大成中小盘混合型证券投资基金(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	大成中小盘混合（LOF）
场内简称	大成小盘
基金主代码	160918
交易代码	160918
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月10日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	409,165,763.55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	2014年4月30日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小盘股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80％＋中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

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	114,575,484.97
本期利润	154,018,696.21
加权平均基金份额本期利润	0.3335
本期基金份额净值增长率	18.66%
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	0.8633
期末基金资产净值	762,413,407.27
期末基金份额净值	1.863

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

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

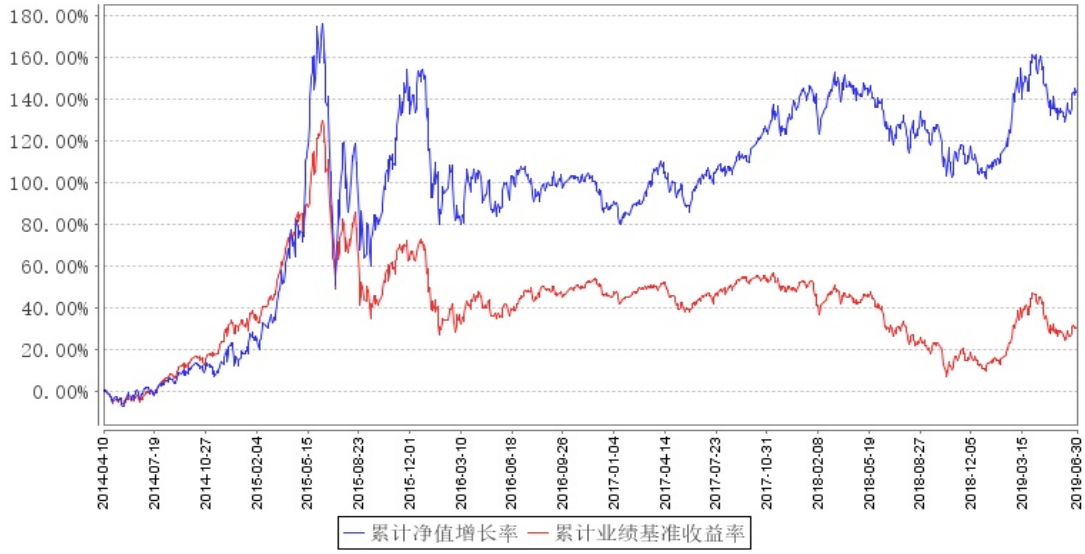
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.85%	1.03%	1.53%	1.03%	2.32%	0.00%
过去三个月	-3.47%	1.32%	-7.22%	1.38%	3.75%	-0.06%
过去六个月	18.66%	1.42%	17.24%	1.38%	1.42%	0.04%
过去一年	6.92%	1.39%	-0.84%	1.33%	7.76%	0.06%
过去三年	19.18%	1.14%	-8.27%	1.00%	27.45%	0.14%
自基金合同生效起至今	143.18%	1.81%	30.44%	1.41%	112.74%	0.40%

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

大成中小盘混合（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:1、本基金于自 2014 年 4 月 10 日起由景宏证券投资基金转型为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)，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 2015 年 7 月 24 日起由大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)更名为大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）。

§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		
魏庆国	本基金基金经理	2015 年 4 月 7 日	-	9 年	经济学硕士。2010 年至 2012 年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员。2012 年至 2013 年任职于平安大华基金研究部。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理助理。2015 年 4 月 7 日起任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金经理（更名前为大成中小盘股票型证券投资基金（LOF））。2015 年 4 月 7 日至 2016 年 8 月 19 日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 28 日至 2016 年 8 月 19 日任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 3 月 22 日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

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

年初基于行业比较，在科技创新驱动、大消费和价格驱动的周期三大板块中选出来具备长期投资价值或者短期高度景气的细分行业，并基于自下而上对公司质地的研究，判断风险收益比，买入相关标的，结果就是配置相对均衡。上半年本产品表现不及预期，最主要的原因是市场的表现集中在白酒、生猪养殖等板块，而本产品没有大幅超配。

在整个投资体系上，有如下改进：

第一个是对于主线和指标股的理解，市场在一轮行情中都有一个主线，要把资金集中在主战场上，偏离主线很难有超额收益。其次是需要高度重视指标股的价值，同样一个板块，指标股的表现要远远的大幅的好于其他个股。

第二个是对于防守的理解，并非全都是低估值品种或者消费类板块去做防御，“守其所必攻”，就是在主战场上无论如何要有足够的配置。

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1.863元；本报告期基金份额净值增长率为18.66%，业绩比较基准收益率为17.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，从板块和行业层面上看：

1、科技创新驱动的板块正处于新周期的起点上，随着5G网络逐步建成并投入运营，华为关于5G的报告中提到的云VR、云视频、车联网、医疗、教育等等都可能出现投资机会。科技板块的特点是高弹性，但过去受限于中国企业在全球科技产业链上的分工，往往景气持续性不强，应在深入研究并评估风险后予以考量。

2、大消费板块依然深度受益于两大红利：全球最大的统一市场红利和科技溢出红利。在互联网和线下高铁+快递两张网络支撑下，市场分割基本不存在，产品信息越来越透明，更有利于龙头强者恒强。其次就是科技溢出红利，龙头企业投入大量资金在IT系统建设上，供应链和渠道管理效率大幅提升，成本大幅下降，也助推了龙头强者恒强。

3、价格驱动的周期类板块，钢铁等产业格局在恶化，而部分格局好的公司慢慢变成现金流企业，但是高ROE可能有一定的回归常态过程。

未来本基金将在过程中不断修正和提升投资体系，期望未来给投资者更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；

基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人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

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(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
资 产：		
银行存款	145,158,476.33	245,631,607.12
结算备付金	3,277,146.20	4,825,808.81
存出保证金	584,994.77	595,309.15
交易性金融资产	614,027,974.28	546,907,014.15
其中：股票投资	614,027,974.28	546,907,014.15
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	7,079,927.76	6,868,846.60
应收利息	26,470.17	54,016.32
应收股利	-	-
应收申购款	42,238.11	126,080.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	770,197,227.62	805,008,682.86
负债和所有者权益	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,974,174.36	-
应付赎回款	313,741.39	37,965.39

应付管理人报酬	958,799.89	1,057,768.84
应付托管费	159,799.96	176,294.83
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,898,400.24	2,173,531.75
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	478,904.51	610,032.54
负债合计	7,783,820.35	4,055,593.35
所有者权益：		
实收基金	409,165,763.55	510,035,341.17
未分配利润	353,247,643.72	290,917,748.34
所有者权益合计	762,413,407.27	800,953,089.51
负债和所有者权益总计	770,197,227.62	805,008,682.86

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.863 元，基金份额总额 409,165,763.55 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(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	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	172,730,874.61	-12,695,837.39
1.利息收入	745,489.59	553,058.51
其中：存款利息收入	745,489.59	553,058.51
债券利息收入	-	-
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）	131,459,305.53	1,662,086.03
其中：股票投资收益	124,439,892.78	-483,073.80
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,019,412.75	2,145,159.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	39,443,211.24	-15,090,841.97

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,082,868.25	179,860.04
减：二、费用	18,712,178.40	11,560,898.03
1．管理人报酬	6,159,408.42	3,396,944.98
2．托管费	1,026,567.98	566,157.49
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	11,386,750.14	7,380,824.42
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	139,451.86	216,971.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	154,018,696.21	-24,256,735.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	154,018,696.21	-24,256,735.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(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）	510,035,341.17	290,917,748.34	800,953,089.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	154,018,696.21	154,018,696.21
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）	-100,869,577.62	-91,688,800.83	-192,558,378.45
其中：1.基金申购款	159,764,955.16	125,469,664.72	285,234,619.88
2.基金赎回款	-260,634,532.78	-217,158,465.55	-477,792,998.33
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）	409,165,763.55	353,247,643.72	762,413,407.27
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）	181,127,944.10	180,523,381.02	361,651,325.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,256,735.42	-24,256,735.42
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）	81,364,372.88	86,327,414.17	167,691,787.05
其中：1.基金申购款	110,514,326.85	116,948,538.57	227,462,865.42
2.基金赎回款	-29,149,953.97	-30,621,124.40	-59,771,078.37
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）	262,492,316.98	242,594,059.77	505,086,376.75

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

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金销售机构、基金管理人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

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	468,182,851.75	6.20	442,484,389.20	8.93

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	426,654.71	6.20	33,797.83	1.17
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	403,248.70	8.93	403,248.70	21.03

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	6,159,408.42	3,396,944.98
其中：支付销售机构的客户维护费	392,473.37	357,698.60

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 1.5%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×1.5%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至

	6 月 30 日	2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,026,567.98	566,157.49

注:支付基金托管人中国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。

6.4.4.2.3 销售服务费

无。

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
中国银行	145,158,476.33	691,048.15	171,577,799.70	515,381.67

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

6.4.8.1.1 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7月5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7月5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

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	614,027,974.28	79.72
	其中：股票	614,027,974.28	79.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	148,435,622.53	19.27
8	其他各项资产	7,733,630.81	1.00
9	合计	770,197,227.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	15,373,038.56	2.02
B	采矿业	363,431.25	0.05
C	制造业	301,677,170.33	39.57
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	16,766,365.00	2.20
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	143,960,411.60	18.88
J	金融业	83,498,345.94	10.95
K	房地产业	29,570,891.00	3.88
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	22,818,320.60	2.99
S	综合	-	-
	合计	614,027,974.28	80.54

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	600887	伊利股份	1,618,242	54,065,465.22	7.09

2	601318	中国平安	606,700	53,759,687.00	7.05
3	300451	创业慧康	3,130,883	46,806,700.85	6.14
4	002271	东方雨虹	1,842,974	41,761,790.84	5.48
5	603444	吉比特	161,400	33,887,544.00	4.44
6	603589	口子窖	503,200	32,416,144.00	4.25
7	000651	格力电器	567,376	31,205,680.00	4.09
8	002912	中新赛克	330,109	30,987,331.83	4.06
9	002129	中环股份	3,098,178	30,238,217.28	3.97
10	601166	兴业银行	1,624,100	29,704,789.00	3.90

注：投资者欲了解本报告期末本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	600837	海通证券	136,567,070.00	17.05
2	000858	五 粮 液	116,108,526.52	14.50
3	600887	伊利股份	96,908,683.25	12.10
4	000063	中兴通讯	92,601,947.80	11.56
5	601336	新华保险	91,844,434.50	11.47
6	600048	保利地产	78,242,876.62	9.77
7	002396	星网锐捷	75,415,442.60	9.42
8	002384	东山精密	73,048,148.96	9.12
9	300498	温氏股份	71,653,848.81	8.95
10	002129	中环股份	67,716,236.14	8.45
11	300451	创业慧康	67,256,166.90	8.40
12	601688	华泰证券	64,465,877.02	8.05
13	600079	人福医药	63,401,650.95	7.92
14	002202	金风科技	62,440,274.75	7.80
15	000625	长安汽车	59,203,761.18	7.39
16	601318	中国平安	56,692,071.15	7.08
17	601628	中国人寿	55,935,898.71	6.98
18	002727	一心堂	55,348,405.25	6.91
19	300296	利亚德	54,989,426.50	6.87
20	002271	东方雨虹	54,676,375.96	6.83
21	002146	荣盛发展	51,959,996.94	6.49
22	600383	金地集团	48,732,231.12	6.08
23	603444	吉比特	47,222,469.15	5.90
24	000651	格力电器	45,507,023.90	5.68
25	600073	上海梅林	41,673,717.27	5.20
26	600373	中文传媒	39,547,754.05	4.94

27	600438	通威股份	38,646,590.50	4.83
28	601211	国泰君安	37,305,502.88	4.66
29	601128	常熟银行	36,484,978.92	4.56
30	300136	信维通信	36,415,722.03	4.55
31	601939	建设银行	35,528,008.90	4.44
32	601166	兴业银行	35,440,289.05	4.42
33	300122	智飞生物	34,888,171.16	4.36
34	603369	今世缘	34,478,095.07	4.30
35	300373	扬杰科技	33,790,425.45	4.22
36	603019	中科曙光	33,531,134.40	4.19
37	603517	绝味食品	33,524,113.10	4.19
38	000425	徐工机械	33,474,210.00	4.18
39	601633	长城汽车	33,340,127.89	4.16
40	300747	锐科激光	33,194,610.50	4.14
41	300601	康泰生物	32,919,652.87	4.11
42	603589	口子窖	32,579,716.14	4.07
43	002912	中新赛克	32,413,696.46	4.05
44	000977	浪潮信息	32,378,696.30	4.04
45	600741	华域汽车	32,113,497.54	4.01
46	300348	长亮科技	31,282,177.24	3.91
47	000671	阳 光 城	31,195,634.17	3.89
48	300316	晶盛机电	28,009,548.52	3.50
49	300253	卫宁健康	27,879,709.80	3.48
50	000998	隆平高科	27,503,689.26	3.43
51	002262	恩华药业	27,149,466.33	3.39
52	600259	广晟有色	27,048,398.18	3.38
53	601877	正泰电器	26,989,485.06	3.37
54	300014	亿纬锂能	26,938,469.74	3.36
55	002110	三钢闽光	25,360,171.88	3.17
56	600763	通策医疗	25,191,961.00	3.15
57	603639	海利尔	25,172,527.49	3.14
58	601111	中国国航	24,665,085.98	3.08
59	300009	安科生物	24,178,451.31	3.02
60	002821	凯莱英	24,150,587.20	3.02
61	002049	紫光国微	24,142,330.91	3.01
62	300393	中来股份	24,105,359.70	3.01
63	600559	老白干酒	23,754,418.03	2.97
64	002019	亿帆医药	23,516,703.50	2.94
65	002562	兄弟科技	23,094,169.80	2.88
66	300144	宋城演艺	22,909,328.73	2.86
67	601899	紫金矿业	22,643,227.00	2.83
68	002583	海能达	18,779,475.71	2.34

69	002876	三利谱	18,646,716.16	2.33
70	000568	泸州老窖	18,522,337.86	2.31
71	002466	天齐锂业	18,267,417.20	2.28
72	300170	汉得信息	18,186,248.16	2.27
73	603083	剑桥科技	18,170,640.10	2.27
74	300274	阳光电源	17,971,852.20	2.24
75	300661	圣邦股份	17,849,572.03	2.23
76	600038	中直股份	17,708,651.00	2.21
77	002299	圣农发展	17,616,368.54	2.20
78	600258	首旅酒店	17,388,599.72	2.17
79	300427	红相股份	17,195,760.02	2.15
80	601607	上海医药	16,823,466.55	2.10
81	600085	同仁堂	16,780,431.00	2.10
82	603008	喜临门	16,727,607.00	2.09
83	601100	恒立液压	16,630,896.74	2.08
84	000043	中航善达	16,485,689.10	2.06
85	603026	石大胜华	16,449,290.64	2.05
86	002092	中泰化学	16,382,554.00	2.05
87	600409	三友化工	16,368,479.45	2.04
88	002555	三七互娱	16,304,128.86	2.04
89	300770	新媒股份	16,302,083.97	2.04
90	002138	顺络电子	16,261,603.00	2.03
91	300525	博思软件	16,212,887.04	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	600837	海通证券	144,559,053.63	18.05
2	000858	五 粮 液	126,192,932.54	15.76
3	002202	金风科技	106,942,425.93	13.35
4	601336	新华保险	90,965,356.13	11.36
5	600048	保利地产	79,790,635.53	9.96
6	000063	中兴通讯	74,197,532.89	9.26
7	002384	东山精密	68,117,605.65	8.50
8	601688	华泰证券	66,731,495.73	8.33
9	002396	星网锐捷	66,412,738.14	8.29
10	000625	长安汽车	62,501,572.74	7.80
11	300498	温氏股份	59,911,526.60	7.48
12	600038	中直股份	58,694,432.85	7.33
13	600498	烽火通信	58,623,336.97	7.32
14	601628	中国人寿	58,082,292.95	7.25

15	002583	海能达	56,999,747.66	7.12
16	300601	康泰生物	51,986,831.63	6.49
17	002146	荣盛发展	51,625,320.32	6.45
18	000876	新 希 望	49,417,593.31	6.17
19	300348	长亮科技	47,237,557.10	5.90
20	300451	创业慧康	47,060,763.89	5.88
21	600887	伊利股份	45,821,202.89	5.72
22	600373	中文传媒	45,075,592.46	5.63
23	002271	东方雨虹	44,820,231.51	5.60
24	300136	信维通信	43,810,853.96	5.47
25	300122	智飞生物	43,473,236.90	5.43
26	600073	上海梅林	42,150,294.50	5.26
27	600079	人福医药	42,012,621.58	5.25
28	002727	一心堂	41,009,312.21	5.12
29	600438	通威股份	40,210,847.48	5.02
30	600809	山西汾酒	39,644,882.77	4.95
31	300373	扬杰科技	39,461,579.76	4.93
32	300496	中科创达	38,760,926.00	4.84
33	300395	菲利华	38,621,036.80	4.82
34	002129	中环股份	38,106,793.11	4.76
35	603369	今世缘	37,426,232.00	4.67
36	002223	鱼跃医疗	36,481,617.44	4.55
37	601939	建设银行	35,358,662.16	4.41
38	603517	绝味食品	35,279,687.48	4.40
39	601211	国泰君安	34,756,234.14	4.34
40	603508	思维列控	33,689,652.18	4.21
41	601633	长城汽车	33,455,250.89	4.18
42	603019	中科曙光	32,989,619.00	4.12
43	000671	阳 光 城	32,590,463.09	4.07
44	300296	利亚德	32,459,817.79	4.05
45	300747	锐科激光	32,424,993.80	4.05
46	601128	常熟银行	31,898,726.21	3.98
47	603659	璞泰来	30,627,949.90	3.82
48	002672	东江环保	30,589,308.86	3.82
49	000425	徐工机械	30,130,208.19	3.76
50	300014	亿纬锂能	29,601,640.25	3.70
51	600259	广晟有色	29,299,206.80	3.66
52	300144	宋城演艺	28,802,231.45	3.60
53	002262	恩华药业	28,361,793.63	3.54
54	300078	思创医惠	28,197,919.12	3.52
55	300316	晶盛机电	27,923,199.18	3.49
56	601877	正泰电器	27,572,534.80	3.44

57	300661	圣邦股份	27,244,726.80	3.40
58	600741	华域汽车	27,087,109.20	3.38
59	000998	隆平高科	27,003,744.95	3.37
60	600104	上汽集团	26,869,524.42	3.35
61	601111	中国国航	26,542,015.62	3.31
62	002110	三钢闽光	26,191,430.00	3.27
63	600763	通策医疗	26,187,238.00	3.27
64	600872	中炬高新	25,692,840.00	3.21
65	300393	中来股份	25,044,126.50	3.13
66	600559	老白干酒	24,100,482.37	3.01
67	002019	亿帆医药	23,940,304.50	2.99
68	300009	安科生物	23,798,909.74	2.97
69	002821	凯莱英	23,176,607.39	2.89
70	601899	紫金矿业	22,589,070.85	2.82
71	002562	兄弟科技	22,253,907.04	2.78
72	002049	紫光国微	21,888,688.00	2.73
73	600383	金地集团	19,466,759.82	2.43
74	603639	海利尔	19,464,489.00	2.43
75	002466	天齐锂业	19,459,364.32	2.43
76	600258	首旅酒店	19,144,749.06	2.39
77	002876	三利谱	18,172,972.30	2.27
78	603083	剑桥科技	17,995,720.92	2.25
79	000568	泸州老窖	17,990,022.80	2.25
80	603026	石大胜华	17,899,483.87	2.23
81	002299	圣农发展	17,851,600.80	2.23
82	300170	汉得信息	17,696,679.72	2.21
83	300770	新媒股份	17,545,953.81	2.19
84	000043	中航善达	16,906,834.78	2.11
85	002027	分众传媒	16,895,763.58	2.11
86	002138	顺络电子	16,830,200.00	2.10
87	002092	中泰化学	16,697,710.00	2.08
88	600409	三友化工	16,677,837.94	2.08
89	300357	我武生物	16,087,224.80	2.01
90	002353	杰瑞股份	16,056,787.00	2.00

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	3,732,592,270.81
卖出股票收入（成交）总额	3,829,354,414.70

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

无。

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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、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	584,994.77
2	应收证券清算款	7,079,927.76

3	应收股利	-
4	应收利息	26,470.17
5	应收申购款	42,238.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,733,630.81

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（%）
18,743	21,830.32	264,985,180.79	64.76	144,180,582.76	35.24

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	联想投资有限公司	1,995,300.00	2.19
2	中国石油天然气集团公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	1,211,853.00	1.33
3	上海协通（集团）有限公司	1,032,300.00	1.14
4	金宗义	1,000,020.00	1.10
5	欧阳艳芬	1,000,000.00	1.10

6	黄珹	986,000.00	1.08
7	曹素清	642,800.00	0.71
8	马元璐	546,701.00	0.60
9	罗永禹	546,600.00	0.60
10	高德荣	525,300.00	0.58

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	425,719.02	0.1040

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	10~50
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4月10日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	510,035,341.17
本报告期基金总申购份额	159,764,955.16
减：本报告期基金总赎回份额	260,634,532.78
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	409,165,763.55

§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5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事

变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为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	
中信建投	1	2,364,585,878.30	31.29%	2,154,893.18	31.29%	-
中投证券	3	928,841,309.89	12.29%	846,448.55	12.29%	-
长江证券	2	822,501,430.17	10.88%	749,568.43	10.88%	-
广发证券	1	717,598,567.36	9.50%	653,950.33	9.50%	-
光大证券	2	468,182,851.75	6.20%	426,654.71	6.20%	-
广州证券	1	459,520,841.74	6.08%	418,753.88	6.08%	-
西南证券	1	379,852,859.67	5.03%	346,158.76	5.03%	-
华泰证券	2	368,064,683.08	4.87%	335,427.74	4.87%	-

国泰君安	1	255,504,076.95	3.38%	232,842.59	3.38%	-
民生证券	1	192,938,768.98	2.55%	175,822.17	2.55%	-
东方证券	1	175,338,541.37	2.32%	159,788.70	2.32%	-
申万宏源	1	154,869,746.19	2.05%	141,137.89	2.05%	-
银河证券	1	145,286,844.45	1.92%	132,399.33	1.92%	-
太平洋证券	1	43,165,804.98	0.57%	39,334.83	0.57%	-
招商证券	2	32,369,954.39	0.43%	29,497.04	0.43%	-
国信证券	1	26,190,408.50	0.35%	23,867.34	0.35%	-
中信证券	2	22,416,740.04	0.30%	20,427.88	0.30%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

天源证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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：

（一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

（二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；

（三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；

（四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；

（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。本报告期内增加交易单元：太平洋证券、长江证券。本报告期内退租交易单元：无。

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