大成核心双动力混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成核心双动力混合
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	91,089,218.26份
投资目标	以稳健的投资策略为主,采用合理的方法适当提升风险收益水平,力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置,并采用“核心-双卫星”策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的混合基金,预期风险收益水平低于股票基金,高于债券基金和货币市场基金。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,405,156.74
2.本期利润	-9,169,534.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1010
4.期末基金资产净值	83,614,070.48
5.期末基金份额净值	0.918

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。

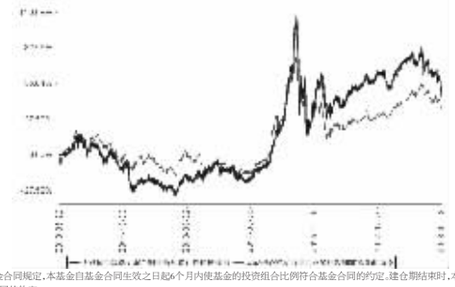
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-9.89%	1.04%	-7.03%	0.85%	-2.86%	0.19%

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



注:1.按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6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22日由大成核心双动力股票型证券投资基金更名为大成核心双动力混合型证券投资基金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年2月28日	-	8年	会计学硕士.2010年7月加入大成基金管理有限公司,历任研究部研究员,数量投资部数量分析师.2013年3月25日至2015年1月14日担任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日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理.2015年7月22日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理.2015年8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日起担任大成沪深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
苏秉毅先生	本基金基金经理,数量与指数投资部总监	2016年3月4日	-	14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,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500深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日担任深证成长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.2014年8月24日至2015年2月29日起担任大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理.2013年1月1日至2015年8月25日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。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日起担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日起担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日起担任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节,研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年2季度公司旗下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或交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略;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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度在中美贸易摩擦升级、社融超预期下降和地产政策持续收紧等事件的影响下,A股市场单边下跌,沪深300指数二季度下跌9.9%,创业板指下跌15.5%。受经济周期影响较大的传统制造和金融业以及出口收入占比高的电子元器件等行业普遍大幅下跌,食品饮料、餐饮旅游、医药、家电等稳定消费类股票受到追捧,二季度超额收益明显。

报告期内本基金基于基金契约,精选沪深300成分股构建了核心组合,同时选择业绩持续增长、估值合理的成长股作为进攻组合。

4.5 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0.918元;本报告期基金份额净值增长率为-9.89%,业绩比较基准收益率为-7.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	67,154,627.19	79.96
	其中:股票	67,154,627.19	79.96
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	16,772,425.60	19.97
8	其他资产	63,360.72	0.08
9	合计	83,990,413.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	418,230.00	0.50
B	采矿业	1,949,345.40	2.33
C	制造业	32,075,455.20	38.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,574,371.00	1.88
E	建筑业	2,002,203.00	2.39
F	批发和零售业	3,261,317.00	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,053,474.00	2.46
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,808,258.11	3.36
J	金融业	15,275,688.98	18.27
K	房地产业	3,633,434.00	4.35
L	租赁和商务服务业	709,303.50	0.85
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	461,083.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	932,464.00	1.12
S	综合	-	0.00
	合计	67,154,627.19	80.31

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告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

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	601328	交通银行	368,800	2,116,912.00	2.53
2	601288	农业银行	582,300	2,003,112.00	2.40
3	600887	伊利股份	71,300	1,989,270.00	2.38
4	600690	青岛海尔	101,500	1,954,890.00	2.34
5	600015	华夏银行	255,700	1,904,965.00	2.28
6	601601	中国太保	58,300	1,856,855.00	2.22
7	000858	五粮液	24,300	1,846,800.00	2.21
8	601628	中国人寿	77,900	1,754,308.00	2.10
9	600837	海通证券	178,834	1,693,557.98	2.03
10	000963	华东医药	33,300	1,606,725.00	1.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,069.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,737.85
5	应收申购款	29,553.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,360.72

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	90,588,164.09
报告期期间基金总申购份额	1,761,784.19
减:报告期期间基金总赎回份额	1,260,730.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	91,089,218.26

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180401-20180630	25,772,551.55	0.00	0.00	25,772,551.55	28.29%
	2	20180401-20180630	31,113,308.54	0.00	0.00	31,113,308.54	34.16%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险,甚至有可能引起基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立大成核心双动力股票型证券投资基金的文件;

2.《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》;

3.《大成核心双动力混合型证券投资基金基金托管协议》;

4.《大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》;

5.大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

6.本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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
2018年7月20日

大成恒丰宝货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018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:恒丰银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成恒丰宝货币		
交易代码	001697		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月4日		
报告期末基金份额总额	297,328,301.92份		
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。		
投资策略	本基金通过对宏观经济、宏观政策、市场资金面供求等因素的综合分析,对资金利率变动趋势进行评估,最大限度地优化存款期限、回购和债券品种组合。基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均剩余期限范围确定类属资产配置。基金根据对未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期,在确保安全性和流动性的前提下,通过不同商业银行和不同存款期限的选择,按阶出利率报价较高的务家银行进行银行协议存款和大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注申购与赎回资金变化情况,季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	恒丰银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
下属分级基金的交易代码	001697	001698	001699
报告期末下属分级基金的份额总额	15,709,464.72份	99,942,295.03份	181,676,542.17份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)		
	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
1. 本期已实现收益	104,431.01	1,164,053.23	1,741,726.22
2.本期利润	104,431.01	1,164,053.23	1,741,726.22
3.期末基金资产净值	15,709,464.72	99,942,295.03	181,676,542.17

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成恒丰宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9676%	0.0013%	0.0873%	0.0000%	0.8803%	0.0013%

大成恒丰宝货币B

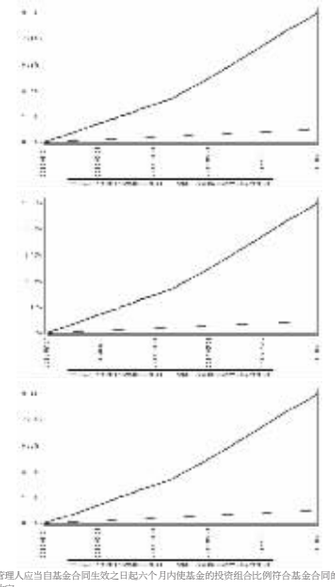
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0278%	0.0013%	0.0873%	0.0000%	0.9405%	0.0013%

大成恒丰宝货币E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9674%	0.0013%	0.0873%	0.0000%	0.8801%	0.0013%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末,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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈会雯先生	本基金基金经理	2016年9月6日	-	11年	中央财经大学经济学学士.2007年10月加入大成基金管理有限公司,历任基金管理部基金助理会计师、基金运管部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部基金经理。自2016年8月6日起任大成景欣灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理,自2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理,自2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理,自2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理,自2017年3月22日起担任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成富短纯债债券型证券投资基金基金经理,自2018年3月14日起担任大成月添阳期理财债券型证券投资基金及大成添利宜货币市场基金基金经理.具备基金从业资格.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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节,研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年2季度公司旗下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或交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略;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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度为避免社融增速回落过快对实体经济的负面影响,货币政策边际上继续放松.纵观二季度,隔夜回购利率均值约为2.68%,较上季度上升5BP,14天回购加权利率均值约为4.10%,较上季度下降2BP,1年期金融债收益率下行约33bp,1年AAA短期融资券下行约22bp,1年AA+短融品种下行约5bp。

本基金将继续以流动性为第一前提,在关键时点适度加长配置期限并适时调整组合结构,努力提高组合静态收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成恒丰宝货币A的基金份额净值收益率为0.9676%,本报告期大成恒丰宝货币B的基金份额净值收益率为1.0278%,本报告期大成恒丰宝货币E的基金份额净值收益率为0.9674%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	184,473,752.42	59.34
	其中:债券	184,473,752.42	59.34
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	59,629,449.45	19.18
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	60,242,495.46	19.38
4	其他资产	6,515,183.23	2.10
5	合计	310,860,880.56	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		7.70
	其中:买断式回购融资		0.00
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	13,094,873.45	4.40
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	26.86	4.40
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	5.36	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	70.13	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-120天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)-397天(含)	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		102.36	4.40

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	15,950,613.90	5.36
	其中:政策性金融债	15,950,613.90	5.36
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	168,523,138.52	56.68
8	其他	-	0.00
9	合计	184,473,752.42	62.04
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111810263	18兴业银行CD263	400,000	39,679,641.86	13.35
2	111820121	18广发银行CD121	400,000	39,679,523.51	13.35
3	111808169	18中信银行CD169	400,000	39,616,731.82	13.32
4	111816189	18上海银行CD189	200,000	19,819,142.13	6.67
5	187702	18沾现国开02	160,000	15,950,613.90	5.36
6	111809171	18浦发银行CD171	100,000	9,919,955.98	3.34
7	111807141	18招商银行CD141	100,000	9,904,661.11	3.33
8	111806164	18交通银行CD164	100,000	9,903,482.11	3.33

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1123%
报告期内偏离度的最低值	0.0108%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0507%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入或本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00 元。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	204,252.31
4	应收申购款	6,310,930.92
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,515,183.23

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	大成恒丰宝货币A	大成恒丰宝货币B	大成恒丰宝货币E
报告期期初基金份额总额	10,699,544.34	144,977,940.30	184,747,682.50
报告期期间基金总申购份额	15,126,247.09	6,348,502.25	355,145,510.89
报告期期间基金总赎回份额	10,116,326.71	51,384,147.52	358,216,651.22
报告期期末基金份额总额	15,709,464.72	99,942,295.03	181,676,542.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立大成恒丰宝货币市场基金的文件;

2.《大成恒丰宝货币市场基金基金合同》;

3.《大成恒丰宝货币市场基金托管协议》;

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。

9.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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
2018年7月20日

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金(QDII-LOF)

2018 第二季度 报告

2018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
报告送出日期:2018年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	大成恒生综合中小型股指数
场内简称	恒生中小
交易代码	160922
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月2日
报告期末基金份额总额	23,194,020.52份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金将主要按照标的指数的成分股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足、异常无法获得足够数量的股票时,或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术或当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。