

大成核心双动力混合型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§ 8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.12 投资组合报告附注.....	51
§ 9 基金份额持有人信息.....	51
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.....	52
§ 10 开放式基金份额变动.....	52
§ 11 重大事件揭示.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	54
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§ 13 备查文件目录.....	60
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心双动力混合型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力混合
基金主代码	090011
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
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
报告期末基金份额总额	309,489,012.68份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95588
传真	0755-83199588	010-66105798
注册地址	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	刘卓	易会满

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》
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	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司

	北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行 托管业务部
--	----------------------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	1,246,347.20	35,841,381.10	16,559,368.91
本期利润	-1,455,342.32	30,383,651.20	19,523,569.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0364	0.6373	0.1531
本期加权平均净值利润率	-2.60%	43.87%	17.47%
本期基金份额净值增长率	-2.82%	41.45%	25.86%
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	678,399.81	19,932,924.35	-3,788.33
期末可供分配基金份额利润	0.0022	0.5966	0.0000
期末基金资产净值	310,167,412.49	53,345,296.68	91,247,545.31
期末基金份额净值	1.002	1.597	1.129
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	55.20%	59.70%	12.90%

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。

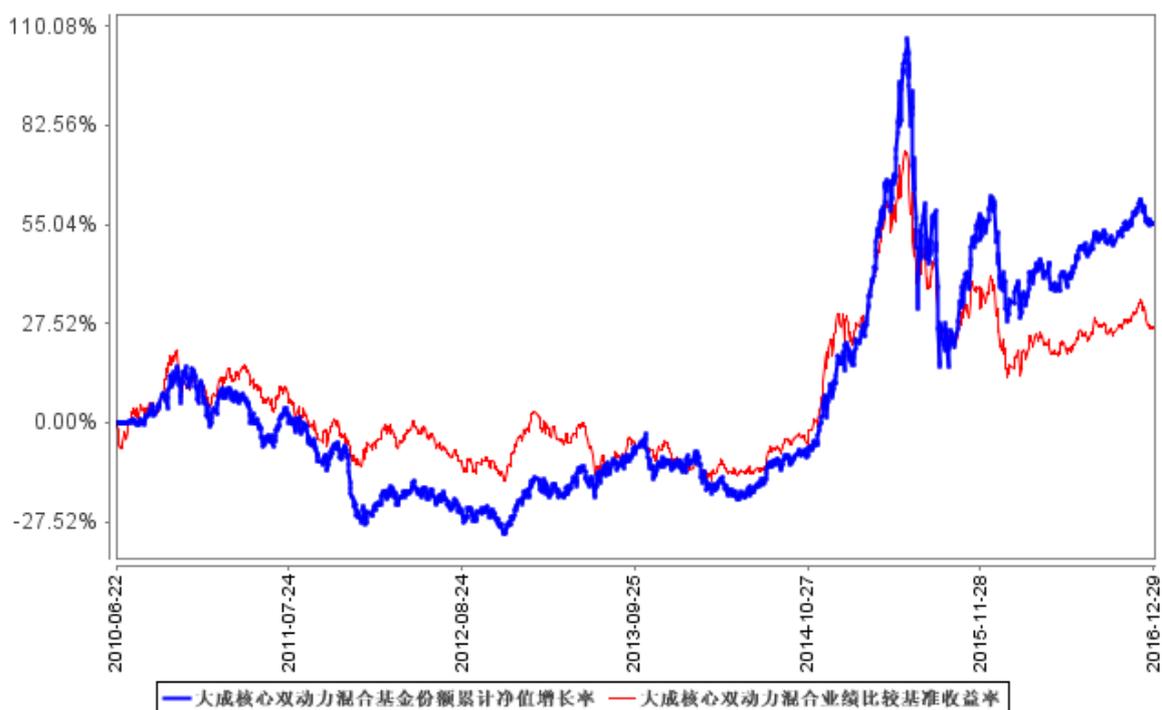
3.2 基金净值表现

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	3.05%	0.59%	0.98%	0.54%	2.07%	0.05%

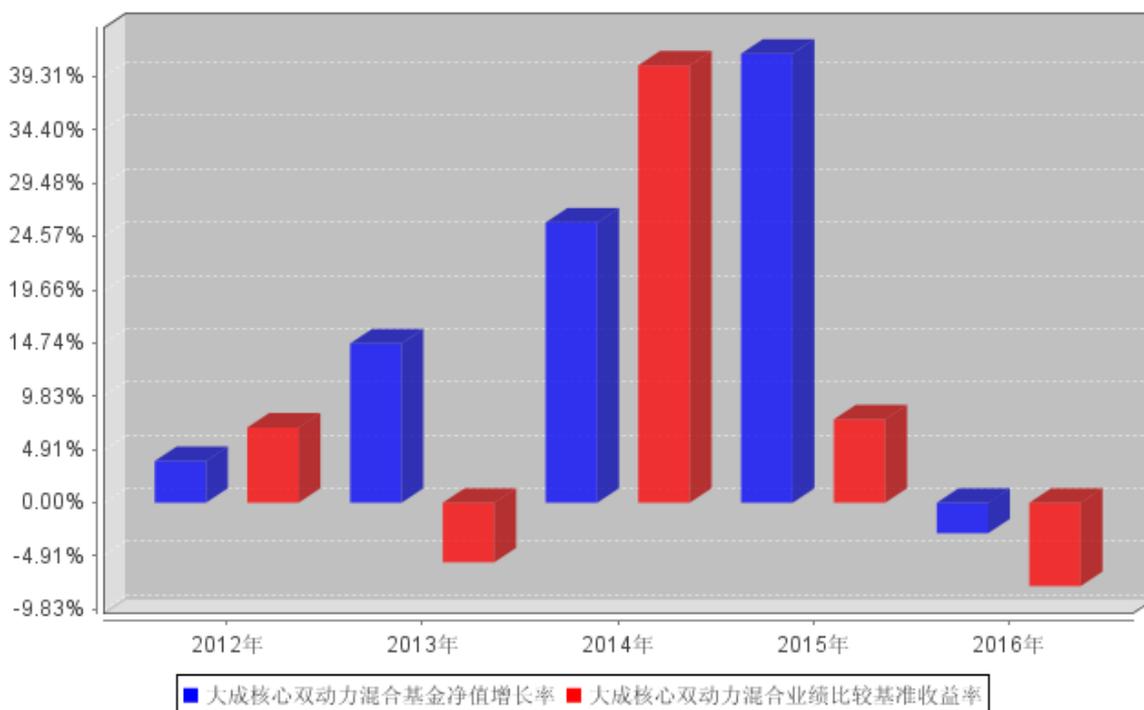
过去六个月	8.30%	0.61%	3.89%	0.57%	4.41%	0.04%
过去一年	-2.82%	1.19%	-7.69%	1.05%	4.87%	0.14%
过去三年	73.02%	1.69%	39.56%	1.34%	33.46%	0.35%
过去五年	106.11%	1.50%	41.08%	1.22%	65.03%	0.28%
自基金合同生效起至今	55.20%	1.42%	26.59%	1.18%	28.61%	0.24%

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。

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
2016	5.5000	199,095,826.05	6,768,633.58	205,864,459.63	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	5.5000	199,095,826.05	6,768,633.58	205,864,459.63	

§ 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 2 月 28 日	-	7 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
苏秉毅先生	本基金基金经理 数量与指数投资部总监	2016 年 3 月 4 日	-	13 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 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 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资

					基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国
石国武先生	本基金基金经理，大类资产配置部总监	2014 年 8 月 23 日	2016 年 3 月 8 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 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 日至 2017 年 3 月 18 日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 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。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。现任大类资产配置部总监。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《大成核心双动力混合型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，大成核心双动力混合型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。

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

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 1.002 元。本报告期内基金份额净值增长率为-2.82%，同期业绩比较基准收益率-7.69%，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，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。

我们认为在经济增速下台阶，中长期调整经济增长模式的宏观背景下，更多的投资机会来自在经济转型过程中快速成长的新兴产业，和在新形势下积极转变发展模式的传统行业。我们将精选受益于供给侧改革、一带一路等政策的蓝筹股构建核心组合，同时选择受益于经济结构调整的成长股和业绩持续增长、估值合理的小市值个股进行投资。

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、制度执行及遵纪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数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。

4.8 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。本报告期内本基金已分配利润 205,864,459.63 元（每十份基金份额分红 5.50 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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，本基金托管人在对大成核心双动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，大成核心双动力混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成核心双动力混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 205,864,459.63 元。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	大成核心双动力混合型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核心双动力混合型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、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基金管理人大成基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，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	<p>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。</p> <p>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基金管理人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	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	昌 华	高 鹤
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
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：大成核心双动力混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	271,692,448.80	13,474,448.43
结算备付金		163,820.84	82,075.45
存出保证金		14,834.41	15,582.16
交易性金融资产	7.4.7.2	38,438,402.83	39,981,409.47
其中：股票投资		38,438,402.83	39,952,844.67
基金投资		-	-
债券投资		-	28,564.80
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	29,480.99	2,836.51
应收股利		-	-
应收申购款		145,683.65	82,152.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		310,484,671.52	53,638,504.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		19,105.69	1,201.06
应付赎回款		1,489.94	43,269.87
应付管理人报酬		131,404.81	67,030.81
应付托管费		21,900.78	11,171.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	33,352.19	30,523.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	110,005.62	140,011.09
负债合计		317,259.03	293,208.21
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	309,489,012.68	33,412,372.33

未分配利润	7.4.7.10	678,399.81	19,932,924.35
所有者权益合计		310,167,412.49	53,345,296.68
负债和所有者权益总计		310,484,671.52	53,638,504.89

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.002 元，基金份额总额 309,489,012.68 份。

7.2 利润表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

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
一、收入		14,227.67	32,527,443.26
1. 利息收入		139,126.33	59,735.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	122,119.18	59,715.92
债券利息收入		59.38	19.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,947.77	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,470,465.21	37,873,917.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,911,361.11	37,033,557.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,893.24	-
资产支持证券投资收益		-	-
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	556,210.86	840,360.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,701,689.52	-5,457,729.90
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	106,325.65	51,519.69
减：二、费用		1,469,569.99	2,143,792.06
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	805,740.38	1,037,734.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	134,290.07	172,955.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	250,846.64	571,001.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7.4.7.20	278,692.90	362,101.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,455,342.32	30,383,651.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,455,342.32	30,383,651.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力混合型证券投资基金

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）	33,412,372.33	19,932,924.35	53,345,296.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,455,342.32	-1,455,342.32
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）	276,076,640.35	188,065,277.41	464,141,917.76
其中：1. 基金申购款	359,181,453.85	193,362,157.35	552,543,611.20
2. 基金赎回款	-83,104,813.50	-5,296,879.94	-88,401,693.44
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）	-	-205,864,459.63	-205,864,459.63
五、期末所有者权益（基金净值）	309,489,012.68	678,399.81	310,167,412.49
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）	80,820,443.73	10,427,101.58	91,247,545.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	30,383,651.20	30,383,651.20

润)			
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)	-47,408,071.40	-20,877,828.43	-68,285,899.83
其中：1. 基金申购款	30,148,374.27	16,054,062.47	46,202,436.74
2. 基金赎回款	-77,556,445.67	-36,931,890.90	-114,488,336.57
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)	33,412,372.33	19,932,924.35	53,345,296.68

注：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 基金基本情况

大成核心双动力混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2010]591号文《关于核准大成核心双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2010年6月22日正式生效，首次设立募集规模为1,173,262,454.69份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(简称“工商银行”)。

根据中国证监会2014年7月7日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，自2015年7月22日起本基金名称变更为“大成核心双动力混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成核心双动力混合”；基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

本基金的投资对象为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的股票、债券、权证及法律、法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金是混合型基金，对股票类资产的投资比例不低于基金资产的60%，在满足股票投资比例要求的基础上，可以投资于非股票类金融工具。本基金股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%；权证不超过基金资产净值的3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-40%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×75%+中证综合债

券指数×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产及贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券等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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

(3) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

(4) 每一基金份额享有同等分配权。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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。

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。

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。

7.4.7 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	271,692,448.80	13,474,448.43
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	271,692,448.80	13,474,448.43

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	37,353,976.76	38,438,402.83	1,084,426.07
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,353,976.76	38,438,402.83	1,084,426.07

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	36,173,293.88	39,952,844.67	3,779,550.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	22,000.00	28,564.80
	银行间市场	-	-
	合计	22,000.00	28,564.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	36,195,293.88	39,981,409.47	3,786,115.59

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

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	29,398.46	2,770.80
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	73.80	37.00
应收债券利息	-	19.58
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	2.13	2.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	6.60	7.00
合计	29,480.99	2,836.51

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

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	33,352.19	30,523.58
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	33,352.19	30,523.58

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5.62	11.09
预提审计费	30,000.00	40,000.00
预提信息披露费	80,000.00	100,000.00
其他	-	-
合计	110,005.62	140,011.09

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	33,412,372.33	33,412,372.33
本期申购	359,181,453.85	359,181,453.85
本期赎回（以“-”号填列）	-83,104,813.50	-83,104,813.50
本期末	309,489,012.68	309,489,012.68

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

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	20,330,727.12	-397,802.77	19,932,924.35
本期利润	1,246,347.20	-2,701,689.52	-1,455,342.32
本期基金份额交易产生的变动数	214,960,916.28	-26,895,638.87	188,065,277.41
其中：基金申购款	228,833,185.41	-35,471,028.06	193,362,157.35
基金赎回款	-13,872,269.13	8,575,389.19	-5,296,879.94
本期已分配利润	-205,864,459.63	-	-205,864,459.63
本期末	30,673,530.97	-29,995,131.16	678,399.81

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	120,833.90	56,308.77
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	1,139.96	2,453.65
其他	145.32	953.50
合计	122,119.18	59,715.92

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 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
卖出股票成交总额	83,954,298.22	214,550,875.84
减：卖出股票成本总额	82,042,937.11	177,517,318.11
买卖股票差价收入	1,911,361.11	37,033,557.73

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,893.24	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,893.24	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	24,928.20	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,000.00	-
减：应收利息总额	34.96	-

买卖债券差价收入	2,893.24	-
----------	----------	---

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资产生的收益/损失。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

7.4.7.16 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	556,210.86	840,360.24
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	556,210.86	840,360.24

7.4.7.17 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	-2,701,689.52	-5,457,729.90
——股票投资	-2,695,124.72	-5,464,294.70
——债券投资	-6,564.80	6,564.80
——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	-2,701,689.52	-5,457,729.90

7.4.7.18 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	105,751.24	42,897.60
转换费收入	574.41	8,622.09

合计	106,325.65	51,519.69
----	------------	-----------

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，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 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	250,846.64	571,001.21
银行间市场交易费用	-	-
合计	250,846.64	571,001.21

7.4.7.20 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	30,000.00	40,000.00
信息披露费	240,000.00	300,000.00
银行汇划费用	2,692.90	4,101.02
中债登债券托管帐户维护费	6,000.00	18,000.00
合计	278,692.90	362,101.02

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 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	805,740.38	1,037,734.17
其中：支付销售机构的客户维护费	264,906.57	366,860.11

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 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2016 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 131,404.81 元 (2015 年 12 月 31 日：人民币 67,030.81 元)。

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	134,290.07	172,955.66

注：(1)基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2016 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 21,900.78 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 11,171.80 元）。

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

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

无

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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资于本基金。

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		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
中国工商银行	271,692,448.80	120,833.90	13,474,448.43	56,308.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期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
		场内	场外					
1	2016/12/27	-	2016/12/27	5.5000	199,095,826.05	6,768,633.58	205,864,459.63	
合计		-	-	5.5000	199,095,826.05	6,768,633.58	205,864,459.63	

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
601375	中原 证券	2016/12/20	2017/1/3	新股 流通 受限	4.00	4.00	6,919	27,676.00	27,676.00	-

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
600406	国电 南瑞	2016/12/29	重大事 项临时 停牌	16.63	-	-	10,600	145,040.90	176,278.00	-
000916	华北 高速	2016/6/27	重大事 项临时 停牌	5.01	-	-	27,200	132,778.00	136,272.00	-
603308	应流 股份	2016/11/24	重大事 项临时 停牌	21.92	2017/2/14	21.92	5,000	98,700.00	109,600.00	-
603169	兰石 重装	2016/11/24	重大事 项临时 停牌	13.36	2017/3/21	14.32	8,000	99,440.00	106,880.00	-
603399	新华 龙	2016/10/20	重大事 项临时 停牌	11.21	-	-	7,700	76,153.00	86,317.00	-

600331	宏达股份	2016/10/21	重大事件临时停牌	6.36	2017/1/23	5.85	12,000	77,880.00	76,320.00	-
600859	王府井	2016/9/27	重大事件临时停牌	16.28	-	-	3,000	49,413.00	48,840.00	-
600485	信威集团	2016/12/26	重大事件临时停牌	14.60	-	-	3,100	56,018.92	45,260.00	-
000166	申万宏源	2016/12/21	重大事件临时停牌	6.25	2017/1/26	6.29	5,800	37,932.00	36,250.00	-
300367	东方网力	2016/12/15	重大事件临时停牌	20.04	-	-	800	19,296.00	16,032.00	-

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

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。

7.4.12.3.2 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。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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。本基金所持有的证券在证券交易所上市，于本期末，除附注 7.4.12 期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。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可回购交易债券投资的公允价值。于资产负债表日，本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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因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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	271,692,448.80	-	-	-	271,692,448.80
结算备付金	163,820.84	-	-	-	163,820.84
存出保证金	14,834.41	-	-	-	14,834.41
交易性金融资产	-	-	-	38,438,402.83	38,438,402.83
应收利息	-	-	-	29,480.99	29,480.99
应收申购款	496.42	-	-	145,187.23	145,683.65
资产总计	271,871,600.47	-	-	38,613,071.05	310,484,671.52
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19,105.69	19,105.69
应付赎回款	-	-	-	1,489.94	1,489.94
应付管理人报酬	-	-	-	131,404.81	131,404.81
应付托管费	-	-	-	21,900.78	21,900.78
应付交易费用	-	-	-	33,352.19	33,352.19
其他负债	-	-	-	110,005.62	110,005.62
负债总计	-	-	-	317,259.03	317,259.03
利率敏感度缺口	271,871,600.47	-	-	38,295,812.02	310,167,412.49
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	13,474,448.43	-	-	-	13,474,448.43
结算备付金	82,075.45	-	-	-	82,075.45
存出保证金	15,582.16	-	-	-	15,582.16
交易性金融资产	-	-	28,564.80	39,952,844.67	39,981,409.47
应收利息	-	-	-	2,836.51	2,836.51
应收申购款	19,792.18	-	-	62,360.69	82,152.87
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,591,898.22	-	28,564.80	40,018,041.87	53,638,504.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,201.06	1,201.06

应付赎回款	-	-	-	43,269.87	43,269.87
应付管理人报酬	-	-	-	67,030.81	67,030.81
应付托管费	-	-	-	11,171.80	11,171.80
应付交易费用	-	-	-	30,523.58	30,523.58
其他负债	-	-	-	140,011.09	140,011.09
负债总计	-	-	-	293,208.21	293,208.21
利率敏感度缺口	13,591,898.22	-	28,564.80	39,724,833.66	53,345,296.68

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2016 年 12 月 31 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，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，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	38,438,402.83	12.39	39,952,844.67	74.89
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	38,438,402.83	12.39	39,952,844.67	74.89

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数上升5%	17,140,009.60	3,324,356.70
75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数下降5%	-17,140,009.60	-3,324,356.70	

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

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币37,572,677.83元，划分为第二层次的余额为人民币865,725.00元，无划分为第三层次余额。（于2015年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币37,707,800.67元，划分为第二层次的余额为人民币2,273,608.80元，无划分为第三层次余额。）

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(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	38,438,402.83	12.38
	其中：股票	38,438,402.83	12.38
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	271,856,269.64	87.56
7	其他各项资产	189,999.05	0.06
8	合计	310,484,671.52	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	94,789.00	0.03
B	采矿业	626,038.00	0.20
C	制造业	16,211,013.96	5.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,859,557.68	0.60
E	建筑业	1,207,831.00	0.39
F	批发和零售业	1,826,908.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	2,144,033.00	0.69
H	住宿和餐饮业	66,294.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,786,285.00	0.58
J	金融业	8,687,693.63	2.80
K	房地产业	1,995,551.00	0.64
L	租赁和商务服务业	930,555.00	0.30

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	180,580.56	0.06
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	685,809.00	0.22
S	综合	135,464.00	0.04
	合计	38,438,402.83	12.39

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末无沪港通投资。

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	601009	南京银行	65,460	709,586.40	0.23
2	600816	安信信托	29,800	703,876.00	0.23
3	601939	建设银行	128,400	698,496.00	0.23
4	601988	中国银行	199,300	685,592.00	0.22
5	002142	宁波银行	41,100	683,904.00	0.22
6	601318	中国平安	19,068	675,579.24	0.22
7	600016	民生银行	73,400	666,472.00	0.21
8	601288	农业银行	213,800	662,780.00	0.21
9	601099	太平洋	126,100	649,415.00	0.21
10	600958	东方证券	40,883	634,912.99	0.20
11	601377	兴业证券	82,900	634,185.00	0.20
12	000415	渤海金控	83,600	597,740.00	0.19
13	600873	梅花生物	90,600	590,712.00	0.19
14	601668	中国建筑	64,200	568,812.00	0.18
15	000568	泸州老窖	16,500	544,500.00	0.18
16	600383	金地集团	36,300	470,448.00	0.15
17	600048	保利地产	47,400	432,762.00	0.14
18	001979	招商蛇口	25,700	421,223.00	0.14
19	000338	潍柴动力	39,700	395,412.00	0.13
20	601633	长城汽车	35,700	394,842.00	0.13
21	000333	美的集团	12,700	357,759.00	0.12
22	600060	海信电器	20,300	347,536.00	0.11

23	600350	山东高速	49,700	322,056.00	0.10
24	600021	上海电力	26,500	321,710.00	0.10
25	600031	三一重工	51,100	311,710.00	0.10
26	000425	徐工机械	92,100	311,298.00	0.10
27	000623	吉林敖东	9,900	306,801.00	0.10
28	600221	海南航空	94,000	306,440.00	0.10
29	002241	歌尔股份	11,500	304,980.00	0.10
30	601238	广汽集团	12,600	291,942.00	0.09
31	601333	广深铁路	57,500	291,525.00	0.09
32	002456	欧菲光	8,500	291,380.00	0.09
33	000630	铜陵有色	92,400	284,592.00	0.09
34	600115	东方航空	40,200	284,214.00	0.09
35	601607	上海医药	13,900	271,884.00	0.09
36	600252	中恒集团	59,300	271,594.00	0.09
37	601600	中国铝业	62,800	265,016.00	0.09
38	601116	三江购物	6,100	259,555.00	0.08
39	600998	九州通	12,500	259,250.00	0.08
40	600196	复星医药	11,200	259,168.00	0.08
41	300315	掌趣科技	27,900	257,796.00	0.08
42	601989	中国重工	35,900	254,531.00	0.08
43	000027	深圳能源	36,100	248,007.00	0.08
44	600023	浙能电力	45,400	246,522.00	0.08
45	600642	申能股份	41,500	243,605.00	0.08
46	000063	中兴通讯	14,746	235,198.70	0.08
47	601618	中国中冶	50,400	234,864.00	0.08
48	000768	中航飞机	10,700	227,482.00	0.07
49	000400	许继电气	11,800	214,170.00	0.07
50	600037	歌华有线	13,300	203,756.00	0.07
51	300251	光线传媒	20,200	197,152.00	0.06
52	600309	万华化学	9,000	193,770.00	0.06
53	300017	网宿科技	3,600	192,996.00	0.06
54	002153	石基信息	7,700	187,649.00	0.06
55	600028	中国石化	34,500	186,645.00	0.06
56	300133	华策影视	16,400	186,140.00	0.06
57	600688	上海石化	28,900	186,116.00	0.06
58	002195	二三四五	16,200	183,384.00	0.06
59	601933	永辉超市	36,200	177,742.00	0.06
60	600406	国电南瑞	10,600	176,278.00	0.06
61	600019	宝钢股份	27,300	173,355.00	0.06

62	600015	华夏银行	15,700	170,345.00	0.05
63	601601	中国太保	6,100	169,397.00	0.05
64	601166	兴业银行	10,300	166,242.00	0.05
65	601179	中国西电	29,300	163,494.00	0.05
66	600000	浦发银行	10,000	162,100.00	0.05
67	601992	金隅股份	36,300	161,898.00	0.05
68	600648	外高桥	8,100	159,894.00	0.05
69	600074	保千里	11,500	152,260.00	0.05
70	600705	中航资本	24,700	151,164.00	0.05
71	600109	国金证券	11,600	151,148.00	0.05
72	300080	易成新能	14,800	145,632.00	0.05
73	600887	伊利股份	8,200	144,320.00	0.05
74	600022	山东钢铁	56,900	142,250.00	0.05
75	000916	华北高速	27,200	136,272.00	0.04
76	601718	际华集团	14,500	133,545.00	0.04
77	000672	上峰水泥	10,600	130,804.00	0.04
78	600718	东软集团	6,600	129,756.00	0.04
79	601186	中国铁建	10,100	120,796.00	0.04
80	600185	格力地产	19,900	115,619.00	0.04
81	603308	应流股份	5,000	109,600.00	0.04
82	603169	兰石重装	8,000	106,880.00	0.03
83	300058	蓝色光标	10,500	106,785.00	0.03
84	600585	海螺水泥	6,000	101,760.00	0.03
85	002024	苏宁云商	8,700	99,615.00	0.03
86	600291	西水股份	5,100	97,818.00	0.03
87	600703	三安光电	7,280	97,479.20	0.03
88	600200	江苏吴中	4,900	94,619.00	0.03
89	000822	山东海化	13,300	94,297.00	0.03
90	601088	中国神华	5,800	93,844.00	0.03
91	600637	东方明珠	4,000	93,200.00	0.03
92	300269	联建光电	4,000	92,480.00	0.03
93	002004	华邦健康	10,100	91,607.00	0.03
94	000958	东方能源	6,300	91,539.00	0.03
95	600449	宁夏建材	7,400	90,058.00	0.03
96	600282	南钢股份	28,800	89,280.00	0.03
97	300199	翰宇药业	4,900	88,102.00	0.03
98	600596	新安股份	8,600	88,064.00	0.03
99	600831	广电网络	6,700	87,502.00	0.03
100	600035	楚天高速	14,200	87,472.00	0.03

101	000046	泛海控股	9,400	87,326.00	0.03
102	603399	新华龙	7,700	86,317.00	0.03
103	600188	兖州煤业	7,800	84,708.00	0.03
104	000301	东方市场	15,800	84,530.00	0.03
105	600782	新钢股份	25,300	84,502.00	0.03
106	002255	海陆重工	9,600	83,808.00	0.03
107	000789	万年青	10,400	83,512.00	0.03
108	600098	广州发展	7,400	83,028.00	0.03
109	300200	高盟新材	4,600	82,340.00	0.03
110	300214	日科化学	9,000	81,180.00	0.03
111	600051	宁波联合	6,200	81,034.00	0.03
112	600720	祁连山	9,900	80,883.00	0.03
113	600308	华泰股份	14,700	79,968.00	0.03
114	600790	轻纺城	11,100	79,920.00	0.03
115	600507	方大特钢	11,800	79,886.00	0.03
116	600801	华新水泥	10,100	78,275.00	0.03
117	600382	广东明珠	4,300	78,260.00	0.03
118	002529	海源机械	3,700	78,218.00	0.03
119	000159	国际实业	9,200	78,200.00	0.03
120	600475	华光股份	3,900	77,805.00	0.03
121	300082	奥克股份	9,200	77,740.00	0.03
122	000708	大冶特钢	6,100	77,714.00	0.03
123	002420	毅昌股份	7,700	77,693.00	0.03
124	300144	宋城演艺	3,700	77,478.00	0.02
125	600269	赣粤高速	15,400	77,462.00	0.02
126	300046	台基股份	3,100	77,438.00	0.02
127	000572	海马汽车	14,400	77,184.00	0.02
128	601996	丰林集团	8,200	77,080.00	0.02
129	600690	青岛海尔	7,800	77,064.00	0.02
130	000877	天山股份	10,900	76,845.00	0.02
131	002233	塔牌集团	8,200	76,670.00	0.02
132	002427	尤夫股份	3,700	76,627.00	0.02
133	600398	海澜之家	7,100	76,609.00	0.02
134	600331	宏达股份	12,000	76,320.00	0.02
134	600512	腾达建设	14,400	76,320.00	0.02
135	000906	物产中拓	5,200	76,232.00	0.02
136	600853	龙建股份	11,000	76,230.00	0.02
137	000521	美菱电器	11,000	76,120.00	0.02
138	601636	旗滨集团	19,600	76,048.00	0.02

139	000507	珠海港	12,100	75,988.00	0.02
140	300176	鸿特精密	2,500	75,925.00	0.02
141	002088	鲁阳节能	3,900	75,855.00	0.02
142	600798	宁波海运	14,200	75,828.00	0.02
143	601137	博威合金	5,800	75,806.00	0.02
144	600982	宁波热电	13,700	75,350.00	0.02
145	600159	大龙地产	14,100	75,294.00	0.02
146	000528	柳 工	10,300	75,293.00	0.02
147	002580	圣阳股份	4,200	75,222.00	0.02
148	300124	汇川技术	3,700	75,221.00	0.02
149	002604	龙力生物	6,600	75,042.00	0.02
150	002200	云投生态	3,200	74,944.00	0.02
151	600222	太龙药业	8,900	74,582.00	0.02
152	600279	重庆港九	10,300	74,366.00	0.02
153	601766	中国中车	7,600	74,252.00	0.02
154	600283	钱江水利	6,000	74,100.00	0.02
155	000862	银星能源	8,700	73,950.00	0.02
156	600192	长城电工	7,900	73,707.00	0.02
157	601339	百隆东方	11,800	73,632.00	0.02
158	000548	湖南投资	9,100	73,619.00	0.02
159	300084	海默科技	6,300	73,395.00	0.02
160	600368	五洲交通	12,900	73,272.00	0.02
161	601218	吉鑫科技	13,600	73,032.00	0.02
162	000597	东北制药	7,300	73,000.00	0.02
163	600094	大名城	8,200	72,980.00	0.02
164	603968	醋化股份	3,000	72,780.00	0.02
165	000978	桂林旅游	6,400	72,768.00	0.02
166	002394	联发股份	4,100	72,488.00	0.02
167	600121	郑州煤电	13,300	72,485.00	0.02
168	002748	世龙实业	3,600	72,468.00	0.02
169	600509	天富能源	9,700	72,459.00	0.02
170	603788	宁波高发	1,700	72,386.00	0.02
171	600106	重庆路桥	10,300	72,203.00	0.02
172	600510	黑牡丹	8,300	71,629.00	0.02
173	002060	粤 水 电	9,300	71,610.00	0.02
174	002236	大华股份	5,200	71,136.00	0.02
174	002613	北玻股份	9,600	71,136.00	0.02
175	603969	银龙股份	5,100	71,094.00	0.02
176	300035	中科电气	4,800	71,088.00	0.02

177	300040	九洲电气	6,200	71,052.00	0.02
178	601177	杭齿前进	6,700	70,953.00	0.02
179	000756	新华制药	5,700	70,680.00	0.02
180	603003	龙宇燃油	3,500	70,490.00	0.02
181	300139	晓程科技	5,200	70,460.00	0.02
182	002014	永新股份	4,400	70,400.00	0.02
183	600362	江西铜业	4,200	70,266.00	0.02
184	600589	广东榕泰	8,000	70,000.00	0.02
185	600882	广泽股份	6,500	69,810.00	0.02
186	002170	芭田股份	7,500	69,675.00	0.02
187	002406	远东传动	8,100	69,012.00	0.02
188	600737	中粮屯河	5,500	68,530.00	0.02
189	002593	日上集团	9,300	68,448.00	0.02
190	002483	润邦股份	5,800	68,382.00	0.02
190	600333	长春燃气	8,700	68,382.00	0.02
191	002535	林州重机	10,500	68,355.00	0.02
192	002218	拓日新能	7,600	68,324.00	0.02
193	600162	香江控股	17,200	68,284.00	0.02
194	000936	华西股份	6,900	67,551.00	0.02
195	601677	明泰铝业	4,500	66,600.00	0.02
196	002449	国星光电	5,000	66,400.00	0.02
197	000921	海信科龙	6,500	66,365.00	0.02
198	600258	首旅酒店	2,900	66,294.00	0.02
199	000863	三湘印象	7,800	66,222.00	0.02
200	002399	海普瑞	3,600	65,592.00	0.02
201	002465	海格通信	5,600	65,240.00	0.02
202	600178	东安动力	5,900	65,136.00	0.02
203	300148	天舟文化	3,100	64,666.00	0.02
204	000876	新希望	8,000	64,400.00	0.02
205	601872	招商轮船	12,900	63,726.00	0.02
206	600795	国电电力	19,800	62,766.00	0.02
207	600685	中船防务	2,000	59,400.00	0.02
208	000999	华润三九	2,400	59,352.00	0.02
209	601328	交通银行	10,200	58,854.00	0.02
210	000858	五粮液	1,700	58,616.00	0.02
211	600547	山东黄金	1,600	58,416.00	0.02
212	000883	湖北能源	12,596	57,689.68	0.02
213	600794	保税科技	8,700	54,636.00	0.02
214	600153	建发股份	5,100	54,570.00	0.02

215	300070	碧水源	3,103	54,364.56	0.02
216	600415	小商品城	6,200	53,630.00	0.02
217	600036	招商银行	3,000	52,800.00	0.02
218	002303	美盈森	5,000	51,400.00	0.02
219	000631	顺发恒业	10,400	50,960.00	0.02
220	002413	雷科防务	4,400	50,952.00	0.02
221	600055	万东医疗	2,800	50,736.00	0.02
222	601216	君正集团	10,800	50,220.00	0.02
223	300287	飞利信	4,200	49,980.00	0.02
224	300329	海伦钢琴	3,100	49,910.00	0.02
225	002683	宏大爆破	5,600	49,728.00	0.02
226	002527	新时达	3,700	49,617.00	0.02
227	600859	王府井	3,000	48,840.00	0.02
228	600373	中文传媒	2,400	48,480.00	0.02
229	300419	浩丰科技	1,700	48,382.00	0.02
230	000156	华数传媒	2,700	48,357.00	0.02
231	601882	海天精工	1,883	47,526.92	0.02
232	600201	生物股份	1,500	47,385.00	0.02
233	002417	三元达	2,900	47,125.00	0.02
234	600485	信威集团	3,100	45,260.00	0.01
235	002536	西泵股份	3,200	45,184.00	0.01
236	000895	双汇发展	2,100	43,953.00	0.01
237	002152	广电运通	3,300	43,824.00	0.01
238	002517	恺英网络	1,300	43,628.00	0.01
239	002739	万达院线	800	43,256.00	0.01
240	600827	百联股份	2,900	41,644.00	0.01
241	300002	神州泰岳	4,500	41,580.00	0.01
242	601800	中国交建	2,700	41,013.00	0.01
243	002111	威海广泰	1,900	40,660.00	0.01
244	002322	理工环科	1,700	40,562.00	0.01
245	002445	中南文化	2,700	40,527.00	0.01
246	600289	亿阳信通	3,100	40,145.00	0.01
247	601998	中信银行	6,100	39,101.00	0.01
248	000709	河钢股份	11,500	38,410.00	0.01
249	600008	首创股份	8,900	36,579.00	0.01
250	000166	申万宏源	5,800	36,250.00	0.01
251	002450	康得新	1,874	35,812.14	0.01
252	000825	太钢不锈	9,000	35,460.00	0.01
253	002033	丽江旅游	2,400	34,560.00	0.01

254	600741	华域汽车	2,000	31,900.00	0.01
255	000413	东旭光电	2,800	31,528.00	0.01
256	600340	华夏幸福	1,300	31,070.00	0.01
257	601375	中原证券	6,919	27,676.00	0.01
258	002422	科伦药业	1,600	25,792.00	0.01
259	600029	南方航空	3,300	23,166.00	0.01
260	600895	张江高科	1,300	23,036.00	0.01
261	000612	焦作万方	1,900	21,945.00	0.01
262	002007	华兰生物	600	21,450.00	0.01
263	002366	台海核电	400	21,448.00	0.01
264	603519	立霸股份	700	21,021.00	0.01
265	601111	中国国航	2,900	20,880.00	0.01
266	000002	万科A	1,000	20,550.00	0.01
267	002734	利民股份	600	20,532.00	0.01
268	002076	雪莱特	1,500	20,295.00	0.01
269	002699	美盛文化	600	20,280.00	0.01
270	603268	松发股份	400	20,180.00	0.01
271	002481	双塔食品	2,200	19,954.00	0.01
272	002215	诺普信	1,800	19,944.00	0.01
273	002594	比亚迪	400	19,872.00	0.01
274	300087	荃银高科	1,500	19,845.00	0.01
275	600337	美克家居	1,400	19,824.00	0.01
276	601566	九牧王	1,100	19,459.00	0.01
277	002600	江粉磁材	1,900	19,456.00	0.01
278	000407	胜利股份	2,100	19,341.00	0.01
279	000929	兰州黄河	1,000	19,300.00	0.01
280	600667	太极实业	2,500	19,275.00	0.01
281	002606	大连电瓷	400	19,272.00	0.01
282	300083	劲胜精密	2,600	19,110.00	0.01
283	300264	佳创视讯	1,800	19,080.00	0.01
284	600160	巨化股份	1,800	19,044.00	0.01
285	002168	深圳惠程	1,200	19,032.00	0.01
286	002595	豪迈科技	900	18,945.00	0.01
287	600749	西藏旅游	800	18,888.00	0.01
288	600612	老凤祥	500	18,615.00	0.01
289	002372	伟星新材	1,200	18,516.00	0.01
290	600582	天地科技	3,700	18,389.00	0.01
291	600482	中国动力	600	18,324.00	0.01
292	002717	岭南园林	700	18,186.00	0.01

293	600511	国药股份	600	18,060.00	0.01
294	002058	威尔泰	600	17,928.00	0.01
295	603718	海利生物	1,000	17,820.00	0.01
296	600620	天宸股份	1,100	17,809.00	0.01
297	002085	万丰奥威	900	17,784.00	0.01
298	002557	洽洽食品	1,100	17,666.00	0.01
299	002032	苏泊尔	500	17,460.00	0.01
300	600515	海航基础	1,500	17,400.00	0.01
301	300048	合康新能	2,100	17,262.00	0.01
302	000938	紫光股份	300	17,217.00	0.01
303	300247	乐金健康	2,100	17,178.00	0.01
304	002049	紫光国芯	500	16,470.00	0.01
305	600839	四川长虹	3,900	16,302.00	0.01
306	603066	音飞储存	300	16,212.00	0.01
307	000418	小天鹅 A	500	16,160.00	0.01
308	002691	冀凯股份	500	16,145.00	0.01
309	300367	东方网力	800	16,032.00	0.01
310	300221	银禧科技	800	15,792.00	0.01
311	002202	金风科技	900	15,399.00	0.00
312	600100	同方股份	1,100	15,235.00	0.00
313	601021	春秋航空	400	14,696.00	0.00
314	000963	华东医药	200	14,414.00	0.00
315	600137	浪莎股份	300	14,367.00	0.00
316	002385	大北农	2,000	14,200.00	0.00
317	300033	同花顺	200	13,756.00	0.00
318	000778	新兴铸管	2,600	13,442.00	0.00
319	600177	雅戈尔	800	11,184.00	0.00
320	002404	嘉欣丝绸	1,200	10,848.00	0.00
321	000917	电广传媒	700	10,073.00	0.00
322	000839	中信国安	800	7,344.00	0.00
323	600157	永泰能源	1,700	6,817.00	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	601328	交通银行	1,242,444.00	2.33
2	600016	民生银行	1,113,811.80	2.09

3	601377	兴业证券	902,574.50	1.69
4	002142	宁波银行	840,173.00	1.57
5	601601	中国太保	765,399.99	1.43
6	600705	中航资本	739,191.00	1.39
7	600816	安信信托	719,738.28	1.35
8	601099	太平洋	687,228.00	1.29
9	601988	中国银行	681,297.00	1.28
10	601288	农业银行	675,608.00	1.27
11	600958	东方证券	667,346.97	1.25
12	600015	华夏银行	660,420.00	1.24
13	600109	国金证券	657,359.00	1.23
14	000750	国海证券	647,635.00	1.21
15	601211	国泰君安	646,580.23	1.21
16	600036	招商银行	635,339.80	1.19
17	600000	浦发银行	633,326.60	1.19
18	000415	渤海金控	601,920.00	1.13
19	600873	梅花生物	576,590.00	1.08
20	000568	泸州老窖	565,695.00	1.06

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	601328	交通银行	1,234,167.00	2.31
2	601169	北京银行	1,233,854.50	2.31
3	000001	平安银行	1,017,744.00	1.91
4	601009	南京银行	961,289.00	1.80
5	601166	兴业银行	936,843.00	1.76
6	000858	五粮液	859,884.00	1.61
7	601939	建设银行	803,970.00	1.51
8	300124	汇川技术	732,674.00	1.37
9	601601	中国太保	659,771.00	1.24
10	600705	中航资本	632,300.00	1.19
11	000750	国海证券	629,534.00	1.18
12	600048	保利地产	628,236.00	1.18
13	000686	东北证券	626,026.20	1.17

14	600837	海通证券	625,869.20	1.17
15	601211	国泰君安	624,486.00	1.17
16	600029	南方航空	614,211.00	1.15
17	600036	招商银行	610,498.00	1.14
18	601318	中国平安	607,414.00	1.14
19	601377	兴业证券	584,957.00	1.10
20	000818	方大化工	563,975.00	1.06

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	82,933,577.95
卖出股票收入（成交）总额	83,954,298.22

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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所有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投资。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	14,834.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,480.99
5	应收申购款	145,683.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,999.05

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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
3,427	90,309.02	270,617,264.21	87.44%	38,871,748.47	12.56%

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	-	0.000%

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（2010年6月22日）基金份额总额	1,173,262,454.69
本报告期期初基金份额总额	33,412,372.33
本报告期基金总申购份额	359,181,453.85
减：本报告期基金总赎回份额	83,104,813.50
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	309,489,012.68

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 3 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、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	
中信证券		191,289,616.67	54.70%	83,193.11	54.70%	-
申银万国		175,598,259.50	45.30%	68,892.75	45.30%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、本基金本报告期内新增券商交易单元：无，退租券商交易单元：无。

2、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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。

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
中信证券	24,928.20	100.00%	19,600,000.00	100.00%	-	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	关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月30日
2	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
3	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
4	大成基金管理有限公司关于大成核心双动力混合型证券投资基金 2016 年第 1 次分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年12月26日

5	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
6	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
7	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
8	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
9	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
10	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
11	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
12	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
13	大成核心双动力混合型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 8 月 5 日
14	大成核心双动力混合型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 8 月 5 日
15	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
16	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
17	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 7 月 16 日

	务的公告		
18	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
19	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
20	大成基金管理有限公司关于基金经理暂停履职的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 26 日
21	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
22	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
23	大成基金管理有限公司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 5 日
24	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
25	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
26	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
27	大成核心双动力混合型证券投资基金 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
28	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

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 3 月 22 日
30	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
31	大成核心双动力混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 9 日
32	大成核心双动力混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 5 日
33	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
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 1 日
35	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
36	大成核心双动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 5 日
37	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
38	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 29 日
39	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 27 日
40	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 20 日
41	大成核心双动力混合型证券投资基金 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

42	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
43	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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	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
55	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务	中国证监会指定报刊	2016 年 3

	变更的公告	及本公司网站	月 29 日
56	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
57	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
58	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
59	大成基金管理有限公司关于网上直销端银联通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
60	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
61	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
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
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 14 日
64	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
65	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊 及本公司网站	2016 年 1 月 6 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 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《大成核心双动力股票型证券投资基金》的文件；
- 2、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《大成核心双动力股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

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