

大成价值增长证券投资基金  
2016 年年度报告  
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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 25 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国农业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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
8.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
9.3 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的情况.....	51
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8 其他重大事件.....	56
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	64
13.3 查阅方式.....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成价值增长证券投资基金
基金简称	大成价值增长混合
基金主代码	090001
前端交易代码	090001
后端交易代码	091001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 11 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	3,477,406,361.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以价值增长类股票为主构造投资组合，在有效分散投资风险的基础上，通过资产配置和投资组合的动态调整，达到超过市场的风险收益比之目标，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略，个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的股票投资重点关注：低 P/B 值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%。

### 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
信息披露负责人	姓名	罗登攀	林葛
	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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

	层	
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

## §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	130,284,033.11	3,471,211,193.05	830,326,713.71
本期利润	13,606,101.78	2,689,504,411.92	1,839,440,773.24
加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.6448	0.1978
本期加权平均净值利润率	0.48%	57.21%	27.92%
本期基金份额净值增长率	2.52%	49.07%	31.42%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-5,353,256.49	766,319,498.01	-955,630,685.14
期末可供分配基金份额利润	-0.0015	0.3319	-0.1169
期末基金资产净值	3,472,053,105.45	3,075,530,681.73	7,306,254,492.32
期末基金份额净值	0.9985	1.3319	0.8935
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	702.19%	682.48%	424.93%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额，不是当期发生数)。

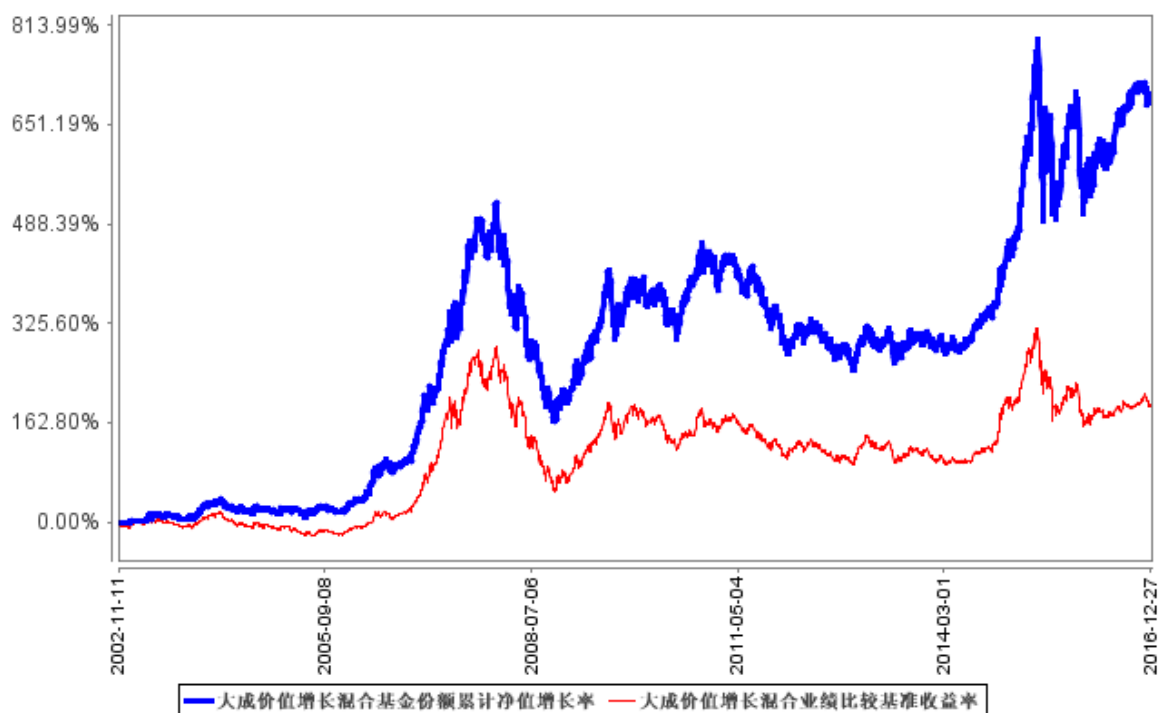
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 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	0.43%	0.60%	1.12%	0.58%	-0.69%	0.02%
过去六个月	9.75%	0.70%	4.05%	0.61%	5.70%	0.09%
过去一年	2.52%	1.42%	-8.44%	1.12%	10.96%	0.30%
过去三年	100.83%	1.63%	38.29%	1.43%	62.54%	0.20%
过去五年	105.45%	1.45%	39.67%	1.30%	65.78%	0.15%
自基金合同生效起至今	702.19%	1.38%	190.94%	1.43%	511.25%	-0.05%

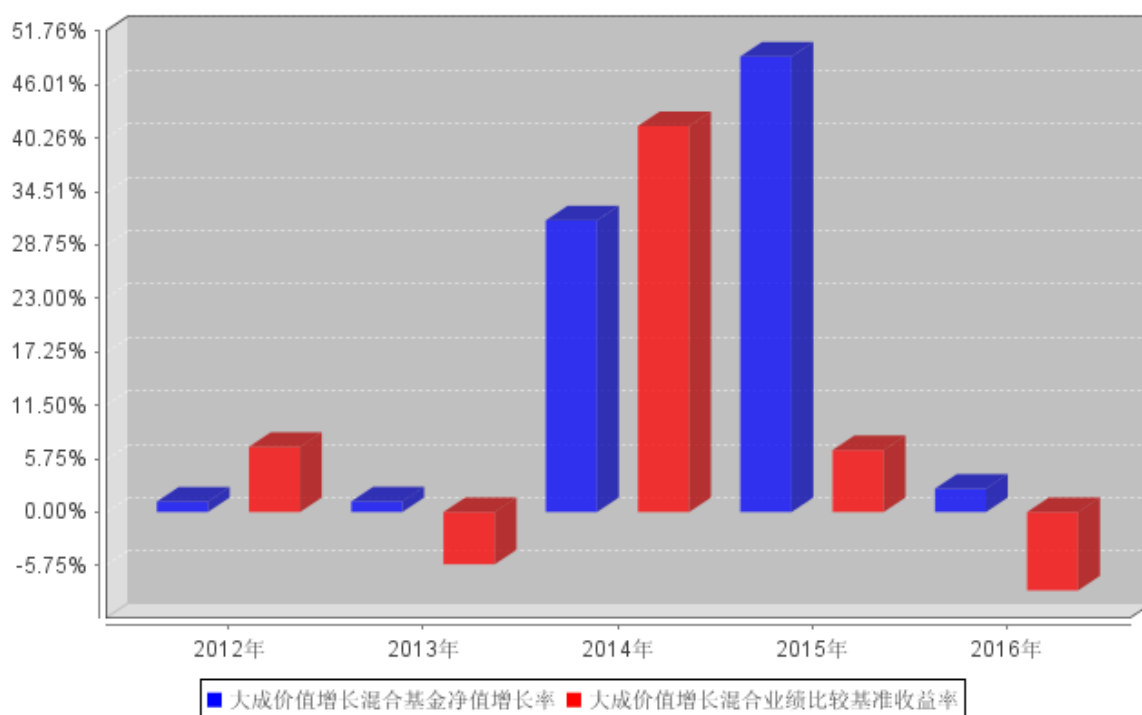
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、按基金合同规定，本基金的初始建仓期为6个月。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、本基金业绩比较基准自 2008 年 3 月 1 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%，自 2015 年 9 月 14 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%，本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从 2002 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2008 年 2 月 29 日为原业绩比较基准（中信价值指数×80%+中信国债指数×20%）的走势，2008 年 3 月 1 日至 2015 年 9 月 13 日为业绩比较基准（沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%）的走势，2015 年 9 月 14 日起为变更后的业绩比较基准（沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%）的走势。

### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
2016	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	
合计	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	



## §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		
石国武先生	本基金基金经理、股票投资部价值组投资总监、大类资产配置部总监	2013年4月18日	-	15年	工学硕士。2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司，历任系统分析员、股票投资部投资经理助理，特定资产部投资经理。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年4月18日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014年8月23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日至2016年3月8日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年4月18日至2015年7月23

					<p>日担任大成优选股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 7 月 24 日至 2016 年 5 月 25 日任大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 9 月 23 日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日起任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2016 年 8 月 19 日起任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部价值组投资总监。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。

3、自 2017 年 2 月 20 日起, 韩创先生增聘为本基金基金经理助理。韩创先生, 中山大学经济学硕士研究生。2015 年 6 月加入大成基金管理有限公司, 历任研究部助理研究员、研究员。自 2017 年 2 月 20 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍: 中国。

#### 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》、《大成价值增长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, 大成价值增长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，沪深 300 表现为-11.28%，中证 500 表现为-17.78%，创业板指表现为-27.71%，A 股市场在年初赢来极为惨淡的开局，新推出的熔断机制加剧了市场的恐慌效应。随着管理层变更和资本市场维稳政策的逐步推出，资本市场缓慢企稳并进入震荡上升走势，市场整体跌幅有所收敛，结构上有业绩支撑的公司股价表现突出，创业板股票表现萎靡。在积极财政政策和稳健的货

币政策的作用下，2016 年宏观经济逐步企稳，其中，房地产景气回升和供给侧改革初见成效，对宏观经济保持稳定作用显著。负面因素在于重点城市房地产价格快速上升和金融机构杠杆水平的快速提升给宏观经济的长期稳定积累了一定的潜在风险。随着国庆房地产调控政策出台和央行货币政策向中性的转变，金融体系“防风险”成为重点，债券市场迎来一波超预期的调整。

2016 年，大成价值增长基金继续秉持以风险收益比为核心的多策略平衡投资策略，聚焦于产业和企业层面，寻找未来产业趋势变迁中的受益者和企业竞争中的优胜者，在市场复杂的博弈格局中保持投资定力，业绩表现稳定，和基金经理的预期一致。

#### 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 0.9985 元。本报告期内基金份额净值增长率为 2.52%，同期业绩比较基准收益率-8.44%，高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，政策基调由稳增长向防风险转变立场比较坚定，货币环境回归中性稳健，积极财政适度发力以维持经济增长的稳定。我们预计地产投资将小幅下行，全球经济复苏和汇率贬值背景下出口景气有所恢复，由于供给侧改革的加速推进，微观企业经营情况将明显好转，宏观经济即便有所波动也依然能够保持总体稳定。从更长期的视角看，中国经济已经实现从高速增长向中速增长的转变，经济增速快速降低的阶段已经过去，宏观经济逐步进入一个新的稳态区间。伴随宏观经济进入稳态区间，一方面从需求变迁的趋势看产业升级将持续进行，同时从供给角度看大部分产业的优胜劣汰已经或者即将发生，胜者为王，产业结构逐步进入竞合状态，行业优胜者有能力维持市场秩序保持较高回报水平。全球对比来看，中国的服务业的效率和规模存在较大的提升空间，产业层面看，快递、医疗、教育、文化娱乐等行业已经进入持续发展的快速道。随着人均收入的提升，中国消费者基本的数量性需求已经得到满足，消费者对产品和服务品质的需求明显上升，在汽车、家电、服装、食品等行业消费升级的趋势已经并且还将持续的进行，三四五线城市居民在消费升级上表现尤为突出。

从中长期资产配置角度观察，2015 年年中以来资本市场经过多轮调整和长期震荡，市场风险得到充分释放。从上市公司估值水平、盈利能力、分红回报、经营趋势看，权益类资产总体处于合理位置，其中，相当一批优质上市公司的股权价值中长期具备良好风险比。

我们将秉持一贯的投资策略，一方面深入研究公司的长期投资价值，同时跟踪公司经营情况的变化，在合理安全边际下投资我们所青睐的优质公司；同时保持投资的灵活性，对各种可能出现的情景提前做好应对准备。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### **4.8 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。本报告期内大成价值增长已分配利润 696,664,498.68（每十份基金份额分红 2.9870 元），符合基金合同规定的分红比例。

#### **4.9 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成价值增长证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的大成价值增长证券投资基金(以下简称“大成价值增长基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是大成价值增长基金的基金管理人大成基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相

	<p>关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，上述大成价值增长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成价值增长基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	薛竞	俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	20,308,059.61	230,887,282.86
结算备付金		11,565,103.78	13,977,632.35
存出保证金		1,708,393.78	4,088,565.03
交易性金融资产	7.4.7.2	3,496,950,571.45	3,301,686,091.68
其中：股票投资		2,778,414,439.27	2,248,211,540.18
基金投资		-	-
债券投资		718,536,132.18	1,053,474,551.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		79,038,275.44	20,135,953.82
应收利息	7.4.7.5	12,959,515.87	21,811,791.45
应收股利		-	-
应收申购款		25,277,450.63	224,228.52



递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,647,807,370.56	3,592,811,545.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		130,000,000.00	498,998,851.50
应付证券清算款		35,875,549.22	-
应付赎回款		1,472,784.96	5,345,639.67
应付管理人报酬		4,526,176.59	3,967,390.01
应付托管费		754,362.76	661,231.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,701,248.30	7,468,794.09
应交税费		-	-
应付利息		91,271.33	558,874.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	332,871.95	280,083.04
负债合计		175,754,265.11	517,280,863.98
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,477,406,361.94	2,309,211,183.72
未分配利润	7.4.7.10	-5,353,256.49	766,319,498.01
所有者权益合计		3,472,053,105.45	3,075,530,681.73
负债和所有者权益总计		3,647,807,370.56	3,592,811,545.71

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9985 元，基金份额总额

3,477,406,361.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		93,184,072.36	2,847,084,255.17
1. 利息收入		18,147,626.22	46,833,406.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,509,844.55	3,838,178.66
债券利息收入		16,421,665.07	42,902,716.60

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		216,116.60	92,511.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		191,206,602.02	3,577,140,800.49
其中：股票投资收益	7.4.7.12	170,910,419.54	3,400,805,093.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,091,158.51	139,272,191.81
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	21,387,340.99	37,063,515.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-116,677,931.33	-781,706,781.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	507,775.45	4,816,829.21
<b>减：二、费用</b>		79,577,970.58	157,579,843.25
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	42,642,786.84	70,931,547.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,107,131.13	11,821,924.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	25,456,749.68	48,539,762.84
5. 利息支出		3,769,146.80	25,633,072.00
其中：卖出回购金融资产支出		3,769,146.80	25,633,072.00
6. 其他费用	7.4.7.20	602,156.13	653,536.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,606,101.78	2,689,504,411.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,606,101.78	2,689,504,411.92

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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	2,309,211,183.72	766,319,498.01	3,075,530,681.73

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,606,101.78	13,606,101.78
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)	1,168,195,178.22	-88,614,357.60	1,079,580,820.62
其中:1.基金申购款	2,005,403,937.80	-113,444,715.93	1,891,959,221.87
2.基金赎回款	-837,208,759.58	24,830,358.33	-812,378,401.25
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)	-	-696,664,498.68	-696,664,498.68
五、期末所有者权益(基金净值)	3,477,406,361.94	-5,353,256.49	3,472,053,105.45
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)	8,176,803,559.38	-870,549,067.06	7,306,254,492.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,689,504,411.92	2,689,504,411.92
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)	-5,867,592,375.66	-1,052,635,846.85	-6,920,228,222.51
其中:1.基金申购款	676,429,405.71	97,875,479.35	774,304,885.06
2.基金赎回款	-6,544,021,781.37	-1,150,511,326.20	-7,694,533,107.57
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)	2,309,211,183.72	766,319,498.01	3,075,530,681.73

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:

\_\_\_\_\_  
罗登攀  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
周立新  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
周立新  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成价值增长证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]第 58 号《关于同意大成价值增长证券投资基金设立的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《大成价值增长证券投资基金基金契约》(后更名为《大成价值增长证券投资基金基金合同》)发起,并于 2002 年 11 月 11 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,603,664,854.20 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 124 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成价值增长证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,主要投资对象为深、沪两市 A 股中 P/B 值低、具有良好增长潜力的上市公司。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 14 日发布的《大成价值增长证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》,自 2015 年 9 月 14 日起,本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%”变更为“沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%”。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成价值增长证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累

计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种



的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对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，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	20,308,059.61	230,887,282.86
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	20,308,059.61	230,887,282.86

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,761,325,677.30	2,778,414,439.27	17,088,761.97
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	619,868,432.03	618,581,132.18
	银行间市场	99,240,550.00	99,955,000.00
	合计	719,108,982.03	718,536,132.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,480,434,659.33	3,496,950,571.45	16,515,912.12
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,117,507,860.00	2,248,211,540.18	130,703,680.18
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	350,685,494.70	350,668,551.50
	银行间市场	700,298,893.53	702,806,000.00
	合计	1,050,984,388.23	1,053,474,551.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,168,492,248.23	3,301,686,091.68	133,193,843.45

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	13,926.10	64,066.57
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5,204.30	6,290.00
应收债券利息	12,939,616.67	21,739,595.08
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	768.80	1,839.80
合计	12,959,515.87	21,811,791.45

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,701,248.30	7,463,516.35
银行间市场应付交易费用	-	5,277.74
合计	2,701,248.30	7,468,794.09

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付赎回费	2,871.95	10,083.04
预提费用	330,000.00	270,000.00
合计	332,871.95	280,083.04

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,309,211,183.72	2,309,211,183.72
本期申购	2,005,403,937.80	2,005,403,937.80
本期赎回（以“-”号填列）	-837,208,759.58	-837,208,759.58
本期末	3,477,406,361.94	3,477,406,361.94

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,558,692,167.22	-792,372,669.21	766,319,498.01
本期利润	130,284,033.11	-116,677,931.33	13,606,101.78
本期基金份额交易产生的变动数	425,850,369.12	-514,464,726.72	-88,614,357.60
其中：基金申购款	747,678,147.61	-861,122,863.54	-113,444,715.93
基金赎回款	-321,827,778.49	346,658,136.82	24,830,358.33
本期已分配利润	-696,664,498.68	-	-696,664,498.68
本期末	1,418,162,070.77	-1,423,515,327.26	-5,353,256.49

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
	活期存款利息收入	1,305,581.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	164,703.98	179,772.32
其他	39,558.61	40,667.99
合计	1,509,844.55	3,838,178.66

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	8,338,816,169.69	18,327,963,303.59
减：卖出股票成本总额	8,167,905,750.15	14,927,158,210.40
买卖股票差价收入	170,910,419.54	3,400,805,093.19

#### 7.4.7.13 债券投资收益

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,349,065,806.79	2,703,149,943.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,318,328,812.87	2,502,699,063.22
减：应收利息总额	31,828,152.43	61,178,688.76
买卖债券差价收入	-1,091,158.51	139,272,191.81

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	21,387,340.99	37,063,515.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	21,387,340.99	37,063,515.49

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-116,677,931.33	-781,706,781.13
——股票投资	-113,614,918.21	-644,520,079.52
——债券投资	-3,063,013.12	-137,186,701.61
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-116,677,931.33	-781,706,781.13

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
基金赎回费收入	496,939.68	4,757,318.03
转换费收入	10,835.77	52,091.56
其他	-	7,419.62
合计	507,775.45	4,816,829.21

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	25,454,824.68	48,527,437.84
银行间市场交易费用	1,925.00	12,325.00
合计	25,456,749.68	48,539,762.84

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	150,000.00	170,000.00
信息披露费	380,000.00	380,000.00
其他	1,400.00	1,200.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行划款手续费	34,756.13	66,336.83
合计	602,156.13	653,536.83

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## 7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
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
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
中泰信托有限责任公司	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管理有限公司(以下简称“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股份有限公司将所持大成基金 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. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	4,266,485,277.98	24.95%	5,428,137,599.48	18.11%

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	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 成交总额的比 例
光大证券	144,916,316.49	12.84%	-	0.00%

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
光大证券	342,000,000.00	9.58%	-	0.00%

## 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	3,888,097.51	24.94%	52,198.64	1.93%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	4,898,612.10	18.09%	1,685,598.05	22.58%

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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 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	42,642,786.84	70,931,547.10
其中：支付销售机构的客户维护费	6,069,204.46	11,189,138.64

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。

### 7.4.10.2.2 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	7,107,131.13	11,821,924.48

注：支付基金托管人中国农业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。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	420,000,000.00	183,975.34
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	509,700,000.00	1,045,803.84

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资。

**7.4.10.4.2 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**

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

**7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 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
	中国农业银行	20,308,059.61	1,305,581.96	230,887,282.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2016/1/22	2016/1/22	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	
合计	-	-	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	

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

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
000513	丽珠集团	2016 年 9 月 19 日	-	非公开发行流通受限	50.10	52.77	600,000	30,060,000.00	31,662,000.00	-
601000	唐山港	2016 年 12 月 19 日	-	非公开发行流通受限	4.16	4.01	2,403,846	9,999,999.36	9,639,422.46	-
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-

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	1,814	11,881.70	11,881.70	-
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	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
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	1,006	9,355.80	9,355.80	-
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	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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
002635	安洁科技	2016年11月8日	临时停牌	33.74	2017年2月8日	33.50	1,000,067	31,990,557.47	33,742,260.58	-

300537	广信材料	2016 年 10 月 12 日	临时停 牌	48.79	2017 年 1 月 13 日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
--------	------	------------------------	----------	-------	-----------------------	-------	-------	----------	-----------	---

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 130,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 18 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (2015 年 12 月 31 日：0.15%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 130,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、卖出回购金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,308,059.61	-	-	-	20,308,059.61
结算备付金	11,565,103.78	-	-	-	11,565,103.78
存出保证金	1,708,393.78	-	-	-	1,708,393.78
交易性金融资产	686,955,869.68	31,580,262.50	-	2,778,414,439.27	3,496,950,571.45
应收证券清算款	-	-	-	79,038,275.44	79,038,275.44
应收利息	-	-	-	12,959,515.87	12,959,515.87
应收申购款	24,687,568.44	-	-	589,882.19	25,277,450.63
资产总计	745,224,995.29	31,580,262.50	-	2,871,002,112.77	3,647,807,370.56
负债					
卖出回购金融资产款	130,000,000.00	-	-	-	130,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	35,875,549.22	35,875,549.22

应付赎回款	-	-	-	1,472,784.96	1,472,784.96
应付管理人报酬	-	-	-	4,526,176.59	4,526,176.59
应付托管费	-	-	-	754,362.76	754,362.76
应付交易费用	-	-	-	2,701,248.30	2,701,248.30
应付利息	-	-	-	91,271.33	91,271.33
其他负债	-	-	-	332,871.95	332,871.95
负债总计	130,000,000.00	-	-	45,754,265.11	175,754,265.11
利率敏感度缺口	615,224,995.29	31,580,262.50	-	2,825,247,847.66	3,472,053,105.45
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	230,887,282.86	-	-	-	230,887,282.86
结算备付金	13,977,632.35	-	-	-	13,977,632.35
存出保证金	4,088,565.03	-	-	-	4,088,565.03
交易性金融资产	964,938,330.00	51,290,000.00	37,246,221.50	2,248,211,540.18	3,301,686,091.68
应收证券清算款	-	-	-	20,135,953.82	20,135,953.82
应收利息	-	-	-	21,811,791.45	21,811,791.45
应收申购款	1,988.07	-	-	222,240.45	224,228.52
资产总计	1,213,893,798.31	51,290,000.00	37,246,221.50	2,290,381,525.90	3,592,811,545.71
负债					
卖出回购金融资产款	498,998,851.50	-	-	-	498,998,851.50
应付赎回款	-	-	-	5,345,639.67	5,345,639.67
应付管理人报酬	-	-	-	3,967,390.01	3,967,390.01
应付托管费	-	-	-	661,231.64	661,231.64
应付交易费用	-	-	-	7,468,794.09	7,468,794.09
应付利息	-	-	-	558,874.03	558,874.03
其他负债	-	-	-	280,083.04	280,083.04
负债总计	498,998,851.50	-	-	18,282,012.48	517,280,863.98
利率敏感度缺口	714,894,946.81	51,290,000.00	37,246,221.50	2,272,099,513.42	3,075,530,681.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。



#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额	
		影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1.市场利率下降 25 个基点	增加约 60	增加约 128
2.市场利率上升 25 个基点	减少约 59	减少约 127	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金

		产净值比 例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,778,414,439.27	80.02	2,248,211,540.18	73.10
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	2,778,414,439.27	80.02	2,248,211,540.18	73.10

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)	
		2016年12月31日	2015年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加 20,047	增加 15,680
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少 20,047	减少 15,680	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,744,157,581.94 元，属于第二层次的余额为 752,792,989.51 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,075,366,255.60 元，第二层次 1,226,319,836.08 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	2,778,414,439.27	76.17
	其中：股票	2,778,414,439.27	76.17
2	固定收益投资	718,536,132.18	19.70
	其中：债券	718,536,132.18	19.70
	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	31,873,163.39	0.87
7	其他各项资产	118,983,635.72	3.26
8	合计	3,647,807,370.56	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	1,971,184,728.17	56.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	217,081.66	0.01
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	354,929,339.30	10.22
G	交通运输、仓储和邮政业	9,648,881.14	0.28

H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,255,310.60	1.22
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	64,646,488.80	1.86
L	租赁和商务服务业	182,422,839.33	5.25
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	-	0.00
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	98,054,037.74	2.82
S	综合	54,933,360.30	1.58
	合计	2,778,414,439.27	80.02

### 8.2.2 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

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	000625	长安汽车	17,000,078	253,981,165.32	7.32
2	000910	大亚圣象	11,631,182	222,155,576.20	6.40
3	600998	九州通	10,598,190	219,806,460.60	6.33
4	000513	丽珠集团	3,494,046	203,857,737.00	5.87
5	300058	蓝色光标	17,937,349	182,422,839.33	5.25
6	002258	利尔化学	14,371,424	178,636,800.32	5.14
7	000860	顺鑫农业	5,860,513	128,931,286.00	3.71
8	600195	中牧股份	5,129,294	108,997,497.50	3.14
9	300144	宋城演艺	4,408,221	92,308,147.74	2.66
10	002640	跨境通	4,293,813	78,576,777.90	2.26
11	600887	伊利股份	4,371,885	76,945,176.00	2.22
12	600683	京投发展	7,304,688	64,646,488.80	1.86
13	600458	时代新材	4,562,812	64,563,789.80	1.86
14	600498	烽火通信	2,456,116	61,918,684.36	1.78

15	002117	东港股份	2,000,015	59,900,449.25	1.73
16	600217	中再资环	7,000,054	59,080,455.76	1.70
17	002007	华兰生物	1,628,765	58,228,348.75	1.68
18	002126	银轮股份	6,000,002	58,140,019.38	1.67
19	002308	威创股份	3,934,814	57,999,158.36	1.67
20	300224	正海磁材	3,093,227	57,286,564.04	1.65
21	600511	国药股份	1,878,608	56,546,100.80	1.63
22	600500	中化国际	4,840,885	56,444,719.10	1.63
23	000881	大连国际	2,012,211	54,933,360.30	1.58
24	600211	西藏药业	982,650	53,200,671.00	1.53
25	600261	阳光照明	6,053,674	43,707,526.28	1.26
26	002555	三七互娱	2,561,806	42,013,618.40	1.21
27	002120	新海股份	800,100	40,325,040.00	1.16
28	002635	安洁科技	1,000,067	33,742,260.58	0.97
29	002281	光迅科技	400,089	31,406,986.50	0.90
30	002250	联化科技	1,391,902	22,520,974.36	0.65
31	601616	广电电气	2,500,000	16,275,000.00	0.47
32	000070	特发信息	499,926	12,643,128.54	0.36
33	601000	唐山港	2,403,846	9,639,422.46	0.28
34	601311	骆驼股份	391,500	6,393,195.00	0.18
35	600373	中文传媒	284,450	5,745,890.00	0.17
36	002032	苏泊尔	72,376	2,527,369.92	0.07
37	300447	全信股份	5,900	327,332.00	0.01
38	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
39	600969	郴电国际	9,400	179,164.00	0.01
40	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
41	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
42	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
43	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
44	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
45	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
46	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
47	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
48	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
49	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
50	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.00
51	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
52	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
53	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00

54	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
55	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
56	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
57	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
58	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
59	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
60	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
61	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
62	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
63	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
64	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
65	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
66	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
67	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 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	000625	长安汽车	222,164,127.96	7.22
2	000513	丽珠集团	211,296,584.76	6.87
3	600500	中化国际	186,125,029.20	6.05
4	600998	九州通	174,750,942.23	5.68
5	300058	蓝色光标	172,627,088.23	5.61
6	002258	利尔化学	162,836,270.91	5.29
7	000860	顺鑫农业	147,371,637.55	4.79
8	002281	光迅科技	144,819,921.20	4.71
9	002007	华兰生物	139,616,300.65	4.54
10	600683	京投发展	135,781,988.33	4.41
11	000910	大亚圣象	128,963,189.05	4.19
12	600195	中牧股份	119,494,331.24	3.89
13	600211	西藏药业	115,222,933.42	3.75
14	300144	宋城演艺	115,160,266.32	3.74
15	600718	东软集团	108,218,670.28	3.52
16	300224	正海磁材	106,808,444.05	3.47

17	600233	大杨创世	102,190,123.61	3.32
18	002468	艾迪西	100,300,488.82	3.26
19	000881	大连国际	95,986,453.52	3.12
20	600261	阳光照明	95,857,113.38	3.12
21	001979	招商蛇口	95,680,394.53	3.11
22	600373	中文传媒	94,330,213.49	3.07
23	600217	中再资环	91,302,600.14	2.97
24	002120	新海股份	86,834,446.92	2.82
25	002308	威创股份	85,703,987.64	2.79
26	600141	兴发集团	83,474,291.12	2.71
27	600498	烽火通信	83,269,312.07	2.71
28	600038	中直股份	82,804,747.68	2.69
29	600547	山东黄金	82,746,790.09	2.69
30	002597	金禾实业	81,460,748.50	2.65
31	300364	中文在线	80,690,444.88	2.62
32	002640	跨境通	80,372,123.42	2.61
33	600887	伊利股份	79,339,395.29	2.58
34	002009	天奇股份	77,771,320.22	2.53
35	601799	星宇股份	76,199,674.25	2.48
36	002250	联化科技	75,041,312.31	2.44
37	300047	天源迪科	74,866,588.57	2.43
38	002267	陕天然气	74,670,452.11	2.43
39	600458	时代新材	74,458,816.56	2.42
40	600138	中青旅	74,307,496.01	2.42
41	002117	东港股份	73,844,292.35	2.40
42	000895	双汇发展	73,372,311.71	2.39
43	600990	四创电子	70,656,981.35	2.30
44	000802	北京文化	65,544,118.44	2.13
45	002675	东诚药业	65,463,620.45	2.13
46	000403	ST 生化	65,395,983.89	2.13
47	002294	信立泰	64,974,776.18	2.11
48	300090	盛运环保	62,958,018.40	2.05
49	000338	潍柴动力	61,582,119.05	2.00

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	002013	中航机电	164,230,155.65	5.34
2	600718	东软集团	163,789,465.02	5.33
3	600420	现代制药	158,365,495.62	5.15
4	600217	中再资环	153,447,345.69	4.99
5	600500	中化国际	141,042,488.83	4.59
6	600233	大杨创世	137,271,556.12	4.46
7	002281	光迅科技	130,970,599.20	4.26
8	002557	洽洽食品	122,085,866.62	3.97
9	000895	双汇发展	121,618,110.22	3.95
10	601799	星宇股份	121,046,267.22	3.94
11	600138	中青旅	120,618,399.56	3.92
12	000910	大亚圣象	115,365,081.48	3.75
13	600683	京投发展	115,281,974.78	3.75
14	002039	黔源电力	114,241,857.18	3.71
15	300059	东方财富	112,213,450.30	3.65
16	002468	艾迪西	105,473,243.18	3.43
17	300090	盛运环保	101,275,553.88	3.29
18	000881	大连国际	97,536,546.21	3.17
19	001979	招商蛇口	97,101,907.54	3.16
20	600373	中文传媒	95,940,179.38	3.12
21	600547	山东黄金	93,869,754.40	3.05
22	600141	兴发集团	92,577,410.60	3.01
23	600038	中直股份	92,349,070.08	3.00
24	002007	华兰生物	90,483,383.23	2.94
25	002597	金禾实业	90,063,830.78	2.93
26	300364	中文在线	86,604,397.51	2.82
27	300047	天源迪科	84,281,808.18	2.74
28	002675	东诚药业	79,737,517.90	2.59
29	300133	华策影视	78,173,932.63	2.54
30	002009	天奇股份	76,695,009.00	2.49
31	000403	ST 生化	76,363,539.22	2.48
32	002267	陕天然气	76,079,129.82	2.47
33	600211	西藏药业	75,793,082.39	2.46
34	000802	北京文化	74,846,081.27	2.43



35	002264	新华都	73,935,093.09	2.40
36	000338	潍柴动力	73,837,022.59	2.40
37	600990	四创电子	72,309,743.62	2.35
38	000078	海王生物	70,149,030.44	2.28
39	002082	栋梁新材	67,592,921.35	2.20
40	002294	信立泰	67,026,790.34	2.18
41	002142	宁波银行	66,241,397.51	2.15
42	600887	伊利股份	64,206,231.52	2.09
43	300394	天孚通信	63,401,616.83	2.06
44	002317	众生药业	63,164,099.13	2.05

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	8,812,107,346.64
卖出股票收入（成交）总额	8,338,816,169.69

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

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	618,580,262.50	17.82
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	99,955,000.00	2.88
	其中：政策性金融债	99,955,000.00	2.88
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	可转债（可交换债）	869.68	0.00
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	718,536,132.18	20.69

### 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

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	019533	16 国债 05	5,870,000	587,000,000.00	16.91

2	070215	07 国开 15	500,000	50,295,000.00	1.45
3	130216	13 国开 16	500,000	49,660,000.00	1.43
4	010107	21 国债(7)	300,050	31,580,262.50	0.91
5	123001	蓝标转债	8	869.68	0.00

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金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

本基金本报告期末投资股指期货。

### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，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	1,708,393.78
2	应收证券清算款	79,038,275.44
3	应收股利	-
4	应收利息	12,959,515.87
5	应收申购款	25,277,450.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,983,635.72

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	894.68	0.07

### 8.12.5 期末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	000513	丽珠集团	31,662,000.00	0.91	非公开发行

### 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

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
151,437	22,962.73	890,125,334.20	25.60%	2,587,281,027.74	74.40%

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	41,962.22	0.0012%

### 9.3 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（2002年11月11日）基金份额总额	2,604,752,899.89
本报告期期初基金份额总额	2,309,211,183.72
本报告期基金总申购份额	2,005,403,937.80
减：本报告期基金总赎回份额	837,208,759.58
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	3,477,406,361.94

## §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：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度支付的审计费用为 15 万元。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、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	
光大证券		24,266,485,277.98	24.95%	3,888,097.51	24.94%	-
中信建投		22,153,742,566.71	12.59%	1,962,756.86	12.59%	-
中泰证券		11,047,816,814.06	6.13%	954,875.73	6.12%	-
招商证券	2	868,124,613.55	5.08%	791,131.39	5.07%	-
中金公司	3	808,967,877.03	4.73%	741,667.12	4.76%	-
申银万国	1	788,099,065.35	4.61%	718,171.97	4.61%	-
联讯证券	1	777,358,489.09	4.55%	708,415.24	4.54%	-
中信证券	2	755,595,094.58	4.42%	688,568.28	4.42%	-
海通证券	1	665,018,595.54	3.89%	606,029.14	3.89%	-
华泰证券	1	653,782,824.69	3.82%	595,816.34	3.82%	-
兴业证券	2	572,034,282.57	3.35%	521,277.61	3.34%	-
国泰君安	2	497,514,549.73	2.91%	453,391.29	2.91%	-
银河证券	4	474,766,134.81	2.78%	432,654.51	2.77%	-
华创证券	1	400,658,846.85	2.34%	365,125.15	2.34%	-
瑞银证券	1	305,896,942.57	1.79%	278,766.43	1.79%	-
平安证券	1	302,395,761.62	1.77%	279,153.43	1.79%	-
安信证券	1	277,808,643.54	1.62%	253,163.92	1.62%	-
万和证券	1	266,716,950.26	1.56%	243,080.02	1.56%	-
国金证券	2	225,203,964.50	1.32%	205,223.27	1.32%	-
民生证券	1	198,357,719.57	1.16%	180,764.95	1.16%	-
广发证券	2	195,274,650.97	1.14%	177,981.32	1.14%	-
上海证券	1	162,105,301.52	0.95%	147,711.68	0.95%	-
中银国际	2	127,326,966.96	0.74%	116,038.14	0.74%	-
北京高华	1	114,082,302.02	0.67%	103,963.97	0.67%	-
东吴证券	1	107,411,743.36	0.63%	97,902.83	0.63%	-
国信证券	1	87,946,326.80	0.51%	80,144.03	0.51%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-

红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：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。

本报告期内增加基金交易单元：爱建证券、东方证券、中原证券、中金公司、广发证券、东吴证券、万和证券。本报告期内本基金退租席位：无。

## 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
光大证券	144,916,316.49	12.84%	342,000,000.00	9.58%	-	0.00%
中信建投	121,697,166.27	10.78%	250,000,000.00	7.00%	-	0.00%
中泰证券	164,369,926.39	14.56%	150,000,000.00	4.20%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	150,000,000.00	4.20%	-	0.00%
申银万国	91,362,235.21	8.09%	310,000,000.00	8.68%	-	0.00%
联讯证券	15,067,340.20	1.33%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	173,751,693.20	15.39%	400,000,000.00	11.20%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	11,165,249.43	0.99%	150,000,000.00	4.20%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	4,519,303.40	0.40%	500,000,000.00	14.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	24,000,000.00	0.67%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	50,000,000.00	1.40%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	535,000,000.00	14.98%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万和证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	242,924,919.22	21.52%	300,000,000.00	8.40%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	-	0.00%	100,000,000.00	2.80%	-	0.00%
中银国际	158,941,296.77	14.08%	160,000,000.00	4.48%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	100,000,000.00	2.80%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	50,000,000.00	1.40%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
第一创业	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%



湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
川财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
爱建证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中原证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申万宏源	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
山西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成基金管理有限公司增加上海万得投资顾问有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月30日
2	大成基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月27日
3	大成价值增长证券投资基金更新招募说明书（2016年第2期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月26日
4	大成价值增长证券投资基金更新招募说明书（2016年第2期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月26日

5	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 12 月 22 日
6	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 12 月 12 日
7	关于增加上海华信证券有限责任公司为开放式基金销售机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 11 月 11 日
8	大成基金管理有限公司关于增加东海期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 10 月 29 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 10 月 26 日
10	大成价值增长证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 10 月 24 日
11	大成基金管理有限公司旗下部分基金产品增加南京证券股份有限公司为销售机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 10 月 24 日
12	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 10 月 18 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 9 月 21 日
14	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 8 月 30 日
15	大成价值增长证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 8 月 25 日

16	大成价值增长证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 8 月 25 日
17	大成基金管理有限公司关于增加 上海长量基金销售投资顾问有限 公司为开放式基金代销机构并开 通相关业务的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 27 日
18	大成价值增长证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 20 日
19	大成基金管理有限公司关于增加 宏信证券有限责任公司为开放式 基金代销机构并开通相关业务的 公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 16 日
20	大成基金管理有限公司关于增加 北京晟视天下投资管理有限公司 为开放式基金代销机构并开通相 关业务的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 9 日
21	大成基金关于旗下部分基金增加 汉口银行股份有限公司为代销机 构的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日
22	大成价值增长证券投资基金更新 招募说明书（2016 年第 1 期）- 摘要	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日
23	大成价值增长证券投资基金更新 招募说明书（2016 年第 1 期）	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日
24	大成基金管理有限公司关于增加 泰诚财富基金销售（大连）有限 公司为开放式基金代销机构并开 通相关业务的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 22 日
25	大成基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报	2016 年 6 月 16 日

	部分基金增加万联证券有限责任公司为代销机构的公告	刊及本公司网站	
26	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 17 日
27	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 7 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
29	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 4 日
30	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 30 日
31	大成价值增长证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
32	大成价值增长证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
33	大成价值增长证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
34	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 24 日
35	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 22 日

36	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 17 日
37	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 12 日
38	大成基金管理有限公司关于增加北京蕙次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
39	大成基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 18 日
40	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 30 日
41	大成价值增长证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
42	大成价值增长证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
43	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 12 日
44	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 12 月 22 日
45	大成基金管理有限公司关于撤销上海理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 9 月 21 日

46	大成基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 9 月 20 日
47	大成基金管理有限公司关于撤销 福州分公司的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 8 月 6 日
48	大成基金管理有限公司关于网上 直销端通联-民生银行支付渠道 维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 8 月 5 日
49	关于调整直销网上交易系统通联 支付交通银行渠道认申购费率优 惠的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 7 月 19 日
50	大成基金管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日
51	大成基金管理有限公司关于网上 直销端通联支付渠道维护暂停服 务的通知大成基金管理有限公司 关于网上直销端通联支付渠道维 护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 18 日
52	大成基金管理有限公司关于网上 直销端通联支付渠道维护暂停服 务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 29 日
53	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	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 27 日
54	大成基金管理有限公司关于支付 宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 18 日
55	关于网上直销端建设银行进行系 统维护暂停服务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 15 日
56	大成基金管理有限公司关于网上 直销端通联支付渠道维护暂停服 务的通知	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 14 日

57	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 29 日
58	大成基金管理有限公司关于网上直销端中国银行渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 25 日
59	大成基金管理有限公司关于网上直销端民生银行渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 25 日
60	大成基金管理有限公司关于网上直销端暂停申购交易业务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 3 日
61	大成基金管理有限公司关于网上直销端银联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 26 日
62	大成基金管理有限公司关于网上交易 PC 端银联支付渠道升级暂停部分服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 22 日
63	大成基金管理有限公司关于网上交易通联系统升级暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 19 日
64	大成基金管理有限公司关于网上交易 PC 端银联支付渠道升级暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 15 日
65	大成基金管理有限公司关于网上交易通联系统升级暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 14 日
66	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 8 日
67	关于旗下场内基金在指数熔断期	中国证监会指定报刊	2016 年 1 月 6 日

	间暂停申购赎回业务的提示性公告	刊及本公司网站	
68	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 5 日

## §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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成价值增长证券投资基金的文件；
- 2、《大成价值增长证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成价值增长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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

### 13.3 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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司  
2017年3月25日