大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	大成月月盈短期理财债券
基金主代码	090023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月12日
报告期末基金份额总额	17,397,637,765.23份
投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标,追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四个层次进行投资管理,以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,及普通债券型证券投资基金。
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

下属分级基金的基金简称	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
下属分级基金的交易代码	090023	091023	001516
报告期末下属分级基金的份额总额	128,428,819.72份	17,155,760,509.86份	113,448,435.65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2019年4月1日 - 2019年6月30日		
	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
1.本期已实现收益	987,148.95	154,730,407.25	793,993.19
2.本期利润	987,148.95	154,730,407.25	793,993.19
3.期末基金资产净值	128,428,819.72	17,155,760,509.86	113,448,435.65

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。

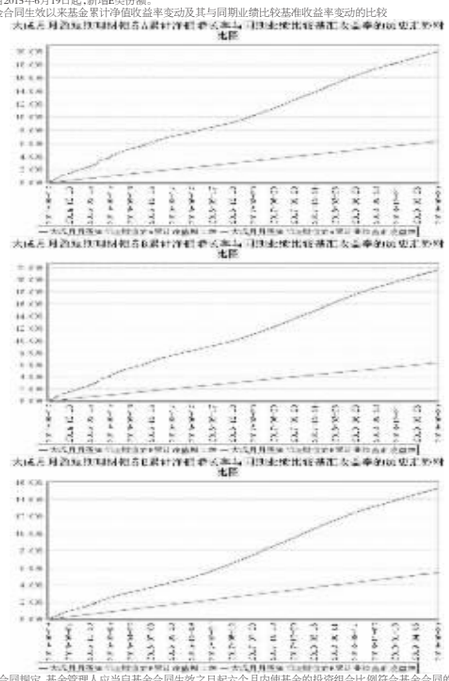
3.2基金净值表现

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

大成月月盈短期理财债券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	0.6797%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3431%	0.0008%
大成月月盈短期理财债券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	0.7583%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.4217%	0.0008%
大成月月盈短期理财债券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	0.6666%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3300%	0.0008%

注:1、本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期,是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。
3、本基金自2015年6月19日起,新增E类份额。

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:按基金合同规定,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有关约定。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		
陈会荣	本基金基金经理	2018年3月14日	-	12年	经济学学士,2004年7月至2007年10月就职于招商银行总行,任资产托管部年金小组组长,2007年10月加入大成基金管理有限公司,曾担任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员,固定收益总部基金经理助理,2016年8月6日至2018年10月20日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理,2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠灿纯债债券型证券投资基金基金经理,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,2017年3月22日起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景灿纯债债券型证券投资基金基金经理,2018年3月14日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添祥定货币市场基金基金经理,2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理,具备基金从业资格,国籍:中国
李富强	本基金基金经理	2018年7月16日	-	5年	经济学硕士,2009年7月至2013年12月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理,2014年1月至2017年7月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理,2017年7月加入大成基金管理有限公司,任职于固定收益总部,2018年7月16日至2019年3月9日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,2018年7月16日至2019年3月21日任大成景利混合型证券投资基金基金经理,2018年7月16日起任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理,2018年11月16日起任大成景臻灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2019年6月12日起任大成景阅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
张钟玉	本基金基金经理	2015年2月28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(联名基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、大成保证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年8月26日起任大成沪深300指数证券投资基金基金经理,具有基金从业资格,国籍:中国

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。2019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成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;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

2019年二季度经济数据和金融数据在一季度超市场预期之后回归平稳增长,制造业投资增速有所下滑,基建投资增速有所企稳回升,房地产投资见顶略有回调,进出口同比增速低位徘徊,社会消费品零售总额不断探底,受到水果和猪肉价格影响CPI有所反弹,PPI低位运行。一季度中央政治局会议定调坚持金融去杠杆的方向,央行货币政策保持稳健,二季度资金面比一季度略有收紧。与此同时,为对冲中美贸易战对金融市场情绪影响以及包括美联储对金融市场风险偏好的影响,央行在部分时点加大流动性投放,整体来看,二季度债券市场则呈现出来有所上行,受到信用风险偏好下降影响,低等级信用债信用利差扩大,利率债和高等级信用债表现较好。

二季度,本基金根据市场变化在保障流动性安全的基础上,在综合考虑基本面、货币政策和资金面变化的具体情况下,抓住重要时点进行配置相对低风险和高收益的投资品种,并合理利用杠杆增厚组合收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月月盈短期理财债券A基金份额净值收益率为0.6797%,本报告期大成月月盈短期理财债券B基金份额净值收益率为0.7583%,本报告期大成月月盈短期理财债券E基金份额净值收益率为0.6666%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	8,089,221,218.96	43.55
	其中:债券	8,089,221,218.96	43.55
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,084,913,607.37	21.99
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	6,296,457,192.84	33.90
4	其他资产	104,391,139.32	0.56
5	合计	18,574,983,158.49	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	18.44
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,145,978,387.00	6.59
	其中:买断式回购融资	-	-

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

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

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150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	42.18	6.59
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	7.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	19.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.16	6.59

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

本报告期内本基金均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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	950,660,012.76	5.46
	其中:政策性金融债	950,660,012.76	5.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,499,882,492.24	8.62
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,638,678,713.96	32.41
8	其他	-	-
9	合计	8,089,221,218.96	46.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	111997201	19成都银行CD100	4,000,000	398,737,869.72	2.29
2	111981249	19江苏江南农村商业银行CD064	3,000,000	299,444,867.60	1.72
3	111994330	19乌鲁木齐银行CD026	3,000,000	297,870,614.90	1.71
4	111994459	19唐山银行CD037	3,000,000	297,860,470.29	1.71
5	140219	14国开19	2,500,000	250,321,040.08	1.44
6	160420	16农发20	2,000,000	199,986,046.10	1.15
7	111981093	19江阴农村商业银行CD054	2,000,000	199,611,424.47	1.15
8	111980860	19桂林银行CD115	2,000,000	199,611,184.92	1.15
9	111981322	19常熟农村商行CD011	2,000,000	199,576,651.02	1.15
10	190402	19农发02	2,000,000	199,456,102.81	1.15

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	0.0785%
报告期内偏离度的最低值	0.0202%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0431%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

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

无。

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,即估值对象以买入成本列示,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摊益。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。

本基金投资的前十名证券之一19唐山银行CD037(111994459.IB)的发行主体唐山银行股份有限公司于2019年4月9日因未经任职资格审查任命高级管理人员的行为,受到唐山银保监分局处罚(唐银保监罚决字〔2019〕1号)。本基金认为,对唐山银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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	104,158,402.47
4	应收申购款	232,736.85
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	104,391,139.32

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

项目	大成月月盈短期理财债券A	大成月月盈短期理财债券B	大成月月盈短期理财债券E
报告期期初基金份额总额	249,678,856.64	22,552,076,851.60	136,493,385.57
报告期期间基金总申购份额	14,633,399.15	142,304,994.97	24,074,717.04
报告期期间基金总赎回份额	135,883,436.07	5,538,621,336.71	47,119,666.96
报告期期末基金份额总额	128,428,819.72	17,155,760,509.86	113,448,435.65

§7基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利发放	2019-06-13	706,394.62	706,394.62	-
合计			706,394.62	706,394.62	

注:红利发放为期间合计数。本基金为短期理财基金,故申购、赎回费率均为0.00%。

§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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	20190401-20190630	4,598,891,873.57	32,450,500.62	500,000,000.00	4,131,342,374.19	23.75
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

根据我司于2019年7月6日发布的《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。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金分额持有人大会决议生效的公告》;
2、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》;
3、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金托管协议》;
4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

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
2019年7月18日

大成核心双动力混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18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2019年7月17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2019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
基金主代码	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	89,950,133.81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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	6,066,769.46
2.本期利润	-1,366,784.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0152
4.期末基金资产净值	88,580,366.82
5.期末基金份额净值	0.985

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	-1.50%	1.33%	-0.61%	1.14%	-0.89%	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		
苏秉毅	本基金基金经理,数量与指数投资部副总监	2016年3月4日	-	15年	经济学硕士,2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部,2008年加入大成基金管理有限公司,曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理、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基金经理,2013年1月1日至2015年8月25日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理,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日起任大成深证成分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
张钟玉	本基金基金经理	2015年2月28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(联名基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、大成保证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年8月26日起任大成沪深300指数证券投资基金基金经理,具有基金从业资格,国籍:中国

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。2019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成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;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

2019年1季度,全球主要经济体的经济增速有所放缓,但是全球股票市场却出现了大幅反弹的趋势。

进入到2019年2季度,各种宏观经济数据显示,美国经济持续保持较为强劲增长的势头,而并不会陷入衰退。最新公布的美国2019年一季度实际GDP年化季环比增速为3.2%,远超出预期值及前值。这表明美国经济依然保持在较好的水平。

与此同时,美联储的加息的节奏也会放缓。当前普遍预计美联储在年内不仅不会加息,甚至有可能出现降息行为。美联储货币政策逐步向鸽派行为转变,使得市场信心也逐步得以修复。

在GDP增速保持在2%以上的预期下,指数成分股公司盈利仍然会保持增长。最新的影博一致预期数据显示,未来两年中,标普500指数成分股公司的年化复合盈利增速为7.8%,保持在良好水平区间内。当前标普500指数的动态市盈率在17.6倍左右,仍然位于历史平均水平区间,因此上市公司盈利的增长有望推动指数点位的增长。

由于本基金资产中的绝大部分(95%左右)是以美元计价的美国股票及少量美元存款,而基金估值的货币单位又是人民币,因此美元兑人民币的升值有利于基金净值的表现。正常来说,如果美元兑人民币升值1%,在其他条件不变的情况下,则会促使基金单位净值上涨0.95%左右。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率,本基金将坚持被动型的指数化投资理念,持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好地跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

截至本报告期末本基金份额净值为1.849元;本报告期基金份额净值增长率为5.30%,业绩比较基准收益率为3.72%。

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	79,711,049.47	89.20
	其中:股票	79,711,049.47	89.20
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	9,635,000.90	10.78
8	其他资产	14,299.82	0.02
9	合计	89,360,350.19	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	457,835.00	0.52
B	采矿业	4,308,469.95	4.86
C	制造业	36,917,349.20	41.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,994,805.00	3.38
E	建筑业	2,392,298.00	2.70
F	批发和零售业	1,838,552.00	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	2,755,467.00	3.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,243,872.32	4.79
J	金融业	17,341,434.40	19.58
K	房地产业	4,074,930.00	4.60
L	租赁和商务服务业	726,930.00	0.82
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	911,001.60	1.03
S	综合	748,105.00	0.84
	合计	79,711,049.47	89.99

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	600837	海通证券	178,834	2,537,654.46	2.86
2	601318	中国平安	27,000	2,392,470.00	2.70
3	600519	贵州茅台	2,400	2,361,600.00	2.67
4	600000	浦发银行	161,700	1,888,656.00	2.13
5	601988	中国银行	500,000	1,870,000.00	2.11
6	601328	交通银行	300,000	1,836,000.00	2.07
7	601166	兴业银行	100,000	1,829,000.00	2.06
8	600570	恒生电子	24,800	1,690,120.00	1.91
9	600031	三一重工	110,400	1,444,032.00	1.63
10	600276	恒瑞医药	19,200	1,267,200.00	1.43

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3本期国债期货投资评价

无。

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浦发银行(600000.SH)的发行主体上海浦东发展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〕3号)。本基金认为,对浦发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、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)。本基金认为,对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2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