

# 大成产业升级股票型证券投资基金(LOF) 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。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成产业升级股票 (LOF)
场内简称	大成产业
基金主代码	160919
交易代码	160919
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2014 年 12 月 26 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	165,116,888.34 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 1 月 9 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于与产业升级主题相关的行业和企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。

### 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	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

### 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	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	32,355,502.14
本期利润	46,057,442.49
加权平均基金份额本期利润	0.2729
本期基金份额净值增长率	28.06%
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	0.2144
期末基金资产净值	200,522,941.19
期末基金份额净值	1.214

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.22%	1.32%	4.42%	0.93%	-5.64%	0.39%
过去三个月	-5.16%	1.71%	-0.72%	1.22%	-4.44%	0.49%
过去六个月	28.06%	1.62%	21.89%	1.24%	6.17%	0.38%
过去一年	6.40%	1.53%	8.87%	1.22%	-2.47%	0.31%
过去三年	8.98%	1.25%	20.08%	0.89%	11.10%	0.36%
自基金合同生效起至今	15.34%	1.94%	18.86%	1.28%	-3.52%	0.66%

### 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

大成产业升级股票(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金于2014年12月26日转型,按基金合同规定,基金管理人应当自基金转型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		
李林益	本基金基金经理	2015年7月7日	-	8年	工学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理。2015年7月7日起任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年9月12日起任大成价值增长证券投资基金基金经理。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

过去的半年是发生深刻变化的半年。

面对纷繁的内外部环境，宏观面显现了足够的定力与自我革命的精神，宏观政策导向趋于显性、应对趋于理性，及时化解了一系列风险。各项改革正逐次展开，切入点虽微小，却足以牵一发而动全身。

产业层面，供给侧改革在钢铁、煤炭领域取得成功后，正在各行各业逐次展开。行业的导向、运作范式正经历历史性变革。

公司层面，我们可喜的看到，一大批具备核心竞争力的民营企业，在新一波的时代潮流中由之前的静观其变，转变为踏浪前行。

在深刻变化的背景中，本着抬头看天防下雨，低头看路捡黄金的思路，对重点个股、行业进行了深入研究，取得了相对较好的回报。

##### 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 1.214 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.06%，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

时代的潮流一旦形成，将浩浩荡荡。未来的 3 到 5 年依然趋势不改。落实到下半年，重点关注结构性机会、继续深挖板块和个股。

#### 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：大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)

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
<b>资产：</b>		
银行存款	18,219,372.46	22,085,018.46
结算备付金	1,387,890.91	1,238,777.42
存出保证金	263,047.82	239,113.36
交易性金融资产	182,924,530.44	135,551,974.45
其中：股票投资	178,732,365.94	135,551,974.45
基金投资	-	-
债券投资	4,192,164.50	-
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	-	6,916,311.06
应收利息	7,116.44	5,060.73
应收股利	-	-
应收申购款	1,588.99	197.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	202,803,547.06	166,036,453.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	79,445.27	-
应付管理人报酬	244,202.91	211,364.75
应付托管费	40,700.48	35,227.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	799,051.51	1,015,014.62
应交税费	40.12	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,117,165.58	1,263,513.38
负债合计	2,280,605.87	2,525,120.21
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	165,116,888.34	172,496,107.00
未分配利润	35,406,052.85	-8,984,774.10
所有者权益合计	200,522,941.19	163,511,332.90
负债和所有者权益总计	202,803,547.06	166,036,453.11

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.214 元，基金份额总额 165,116,888.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)

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	50,656,975.03	-11,107,557.45
1. 利息收入	113,474.95	121,900.44
其中：存款利息收入	101,435.60	121,900.44
债券利息收入	3,203.73	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,835.62	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填	36,781,855.64	5,539,314.90

列)		
其中：股票投资收益	35,359,134.61	4,653,300.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	282,063.89	-
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	1,140,657.14	886,014.65
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	13,701,940.35	-16,822,816.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	59,704.09	54,043.29
减：二、费用	4,599,532.54	5,484,271.32
1. 管理人报酬	1,454,700.77	1,635,301.51
2. 托管费	242,450.10	272,550.19
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,764,293.45	3,343,942.59
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支 出	-	-
6. 税金及附加	11.52	-
7. 其他费用	138,076.70	232,477.03
三、利润总额（亏损总额以“- ”号填列）	46,057,442.49	-16,591,828.77
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）	46,057,442.49	-16,591,828.77

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)

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）	172,496,107.00	-8,984,774.10	163,511,332.90
二、本期经营活 动产生的基金净	-	46,057,442.49	46,057,442.49

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)	-7,379,218.66	-1,666,615.54	-9,045,834.20
其中: 1. 基金申购款	2,077,641.07	461,001.09	2,538,642.16
2. 基金赎回款	-9,456,859.73	-2,127,616.63	-11,584,476.36
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)	165,116,888.34	35,406,052.85	200,522,941.19
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)	186,911,538.94	43,826,752.83	230,738,291.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-16,591,828.77	-16,591,828.77
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)	-8,215,235.24	-2,001,277.94	-10,216,513.18
其中: 1. 基金申购款	869,933.44	139,740.34	1,009,673.78
2. 基金赎回款	-9,085,168.68	-2,141,018.28	-11,226,186.96
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)	178,696,303.70	25,233,646.12	203,929,949.82

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>周立新</u>	<u>刘亚林</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.3 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  
无。

#### 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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.4 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	199,880,077.25	10.86	62,658,002.30	2.82

## 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	182,148.45	10.86	131,147.21	16.41
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	57,101.04	2.82	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.4.2 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	1,454,700.77	1,635,301.51
其中：支付销售机构的客户维护 费	27,534.10	27,088.61

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

#### 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	242,450.10	272,550.19

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019年6月30日		2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
光大证券股份有限公司	300.00	0.00	300.00	0.00

##### 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	18,219,372.46	84,553.97	33,954,845.02	101,492.90

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

无。

##### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	178,732,365.94	88.13
	其中：股票	178,732,365.94	88.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,192,164.50	2.07
	其中：债券	4,192,164.50	2.07
	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	19,607,263.37	9.67
8	其他各项资产	271,753.25	0.13
9	合计	202,803,547.06	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	32,238,407.34	16.08
B	采矿业	5,664,780.39	2.83
C	制造业	107,183,519.02	53.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,481,142.24	3.23
F	批发和零售业	65,344.00	0.03
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	7,910,466.32	3.94
J	金融业	13,494,382.94	6.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,671,217.09	2.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	178,732,365.94	89.13

## 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	002311	海大集团	521,229	16,105,976.10	8.03
2	603517	绝味食品	409,080	15,917,302.80	7.94
3	002714	牧原股份	265,592	15,614,153.68	7.79
4	000876	新希望	828,002	14,382,394.74	7.17
5	600332	白云山	279,200	11,438,824.00	5.70
6	300498	温氏股份	253,131	9,077,277.66	4.53
7	002179	中航光电	269,750	9,025,835.00	4.50
8	002916	深南电路	86,040	8,769,196.80	4.37
9	300699	光威复材	242,197	7,919,841.90	3.95
10	300770	新媒股份	90,500	7,828,250.00	3.90

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	002567	唐人神	36,589,014.22	22.38
2	002714	牧原股份	33,005,994.12	20.19
3	002124	天邦股份	32,750,820.00	20.03
4	002916	深南电路	32,303,616.79	19.76
5	300498	温氏股份	31,203,582.57	19.08
6	000876	新希望	30,888,665.95	18.89
7	300033	同花顺	27,194,545.00	16.63
8	002311	海大集团	23,826,816.53	14.57
9	002032	苏泊尔	22,508,856.07	13.77
10	002179	中航光电	19,277,508.91	11.79
11	300761	立华股份	17,673,181.85	10.81
12	000568	泸州老窖	17,428,003.20	10.66
13	601888	中国国旅	17,290,061.01	10.57
14	300699	光威复材	16,977,492.78	10.38
15	600837	海通证券	16,610,947.00	10.16

## 大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告摘要

16	603517	绝味食品	16,418,240.40	10.04
17	002415	海康威视	14,971,429.15	9.16
18	601688	华泰证券	13,599,611.00	8.32
19	000538	云南白药	13,019,683.00	7.96
20	600990	四创电子	12,957,590.00	7.92
21	002414	高德红外	12,240,171.00	7.49
22	300059	东方财富	12,194,254.13	7.46
23	300679	电连技术	12,015,387.62	7.35
24	600332	白云山	11,196,154.00	6.85
25	600073	上海梅林	10,976,661.60	6.71
26	000702	正虹科技	9,981,340.60	6.10
27	300687	赛意信息	9,964,764.40	6.09
28	600547	山东黄金	9,385,592.40	5.74
29	600030	中信证券	9,270,070.00	5.67
30	300487	蓝晓科技	9,142,043.00	5.59
31	000895	双汇发展	8,831,310.64	5.40
32	603486	科沃斯	8,779,139.00	5.37
33	000089	深圳机场	8,749,897.00	5.35
34	603444	吉比特	8,610,283.63	5.27
35	600548	深高速	8,530,669.94	5.22
36	600779	水井坊	8,325,403.92	5.09
37	603260	合盛硅业	8,317,493.50	5.09
38	601966	玲珑轮胎	8,275,509.76	5.06
39	600197	伊力特	8,231,736.00	5.03
40	000998	隆平高科	8,158,992.00	4.99
41	600536	中国软件	8,133,359.00	4.97
42	002100	天康生物	8,081,095.01	4.94
43	002234	民和股份	8,061,614.00	4.93
44	603160	汇顶科技	8,031,381.86	4.91
45	600600	青岛啤酒	7,989,727.96	4.89
46	300349	金卡智能	7,857,358.00	4.81
47	601336	新华保险	7,854,322.68	4.80
48	300770	新媒股份	7,746,653.46	4.74
49	002812	恩捷股份	7,608,729.40	4.65
50	002938	鹏鼎控股	7,439,598.00	4.55
51	000651	格力电器	7,384,213.00	4.52
52	002236	大华股份	7,027,737.00	4.30
53	603896	寿仙谷	6,970,860.00	4.26
54	300085	银之杰	6,903,343.27	4.22
55	002867	周大生	6,676,369.34	4.08
56	601857	中国石油	6,673,328.00	4.08
57	601012	隆基股份	6,618,215.00	4.05

58	603363	傲农生物	6,420,472.00	3.93
59	603027	千禾味业	6,126,188.53	3.75
60	601766	中国中车	5,959,170.00	3.64
61	300015	爱尔眼科	4,516,663.47	2.76
62	002405	四维图新	4,372,903.00	2.67
63	300271	华宇软件	4,370,453.00	2.67
64	603888	新华网	4,366,978.00	2.67
65	000550	江铃汽车	4,325,933.00	2.65
66	002299	圣农发展	4,313,065.00	2.64
67	603369	今世缘	4,246,843.00	2.60
68	603696	安记食品	4,245,601.20	2.60
69	600993	马应龙	4,243,108.00	2.59
70	002369	卓翼科技	4,200,239.00	2.57
71	300424	航新科技	4,197,101.16	2.57
72	603317	天味食品	4,196,679.72	2.57
73	000733	振华科技	4,133,358.00	2.53
74	002120	韵达股份	4,116,425.30	2.52
75	002352	顺丰控股	4,116,200.00	2.52
76	002461	珠江啤酒	4,052,238.00	2.48
77	600093	易见股份	4,034,929.99	2.47
78	002475	立讯精密	3,990,940.00	2.44
79	300573	兴齐眼药	3,967,207.00	2.43
80	600996	贵广网络	3,741,111.00	2.29
81	600233	圆通速递	3,657,836.00	2.24
82	300527	中国应急	3,654,692.00	2.24
83	603008	喜临门	3,581,815.00	2.19
84	600458	时代新材	3,559,382.92	2.18
85	601398	工商银行	3,341,136.00	2.04
86	300600	瑞特股份	3,329,043.14	2.04
87	002463	沪电股份	3,320,331.00	2.03
88	300427	红相股份	3,305,930.00	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	002567	唐人神	34,729,792.00	21.24
2	002916	深南电路	32,927,478.37	20.14
3	002124	天邦股份	31,180,941.47	19.07
4	300033	同花顺	26,726,980.00	16.35
5	002032	苏泊尔	25,145,269.10	15.38
6	002714	牧原股份	25,099,594.45	15.35

7	300498	温氏股份	23,802,658.42	14.56
8	000876	新希望	23,600,335.15	14.43
9	002414	高德红外	22,279,831.70	13.63
10	000538	云南白药	20,361,760.00	12.45
11	603517	绝味食品	17,395,751.97	10.64
12	601888	中国国旅	16,319,744.39	9.98
13	600548	深高速	16,219,171.50	9.92
14	000568	泸州老窖	15,997,278.50	9.78
15	300761	立华股份	15,576,996.25	9.53
16	600837	海通证券	15,392,391.79	9.41
17	300487	蓝晓科技	14,544,459.04	8.90
18	002415	海康威视	14,211,416.23	8.69
19	300699	光威复材	13,658,461.95	8.35
20	300687	赛意信息	12,961,450.69	7.93
21	600073	上海梅林	12,315,760.40	7.53
22	300679	电连技术	12,050,705.32	7.37
23	300059	东方财富	11,911,133.76	7.28
24	600990	四创电子	11,616,906.82	7.10
25	002179	中航光电	11,258,422.84	6.89
26	603160	汇顶科技	11,163,823.00	6.83
27	300085	银之杰	10,875,192.60	6.65
28	600600	青岛啤酒	10,613,168.21	6.49
29	600197	伊力特	9,701,052.00	5.93
30	300424	航新科技	9,190,945.89	5.62
31	600536	中国软件	9,051,160.82	5.54
32	002463	沪电股份	8,983,487.00	5.49
33	002100	天康生物	8,886,344.16	5.43
34	600779	水井坊	8,867,771.45	5.42
35	000089	深圳机场	8,855,436.00	5.42
36	002938	鹏鼎控股	8,437,576.00	5.16
37	603444	吉比特	8,305,715.61	5.08
38	000895	双汇发展	8,206,406.95	5.02
39	002236	大华股份	8,139,791.00	4.98
40	603260	合盛硅业	8,076,765.92	4.94
41	300349	金卡智能	8,074,210.40	4.94
42	601012	隆基股份	8,071,978.71	4.94
43	002812	恩捷股份	7,825,283.00	4.79
44	002311	海大集团	7,720,650.45	4.72
45	300675	建科院	7,556,241.00	4.62
46	000702	正虹科技	7,534,238.92	4.61
47	601966	玲珑轮胎	7,489,714.82	4.58
48	601336	新华保险	7,441,515.00	4.55

## 大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告摘要

49	600305	恒顺醋业	7,015,660.00	4.29
50	000598	兴蓉环境	6,998,975.50	4.28
51	002234	民和股份	6,950,739.00	4.25
52	603096	新经典	6,892,679.00	4.22
53	002461	珠江啤酒	6,810,967.05	4.17
54	601688	华泰证券	6,809,007.55	4.16
55	601857	中国石油	6,685,496.02	4.09
56	002867	周大生	6,633,261.65	4.06
57	603486	科沃斯	6,619,366.89	4.05
58	603027	千禾味业	6,554,705.40	4.01
59	600547	山东黄金	6,018,346.00	3.68
60	603363	傲农生物	6,010,596.00	3.68
61	601766	中国中车	5,959,867.01	3.64
62	603896	寿仙谷	5,608,346.00	3.43
63	603000	人民网	5,547,471.60	3.39
64	600498	烽火通信	4,910,080.00	3.00
65	600093	易见股份	4,820,180.00	2.95
66	300015	爱尔眼科	4,667,592.97	2.85
67	603369	今世缘	4,518,392.90	2.76
68	000733	振华科技	4,344,863.00	2.66
69	002369	卓翼科技	4,291,941.00	2.62
70	002120	韵达股份	4,267,857.90	2.61
71	603696	安记食品	4,221,616.00	2.58
72	603806	福斯特	4,179,512.50	2.56
73	002299	圣农发展	4,177,190.00	2.55
74	002352	顺丰控股	4,148,710.00	2.54
75	300527	中国应急	4,072,317.57	2.49
76	600993	马应龙	4,012,221.00	2.45
77	300271	华宇软件	3,935,880.98	2.41
78	000550	江铃汽车	3,928,111.00	2.40
79	603317	天味食品	3,797,863.60	2.32
80	002405	四维图新	3,776,425.00	2.31
81	000333	美的集团	3,768,128.00	2.30
82	002475	立讯精密	3,672,574.45	2.25
83	600233	圆通速递	3,665,340.00	2.24
84	300600	瑞特股份	3,656,078.80	2.24
85	600996	贵广网络	3,603,703.00	2.20
86	603888	新华网	3,597,647.50	2.20
87	600030	中信证券	3,597,215.00	2.20
88	600458	时代新材	3,529,777.67	2.16
89	600637	东方明珠	3,456,589.00	2.11
90	600406	国电南瑞	3,365,012.00	2.06

91	600373	中文传媒	3,342,172.00	2.04
92	601398	工商银行	3,334,734.00	2.04
93	300144	宋城演艺	3,290,104.00	2.01

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	918,308,880.63
卖出股票收入(成交)总额	923,893,579.39

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)	4,192,164.50	2.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,192,164.50	2.09

#### 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	113529	绝味转债	32,510	4,192,164.50	2.09

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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	263,047.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,116.44
5	应收申购款	1,588.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	271,753.25

**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 (%)
10,275	16,069.77	1,322,076.00	0.80	163,794,812.34	99.20

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	陈锐红	15,126,210.00	9.31
2	汪旻	2,120,000.00	1.30
3	韩俊	1,200,000.00	0.74
4	俞河会	1,180,000.00	0.73
5	周汉森	1,105,700.00	0.68
6	章禾	1,072,000.00	0.66
7	陈苗根	1,000,000.00	0.62
8	林瑞瑛	930,000.00	0.57
9	陆正辉	897,837.00	0.55
10	陈皖生	874,998.00	0.54

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

### 8.3 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	126.27	0.0001

### 8.4 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 12 月 26 日) 基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	172,496,107.00
本报告期基金总申购份额	2,077,641.07
减: 本报告期基金总赎回份额	9,456,859.73
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	165,116,888.34

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

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

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人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	
海通证券	1	332,153,172.48	18.05%	302,685.97	18.05%	-
中泰证券	1	308,939,463.47	16.79%	281,535.68	16.79%	-
中金公司	3	295,148,853.60	16.04%	268,979.67	16.04%	-
光大证券	2	199,880,077.25	10.86%	182,148.45	10.86%	-
西藏东财	1	144,068,805.28	7.83%	131,292.49	7.83%	-
万和证券	1	132,406,456.05	7.19%	120,667.67	7.19%	-
华泰证券	1	123,192,847.16	6.69%	112,273.54	6.69%	-
天风证券	2	120,139,612.35	6.53%	109,481.56	6.53%	-
兴业证券	2	76,738,931.36	4.17%	69,934.18	4.17%	-
中信建投证券	2	58,761,899.24	3.19%	53,551.04	3.19%	-
中国银河证券	4	48,892,681.71	2.66%	44,554.54	2.66%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
天一证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	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	-	-	-	-	-
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

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
中泰证券	1,223,426.80	8.78%	-	-	-	-
中金公司	126,003.78	0.90%	-	-	-	-
西藏东财	12,583,520.00	90.31%	-	-	-	-
天风证券	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-

## § 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