

大成中证 500 深市交易型开放式指数  
证券投资基金  
2016 年年度报告摘要  
2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 25 日

## § 1 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 2017 年 3 月 23 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，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成中证 500 深市 ETF
场内简称	500 深 ETF
基金主代码	159932
交易代码	159932
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 12 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	19,507,615.00 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	2013 年 10 月 9 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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	<p>本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	本基金标的指数为中证 500 深市价格指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	罗登攀	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-2,706,567.27	1,530,129.48	5,729,668.89
本期利润	-7,220,452.10	952,383.02	6,423,634.37
加权平均基金份额本期利润	-0.3592	0.0973	0.5141
本期基金份额净值增长率	-17.98%	46.00%	30.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.6214	1.0163	0.3117
期末基金资产净值	35,150,574.11	42,855,510.49	5,220,217.34
期末基金份额净值	1.802	2.197	1.448

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。

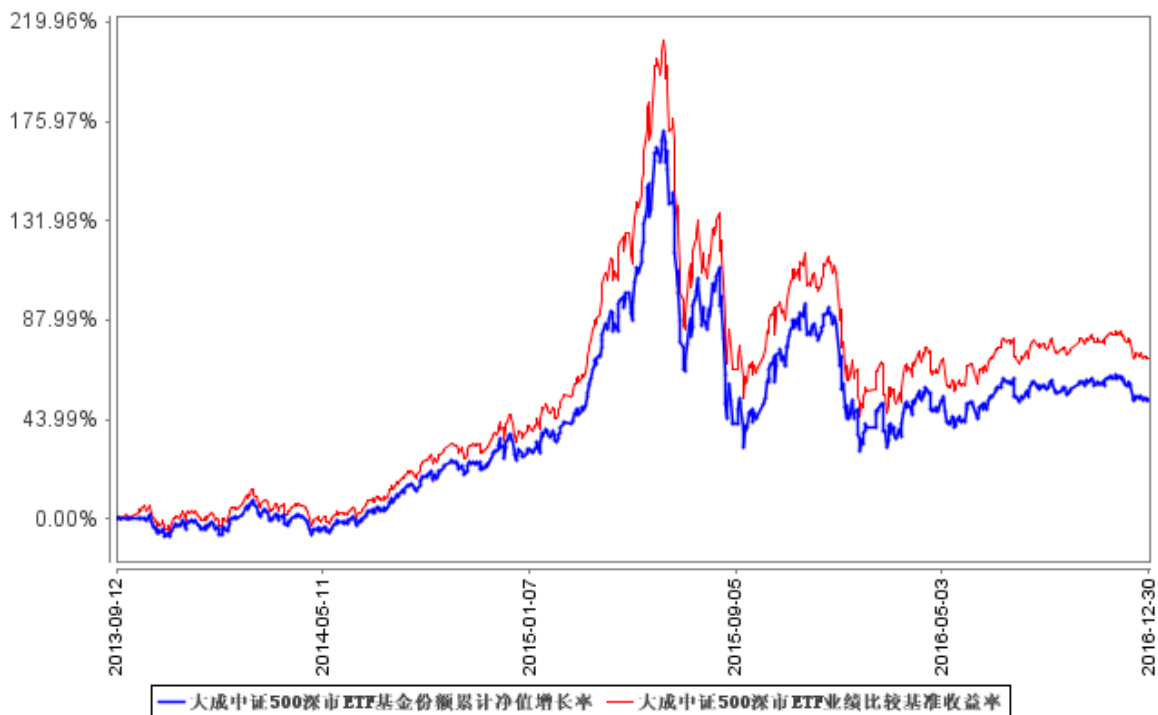
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

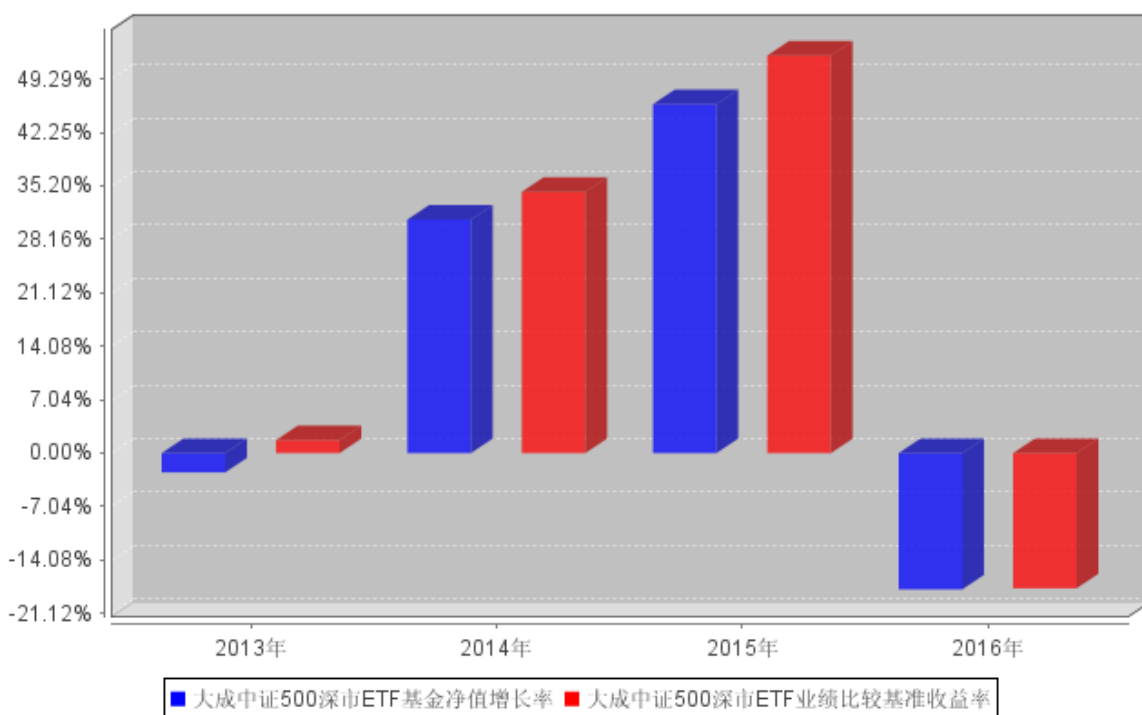
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.80%	0.80%	-2.27%	0.81%	-0.53%	-0.01%
过去六个月	-1.04%	0.92%	-0.08%	0.93%	-0.96%	-0.01%
过去一年	-17.98%	1.91%	-17.83%	1.92%	-0.15%	-0.01%
过去三年	56.64%	2.06%	68.39%	2.06%	-11.75%	0.00%
自基金合同生效起至今	52.65%	1.99%	71.29%	2.01%	-18.64%	-0.02%

### 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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2013 年净值增长率表现期间为 2013 年 9 月 12 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2013 年 9 月 12 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

## § 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。

经过十多年的稳健发展,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 2016 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金,4 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		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	6 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 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
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	8 年	经济学硕士，中国注册会计师。2008 年 1 月至 2008 年 12 月先后任职于中国平安保险（集团）股份有限公司集团资金管理部、集团财务部，从事投资财务工作。2008 年 12 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计师、基金运营部基金核算中心主管、数量投资部数量分析师，现任数量与指数投资部高级数量分析师兼基金经理助理。2015 年 7 月 20 日起，担任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金和大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违

法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 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；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。

#### 4.3.3 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存在 9 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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存在 2 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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

2016 年 A 股整体下跌，沪深 300 全年下跌 11.3%，中小板指、创业板指分别下跌 22.9%、27.7%。然而，分时间区间来看，全年跌幅主要源于 1 月和 2 月市场的深度调整，3-12 月各主要指数和大部分的行业收益率都为正。年中有色大宗价格上扬、保险资金举牌、国企改革等事件都推动相关个股上涨，市场不乏赚钱热点。

2016 年国内经济逐渐探底，PMI 等先行指标已明显回暖。然而受美国加息影响，人民币汇率承压，央行在 3 月初降准一次后，货币宽松政策乏力。地产销售和投资加速是 2016 经济平稳增长的重要支撑，但同时也推动了地产价格的新一轮上涨和更加严格的限购政策出台，2017 年的地产投资或许会碰触天花板，基建、消费升级转型、一带一路等新的经济增长点能否接力地产投资，是未来需要关注的重点。

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

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.802 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.98%，同期业绩比较基准收益率为-17.83%，低于业绩比较基准的表现。

#### 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 2017 年，经济或已探明底部区域，但新的经济增长点还未明确。政府可能加大基建投资，对冲限购政策抑制的地产投资；消费在收入增长放缓的情况下，增速仍将回落；进出口在人民币贬值、美国经济复苏的情况下有望逐渐好转。虽然国内通胀仍较低，但在人民币贬值压力下，央行的货币政策空间不大。2017 年国际经济形势不确定性更高，对国内经济走势影响更大，需密切关注美国新总统上台后的对华政策，以及对汇率和外贸的影响。

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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。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两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资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；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，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金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/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### 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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

### § 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”）在对大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金（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合规守信、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 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告已安永华明会计师事务所有限公司(特殊普通合伙) 审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	329,713.02	1,271,654.11
结算备付金	-	7,921.48
存出保证金	785.61	3,875.92
交易性金融资产	34,968,716.02	42,148,281.92
其中：股票投资	34,968,716.02	42,148,281.92
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	-	-
应收利息	77.04	316.77
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	35,299,291.69	43,432,050.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>2015 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	-	368,720.72
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	15,197.24	18,198.75
应付托管费	3,039.47	3,639.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,480.87	15,980.49
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	120,000.00	170,000.00
负债合计	148,717.58	576,539.71
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	23,029,486.80	23,029,486.80
未分配利润	12,121,087.31	19,826,023.69
所有者权益合计	35,150,574.11	42,855,510.49
负债和所有者权益总计	35,299,291.69	43,432,050.20

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.802 元，基金份额总额 19,507,615.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至
-----	------------------------------	----------------------------

	12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-6,631,732.41	1,695,160.66
1. 利息收入	5,649.40	14,933.99
其中：存款利息收入	5,646.40	14,933.99
债券利息收入	3.00	-
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）	-2,118,542.01	2,284,225.91
其中：股票投资收益	-2,349,251.37	2,253,141.14
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,941.84	-
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	228,767.52	31,084.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,513,884.83	-577,746.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-4,954.97	-26,252.78
<b>减：二、费用</b>	588,719.69	742,777.64
1. 管理人报酬	181,468.65	99,457.58
2. 托管费	36,293.77	19,891.54
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	40,707.27	43,218.52
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	330,250.00	580,210.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-7,220,452.10	952,383.02
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-7,220,452.10	952,383.02

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	23,029,486.80	19,826,023.69	42,855,510.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,220,452.10	-7,220,452.10
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)	-	-484,484.28	-484,484.28
其中: 1. 基金申购款	3,541,614.93	1,490,087.79	5,031,702.72
2. 基金赎回款	-3,541,614.93	-1,974,572.07	-5,516,187.00
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)	23,029,486.80	12,121,087.31	35,150,574.11
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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)	4,096,241.51	1,123,975.83	5,220,217.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	952,383.02	952,383.02
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)	18,933,245.29	17,749,664.84	36,682,910.13
其中: 1. 基金申购款	30,658,628.88	29,200,830.05	59,859,458.93
2. 基金赎回款	-11,725,383.59	-11,451,165.21	-23,176,548.80
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)	23,029,486.80	19,826,023.69	42,855,510.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>周立新</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

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策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与最近一期年度报告相一致。

##### 7.4.2 税项

###### 7.4.2.1 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。

###### 7.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

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、债券的差价收入，免征营业税。

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免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

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。

#### 7.4.2.3 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。

#### 7.4.3 关联方关系

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”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金申赎代办券商
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司（“广东证券”）	基金管理人的股东（2016 年 4 月 25 日前）
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：(1) 根据本基金管理人大成基金董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券将所持大成基金 2% 股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

(2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。



#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	181,468.65	99,457.58
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：（1）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 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

（2）于 2016 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 15,197.24 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 18,198.75 元）。

###### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	36,293.77	19,891.54

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

（2）于 2016 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 3,039.47 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 3,639.75 元）。

**7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 9 月 12 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	17,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	17,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	87.1500%	87.1500%

注：基金管理人交易本基金的费率符合法律法规、交易所及本基金法律文件的有关规定。

**7.4.4.4.2 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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

**7.4.4.5 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	329,713.02	5,256.86	1,271,654.11	13,790.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率及相关协议利率计息。

**7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

本基金于本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 7.4.5 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.5.1 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

7.4.5.1.1 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
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,633	10,696.15	10,696.15	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	523	7,991.44	7,991.44	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	517	4,808.10	4,808.10	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	920	2,824.40	2,824.40	-

## 7.4.5.2 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
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大事项	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	10,600	244,363.21	274,964.00	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大事项	20.31	-	-	11,500	281,149.16	233,565.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事项	15.80	-	-	14,300	163,521.13	225,940.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月	重大事项	13.79	-	-	16,370	258,756.16	225,742.30	-

		28 日								
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	4,800	127,482.17	225,072.00	-
000547	航天发展	2016 年 6 月 13 日	重大事项	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	14,600	370,357.76	224,256.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	9,900	204,654.64	186,318.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大事项	23.51	-	-	7,900	164,488.74	185,729.00	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	11,200	183,486.00	174,048.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大事项	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	21,826	131,473.38	163,258.48	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	45,400	154,222.62	152,998.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大事项	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	8,200	166,114.79	133,988.00	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项	25.20	-	-	4,610	141,252.57	116,172.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项	11.28	-	-	10,172	138,004.11	114,740.16	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大事项	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	5,700	121,272.85	112,290.00	-

002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项	36.40	2017年2月8日	33.50	2,800	62,410.60	101,920.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项	21.20	2017年1月5日	21.66	4,100	119,091.17	86,920.00	-
002681	奋达科技	2016年12月19日	重大事项	12.93	-	-	6,220	113,177.73	80,424.60	-
000693	ST华泽	2016年3月1日	重大事项	12.50	-	-	5,500	99,244.54	68,750.00	-
002745	木林森	2016年7月18日	重大事项	36.49	-	-	1,500	53,923.22	54,735.00	-

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	34,968,716.02	99.06
	其中：股票	34,968,716.02	99.06
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00

5	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
6	银行存款和结算备付金合计	329,713.02	0.93
7	其他各项资产	862.65	0.00
8	合计	35,299,291.69	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	691,841.18	1.97
B	采矿业	1,210,735.64	3.44
C	制造业	22,706,121.72	64.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,133,333.79	3.22
E	建筑业	1,140,732.71	3.25
F	批发和零售业	1,488,307.56	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	211,141.00	0.60
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,200,485.30	9.11
J	金融业	163,258.48	0.46
K	房地产业	1,659,517.94	4.72
L	租赁和商务服务业	626,425.30	1.78
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	185,531.40	0.53
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	177,280.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	297,774.00	0.85
S	综合	76,230.00	0.22
	合计	34,968,716.02	99.48

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	58,300	305,492.00	0.87
2	300136	信维通信	10,500	299,250.00	0.85
3	000887	中鼎股份	10,600	274,964.00	0.78
4	002405	四维图新	14,150	273,802.50	0.78
5	000661	长春高新	2,260	252,781.00	0.72
6	002572	索菲亚	4,500	243,720.00	0.69
7	002092	中泰化学	20,100	243,210.00	0.69
8	300156	神雾环保	9,500	237,595.00	0.68
9	000748	长城信息	11,500	233,565.00	0.66
10	300088	长信科技	14,300	225,940.00	0.64

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>)的年度报告正文。

### 8.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300113	顺网科技	304,997.00	0.71
2	300136	信维通信	291,596.00	0.68
3	000748	长城信息	259,424.18	0.61
4	002572	索菲亚	256,909.00	0.60
5	002426	胜利精密	252,577.00	0.59

6	002460	赣锋锂业	248,549.00	0.58
7	300156	神雾环保	240,995.00	0.56
8	002131	利欧股份	238,460.66	0.56
9	002407	多氟多	236,589.00	0.55
10	002422	科伦药业	227,758.00	0.53
11	300296	利亚德	226,095.00	0.53
12	300287	飞利信	224,006.48	0.52
13	002366	台海核电	217,794.00	0.51
14	002038	双鹭药业	217,333.00	0.51
15	300266	兴源环境	211,851.62	0.49
16	000983	西山煤电	209,639.00	0.49
17	002176	江特电机	204,712.00	0.48
18	002310	东方园林	195,334.00	0.46
19	300159	新研股份	194,621.00	0.45
20	002174	游族网络	193,155.00	0.45

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300072	三聚环保	522,846.05	1.22
2	002466	天齐锂业	478,952.00	1.12
3	002085	万丰奥威	353,944.00	0.83
4	002310	东方园林	299,872.00	0.70
5	000983	西山煤电	256,506.00	0.60
6	002426	胜利精密	234,939.00	0.55
7	002131	利欧股份	226,728.52	0.53
8	000718	苏宁环球	222,075.00	0.52
9	002174	游族网络	219,696.00	0.51
10	002714	牧原股份	217,932.00	0.51
11	002049	紫光国芯	207,804.00	0.48
12	002299	圣农发展	204,607.00	0.48
13	300182	捷成股份	198,759.38	0.46
14	300267	尔康制药	193,702.00	0.45
15	000671	阳光城	191,980.50	0.45
16	300122	智飞生物	191,309.56	0.45



17	300085	银之杰	188,549.60	0.44
18	300291	华录百纳	173,184.00	0.40
19	002180	艾派克	170,772.56	0.40
20	000511	*ST 烯碳	153,708.22	0.36

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。

#### 8.4.3 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	13,894,048.02
卖出股票收入（成交）总额	13,445,551.72

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

## 8.12.3 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	785.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	77.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	862.65

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000887	中鼎股份	274,964.00	0.78	重大资产重组停牌

2	000748	长城信息	233,565.00	0.66	重大资产重组停牌
3	300088	长信科技	225,940.00	0.64	重大资产重组停牌

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 8.12.6 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
239	81,621.82	17,020,600.00	87.25%	2,487,015.00	12.75%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

#### 9.2 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	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	87.15%
2	刘秀媛	250,000.00	1.28%
3	史应光	183,855.00	0.94%
4	邢秋珍	163,387.00	0.84%
5	黄连财	101,666.00	0.52%
6	王捷飞	84,728.00	0.43%
7	罗昭义	64,301.00	0.33%
8	肖卫中	57,942.00	0.30%
9	李滨	57,604.00	0.30%
10	莫祖京	57,300.00	0.29%

#### 9.3 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	-	0.0000%

## 9.4 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的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 9 月 12 日）基金份额总额	333,508,962.00
本报告期期初基金份额总额	19,507,615.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	19,507,615.00

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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

基金管理人于 2016 年 6 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

## 二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 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），本报告期支付的审计费用为 2 万元整。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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、本报告期内，本基金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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
申万宏源	1	27,258,441.30	100.00%	24,842.92	100.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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。

本报告期内本基金新增席位：恒泰证券、方正证券、中信建设、平安证券。本报告期内本基金退租席位：中泰证券。

#### 11.7.2 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
申万宏源	13,344.84	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

#### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变

更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。

3、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

大成基金管理有限公司  
2017 年 3 月 25 日