证券	4,969,558.00	0.31
20	000333	美的集团	4,936,665.00	0.31

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	601318	中国平安	19,437,551.16	1.22
2	601328	交通银行	12,077,457.00	0.76
3	000568	泸州老窖	10,643,829.34	0.67
4	600739	辽宁成大	9,219,905.64	0.58
5	600519	贵州茅台	8,225,629.00	0.51
6	000333	美的集团	8,003,090.00	0.50
7	000001	平安银行	7,531,307.60	0.47
8	601998	中信银行	6,614,398.00	0.41
9	000858	五粮液	6,146,461.00	0.38
10	600036	招商银行	6,063,288.56	0.38
11	601988	中国银行	5,893,024.00	0.37
12	601611	中国核建	5,835,951.76	0.37
13	601992	金隅集团	5,722,596.00	0.36
14	001979	招商蛇口	5,646,309.00	0.35
15	600390	五矿资本	5,527,128.53	0.35
16	600016	民生银行	5,508,729.00	0.34

17	600909	华安证券	5,417,850.00	0.34
18	601117	中国化学	5,391,138.77	0.34
19	601601	中国太保	5,342,578.00	0.33
20	000651	格力电器	5,321,942.00	0.33

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	591,462,924.84
卖出股票收入(成交)总额	564,945,261.53

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	79,968,000.00	3.98
	其中:政策性金融债	79,968,000.00	3.98
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	79,968,000.00	3.98

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	800,000	79,968,000.00	3.98

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**

1、本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328.SH）的发行主体交通银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018）1 号），于 2018 年 11 月 9 日因不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）12 号、银保监银罚决字（2018）13 号）。交通银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2、本基金投资的前十名证券之一民生银行（600016.SH）的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因贷款业务严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字（2018）5 号、银保监银罚决字（2018）8 号）。民生银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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	126,643.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	974,688.41
5	应收申购款	388,231.01

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,489,563.38

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	600485	*ST 信威	1,483,511.04	0.07	重大事项停牌

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

份额级别	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 (%)
大成沪深 300 指数 A	117,306	16,571.99	197,892,100.92	10.18	1,746,101,680.37	89.82
大成	8	5,633.43	-	-	45,067.47	100.00

沪 深 300 指 数 C						
合 计	117,314	16,571.24	197,892,100.92	10.18	1,746,146,747.84	89.82

注:1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	大成沪深 300 指数 A	73,018.51	0.0038
	大成沪深 300 指数 C	9.63	0.0214
	合计	73,028.14	0.0038

注:上述占基金总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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	份额级别	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	大成沪深 300 指数 A	0~10
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成沪深 300 指数 A	0
	大成沪深 300 指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
----	---------------	---------------

基金合同生效日 (2006 年 4 月 6 日) 基金份额总额	1,813,356,066.47	-
本报告期期初基金份 额总额	1,924,467,464.27	-
本报告期基金总申购 份额	382,610,426.10	64,239.38
减:本报告期基金总 赎回份额	363,084,109.08	19,171.91
本报告期基金拆分变 动份额(份额减少以 “-”填列)	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,943,993,781.29	45,067.47

§ 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

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	795,061,761.70	68.92%	724,540.92	68.92%	-
中信证券	2	165,930,753.23	14.38%	151,212.22	14.38%	-
中国银河证券	4	101,637,347.20	8.81%	92,623.36	8.81%	-
中信建投证券	2	50,125,571.64	4.35%	45,679.91	4.35%	-
中金公司	3	38,802,517.62	3.36%	35,361.68	3.36%	-
中泰证券	1	2,073,111.50	0.18%	1,889.38	0.18%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

- (1) 财务状况良好,最近一年无重大违规行为;
- (2) 经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;
- (3) 研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;
- (4) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;
- (6) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金专用席位。本报告期内本基金退租的交易单元:无,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。

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上海万得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	2019-06-14
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买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	2019-06-10
5	大成沪深 300 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	2019-05-21

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
8	大成沪深 300 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
9	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-12
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	大成沪深 300 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	关于大成沪深 300 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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-08
15	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-02-02
16	大成沪深 300 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
17	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沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 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