

# 大成沪深 300 指数证券投资基金 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 姓名	赵冰	贺倩

负责人	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)		
	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

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. 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. 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

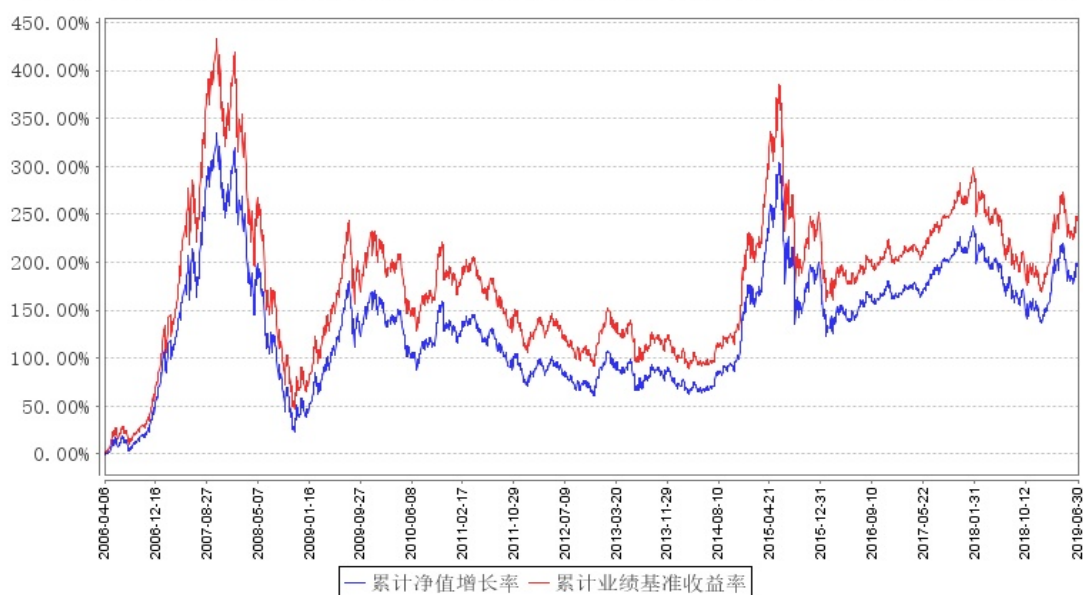
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.15%	1.09%	5.39%	1.16%	-0.24%	-0.07%
过去三个月	-1.88%	1.43%	-1.21%	1.53%	-0.67%	-0.10%
过去六个月	24.28%	1.46%	27.07%	1.55%	-2.79%	-0.09%
过去一年	7.55%	1.43%	8.96%	1.53%	-1.41%	-0.10%
过去三年	20.42%	1.03%	21.30%	1.11%	-0.88%	-0.08%
自基金合同生效起至今	198.07%	1.68%	246.76%	1.77%	-48.69%	-0.09%

大成沪深 300 指数 C

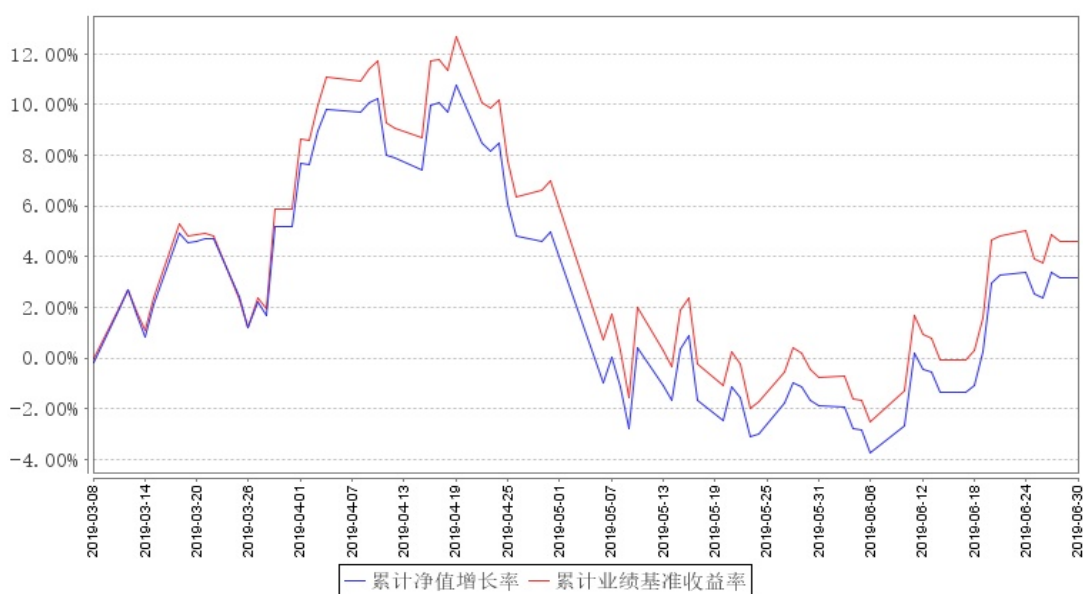
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.15%	1.09%	5.39%	1.16%	-0.24%	-0.07%
过去三个月	-1.90%	1.43%	-1.21%	1.53%	-0.69%	-0.10%
自基金合同生效起至今	3.19%	1.44%	4.59%	1.54%	-1.40%	-0.10%

### 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

					<p>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</p>
苏秉毅	本基金经理，数量与指数投资部副总监	2016 年 3 月 4 日	-	15 年	<p>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助理，现任数量与指数投资部副总监。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。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。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</p>



					<p>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</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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	-	-
资产总计	2,010,633,783.58	1,601,083,348.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2019年6月30日</b>	<b>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	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	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	123,818.29	331,170.16
负债合计	3,640,760.98	2,496,667.53
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,944,038,848.76	1,924,467,464.27
未分配利润	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	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	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“-”填列）	25,283,760.73	45,100,646.89
其中：股票投资收益	7,412,982.39	29,740,718.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-232,480.00	604,890.00
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	18,103,258.34	14,755,038.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	378,250.40	57,341.61
减：二、费用	10,205,472.48	9,951,804.04
1. 管理人报酬	6,961,986.92	6,960,515.66
2. 托管费	1,392,397.41	1,392,103.16
3. 销售服务费	7.84	-
4. 交易费用	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	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值变动数（本期利润）	-	378,939,320.64	378,939,320.64
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	-	-211,077,729.79	-211,077,729.79

动产生的基金净值变动数（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）	-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“-”号填列）	-	-139,683,717.59	-139,683,717.59
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 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：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	795,061,761.70	68.92	497,757,875.52	56.33

##### 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	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	6,961,986.92
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

## 6.4.4.2.2 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	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

## 6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

## 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固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 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。

## 6.4.4.6 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 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。

## 6.4.5.3 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	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	19,846,230.05	0.99

	业		
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	39,603.76	-

	信息技术服务业		
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	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

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。



### 7.3.2 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前五名股票投资明细

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	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

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	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

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）。交通银行作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
大成沪深 300 指数 C	8	5,633.43	-	-	45,067.47	100.00
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	2	50,125,571.64	4.35%	45,679.91	4.35%	-

券						
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。

§ 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