

大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资  
基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。本半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 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 21 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 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>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11        |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 13        |
| <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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 15        |
| 6.2 利润表.....                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 17        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 18        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 37        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37        |
| 7.3 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.....     | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 38        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 40        |
| 7.6 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.....    | 40        |
| 7.7 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..... | 40        |
| 7.8 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..... | 40        |
| 7.9 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.....    | 40        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 41        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 42        |
| 8.3 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.....     | 42        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>43</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 44        |
| 10.2 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.....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 44        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 45        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 46        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>50</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....   | 50        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 51        |
| 12.2 存放地点.....           | 51        |
| 12.3 查阅方式.....           | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                        |
|------------|------------------------|
| 基金名称       | 大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 大成智惠量化多策略混合            |
| 基金主代码      | 004209                 |
| 交易代码       | 004209                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                 |
| 基金合同生效日    | 2017 年 3 月 21 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 | 122,807,474.05 份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                    |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过大类资产的灵活配置，以及通过多种量化投资策略，力求实现基金资产的持续稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金在大类资产配置层面，采用大成基金成熟的量化择时模型结合定性分析，配置权益类资产和固定收益类资产的比例，严格控制基金的下行风险。在个股选择层面，本基金采用多因子模型精选具有超额收益的股票组合。以下是详细的策略说明。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%  |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。   |

### 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                             | 郭明                   |
|         | 联系电话 | 0755-83183388                   | 010-66105799         |
|         | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn            | custody@icbc.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<br>7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 办公地址    |      | 深圳市福田区深南大道<br>7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>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》   |
| 登载基金半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>            |
| 基金半年度报告备置地点          | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层<br>大成基金管理有限公司<br>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                         |
|--------|------------|------------------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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 | 报告期(2017年3月21日 - 2017年6月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益       | 9,842,919.02                 |
| 本期利润          | 10,099,921.00                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0496                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.88%                        |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.37%                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日)             |
| 期末可供分配利润      | 6,598,855.82                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0537                       |
| 期末基金资产净值      | 129,406,329.87               |
| 期末基金份额净值      | 1.0537                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2017年6月30日)             |
| 基金份额累计净值增长率   | 5.37%                        |

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。

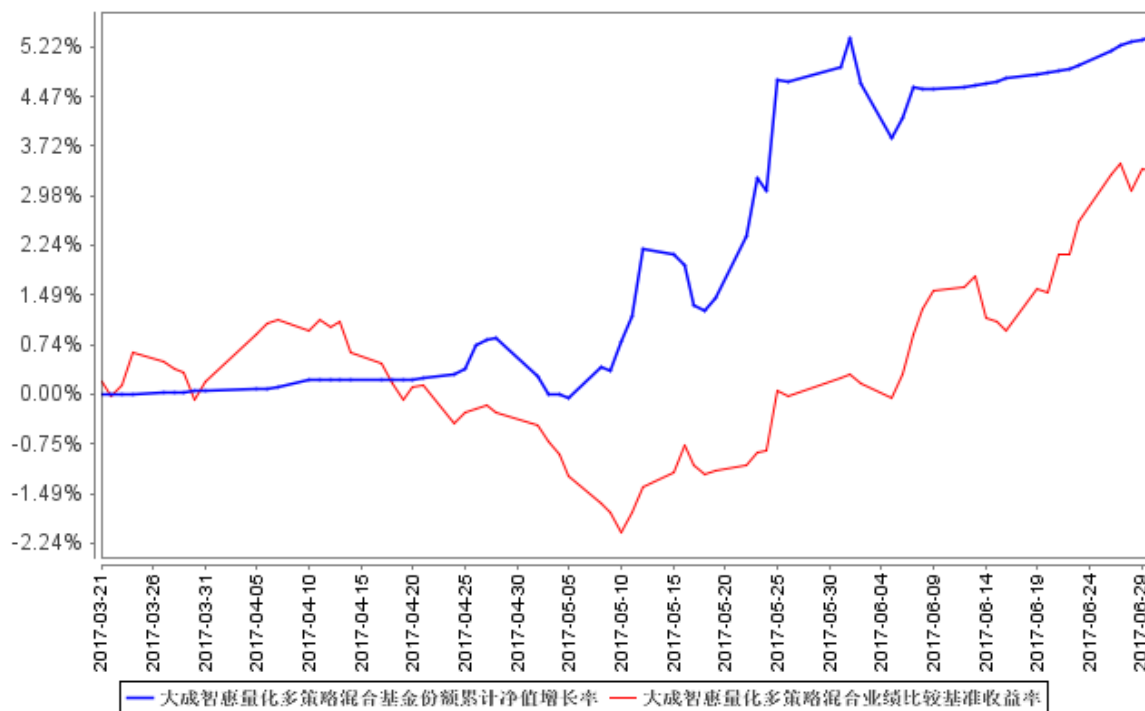
#### 3.2 基金净值表现

##### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.45%    | 0.27%       | 3.10%      | 0.34%         | -2.65% | -0.07% |
| 过去三个月      | 5.31%    | 0.37%       | 3.15%      | 0.32%         | 2.16%  | 0.05%  |
| 自基金合同生效起至今 | 5.37%    | 0.34%       | 3.35%      | 0.32%         | 2.02%  | 0.02%  |



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



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2017 年 3 月 21 日，截至本报告期末，基金成立未满一年；  
2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告期末，本基金仍在建仓期。

## § 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2017年6月30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74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 |        |   |
| 夏高先生 | 本基金基金经理 | 2017年3月21日      | -    | 6年     | 工学博士。2011年1月至2012年5月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012年7月加入大成基金管理有限公司，历任数量投资部高级数量分析师及基金经理助理。2014年12月6日起任大成中证红利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2月3日起担任大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金基金经理。自2017年3月21日起担任大成智慧量化多策略灵活配置混 |

|  |  |  |  |  |                                 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------|
|  |  |  |  |  | 合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。<br>国籍：中国 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------|

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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些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。

##### 4.3.2 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 4 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 6 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

本基金于今年 3 月 21 日成立，至 6 月 30 日收益率为 5.37%。在基金成立之初，上证指数多次冲击 3300 点未果。我们认为市场上涨乏力，可能存在调整风险，因此没有贸然建仓，避开了 4 月中旬至 5 月中旬的市场下跌。在市场下跌过程中，以银行保险为代表的大盘蓝筹股率先止跌回升。基金抓住机会布局此类股票，在 5 月上旬至 6 月初取得了净值上涨。6 月中旬至月底，蓝筹

股的波动加大，基金适当减持了此类股票，锁定收益，并适时配置短久期的国开债，以获取稳健回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0537 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.37%，业绩比较基准收益率为 3.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年下半年，政府将进一步加强宏观调控，出台更有力度的稳增长措施，稳中推进各项改革，继续坚持积极的财政政策和稳健中性的货币政策，努力促进经济持续健康发展。预计美元还会有至少一次加息，但人民币汇率将保持平稳，这将有利于金融市场的稳定。监管机构进一步加强监管，坚持新股发行常态化，有利于资本市场的长远健康发展。我们认为在诸多因素的作用下，下半年的 A 股市场值得投资者关注。本基金坚持价值投资和量化分析的理念，持续研发和改进量化配置及选股模型，选择收益与风险匹配的投资品种进行投资，努力追求基金资产的长期增值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由

估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

本报告期内，本基金托管人在对大成智惠量化多策略灵活配置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，大成智惠量化多策略灵活配置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智惠量化多策略灵活配置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。

### 5.3 托管人对本半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智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 8,944,813.11                   |
| 结算备付金           |            | 11,659,646.37                  |
| 存出保证金           |            | 54,779.23                      |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 70,162,075.43                  |
| 其中：股票投资         |            | 191,075.43                     |
| 基金投资            |            | -                              |
| 债券投资            |            | 69,971,000.00                  |
| 资产支持证券投资        |            | -                              |
| 贵金属投资           |            | -                              |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 38,000,000.00                  |
| 应收证券清算款         |            | 246,837.05                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 685,984.12                     |
| 应收股利            |            | -                              |
| 应收申购款           |            | 423,250.86                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              |
| 资产总计            |            | 130,177,386.17                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |
| 短期借款            |            | -                              |
| 交易性金融负债         |            | -                              |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              |
| 应付证券清算款         |            | -                              |
| 应付赎回款           |            | 266,582.61                     |
| 应付管理人报酬         |            | 182,034.71                     |
| 应付托管费           |            | 30,339.13                      |
| 应付销售服务费         |            | -                              |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 243,289.18                     |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应交税费          |          | -              |
| 应付利息          |          | -              |
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 48,810.67      |
| 负债合计          |          | 771,056.30     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 122,807,474.05 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 6,598,855.82   |
| 所有者权益合计       |          | 129,406,329.87 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 130,177,386.17 |

注：1. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0537 元，基金份额总额 122,807,474.05 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。截止报告日，本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据，下同。

## 6.2 利润表

会计主体：大成智慧量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|
| <b>一、收入</b>       |          | 11,563,216.90                                      |
| 1.利息收入            |          | 1,332,905.28                                       |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 87,510.92  |
| 债券利息收入            |          | 173,331.50   |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  |
| 买入返售金融资产收入        |          | 1,072,062.86                                       |
| 其他利息收入            |          | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）  |          | 9,253,794.65                                       |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | 9,063,634.65                                       |
| 基金投资收益            |          | -  |
| 债券投资收益            | 6.4.7.13 | -  |
| 资产支持证券投资收益        |          | -  |
| 贵金属投资收益           | 6.4.7.14 | -  |
| 衍生工具收益            | 6.4.7.15 | 190,160.00   |
| 股利收益              | 6.4.7.16 | -  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-” | 6.4.7.17 | 257,001.98   |



|                            |            |               |
|----------------------------|------------|---------------|
| 号填列)                       |            |               |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)          |            | -             |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)          | 6.4.7.18   | 719,514.99    |
| <b>减:二、费用</b>              |            | 1,463,295.90  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 862,031.40    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 143,671.93    |
| 3. 销售服务费                   |            | -             |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 405,134.50    |
| 5. 利息支出                    |            | -             |
| 其中: 卖出回购金融资产支出             |            | -             |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 52,458.07     |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 10,099,921.00 |
| 减: 所得税费用                   |            | -             |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 10,099,921.00 |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日

单位: 人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30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)                        | 270,543,417.05                       | -             | 270,543,417.05  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                    | 10,099,921.00 | 10,099,921.00   |
| 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)      | -147,735,943.00                      | -3,501,065.18 | -151,237,008.18 |
| 其中: 1.基金申购款                            | 8,006,298.96                         | 290,559.96    | 8,296,858.92    |
| 2.基金赎回款                                | -155,742,241.96                      | -3,791,625.14 | -159,533,867.10 |
| 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) | 122,807,474.05 | 6,598,855.82 | 129,406,329.87 |
|-----------------|----------------|--------------|----------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|              |              |             |
|--------------|--------------|-------------|
| _____<br>罗登攀 | _____<br>周立新 | _____<br>崔伟 |
| 基金管理人负责人     | 主管会计工作负责人    | 会计机构负责人     |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(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”)证监许可[2016]1915号《关于准予大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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270,459,753.38元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第295号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为270,543,417.05份基金份额,其中认购资金利息折合83,663.67份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例为0%—95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

基金 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为股指期货)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货)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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 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)，按照中证指数有限公司《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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 8,944,813.11           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 8,944,813.11           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |               |               |            |
|-------------------|------------------------|---------------|---------------|------------|
|                   | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |            |
| 股票                | 108,683.45             | 191,075.43    | 82,391.98     |            |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -             | -             |            |
| 债券                | 交易所市场                  | -             | -             |            |
|                   | 银行间市场                  | 69,796,390.00 | 69,971,000.00 | 174,610.00 |
|                   | 合计                     | 69,796,390.00 | 69,971,000.00 | 174,610.00 |
| 资产支持证券            | -                      | -             | -             |            |
| 基金                | -                      | -             | -             |            |
| 其他                | -                      | -             | -             |            |
| 合计                | 69,905,073.45          | 70,162,075.43 | 257,001.98    |            |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |           |
|--------|------------------------|-----------|
|        | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 38,000,000.00          | -         |



|    |               |   |
|----|---------------|---|
| 合计 | 38,000,000.00 | - |
|----|---------------|---|

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,802.99          |
| 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  | 2,215.35          |
| 应收债券利息     | 697,008.22        |
| 应收买入返售证券利息 | -15,064.67        |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 22.23             |
| 合计         | 685,984.12        |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 242,514.18        |
| 银行间市场应付交易费用 | 775.00            |
| 合计          | 243,289.18        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 663.61            |
| 预提费用        | 48,147.06         |
| 合计          | 48,810.67         |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |                 |
|---------------|--------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额(份)                              | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 270,543,417.05                       | 270,543,417.05  |
| 本期申购          | 8,006,298.96                         | 8,006,298.96    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -155,742,241.96                      | -155,742,241.96 |
| 本期末           | 122,807,474.05                       | 122,807,474.05  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 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       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -             | -             |
| 本期利润           | 9,842,919.02  | 257,001.98    | 10,099,921.00 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,985,054.56 | -1,516,010.62 | -3,501,065.18 |
| 其中：基金申购款       | 226,653.33    | 63,906.63     | 290,559.96    |
| 基金赎回款          | -2,211,707.89 | -1,579,917.25 | -3,791,625.14 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 7,857,864.46  | -1,259,008.64 | 6,598,855.82  |

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                             |
| 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 | 34,328.43                            |
| 其他        | 121.30                               |
| 合计        | 87,510.92                            |

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017<br>年6月30日 |
|-------------|--|
| 卖出股票成交总额    | 137,723,837.32                           |
| 减: 卖出股票成本总额 | 128,660,202.67                           |
| 买卖股票差价收入    | 9,063,634.65                             |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

单位: 人民币元

| 项目        | 本期收益金额<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年<br>6月30日 |
|-----------|--|
| 股指期货-投资收益 | 190,160.00                                   |

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017<br>年6月30日 |
|------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 257,001.98                               |
| ——股票投资     | 82,391.98                                |
| ——债券投资     | 174,610.00                               |
| ——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         | 257,001.98                               |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017<br>年6月30日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 717,550.89                               |
| 转换费收入   | 1,964.10                                 |
| 合计      | 719,514.99                               |

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。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017<br>年6月30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 404,359.50                               |
| 银行间市场交易费用 | 775.00                                   |
| 合计        | 405,134.50                               |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017<br>年6月30日 |
|---------|--|
| 审计费用    | 21,398.58                                |
| 信息披露费   | 26,748.48                                |
| 其他      | 400.00                                   |
| 银行划款手续费 | 3,911.01                                 |
| 合计      | 52,458.07                                |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 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            |
| 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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

本基金本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。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月<br>30日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 862,031.40                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 524,203.58                               |

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 1.50%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×1.50%/当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 143,671.93                     |

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

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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                             |           |
|--------|--------------------------------|-----------|
|        | 2017年3月21日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |           |
|        | 期末余额                           | 当期利息收入    |
| 中国工商银行 | 8,944,813.11                   | 53,061.19 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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<br>(单位:股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 603331               | 百达精工 | 2017 年 6 月 27 日 | 2017 年 7 月 5 日 | 新股流通受限 | 9.63 | 9.63   | 999          | 9,620.37 | 9,620.37 | -  |
| 603617               | 君禾股份 | 2017 年 6 月 23 日 | 2017 年 7 月 3 日 | 新股流通受限 | 8.93 | 8.93   | 832          | 7,429.76 | 7,429.76 | -  |

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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 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。

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中

小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、国债期货、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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。

#### **6.4.13.2 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。

为了规避信用风险,本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行及境外次托管行纽约梅隆,与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种的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 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券。

#### **6.4.13.3 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。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 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

##### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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、买入返售金融资产等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息          | 合计             |
|------------------------|----------------|-------|-------|--------------|----------------|
| 资产                     |                |       |       |              |                |
| 银行存款                   | 8,944,813.11   | -     | -     | -            | 8,944,813.11   |
| 结算备付金                  | 11,659,646.37  | -     | -     | -            | 11,659,646.37  |
| 存出保证金                  | 54,779.23      | -     | -     | -            | 54,779.23      |
| 交易性金融资产                | 69,971,000.00  | -     | -     | 191,075.43   | 70,162,075.43  |
| 买入返售金融资产               | 38,000,000.00  | -     | -     | -            | 38,000,000.00  |
| 应收证券清算款                | -              | -     | -     | 246,837.05   | 246,837.05     |
| 应收利息                   | -              | -     | -     | 685,984.12   | 685,984.12     |
| 应收申购款                  | -              | -     | -     | 423,250.86   | 423,250.86     |
| 资产总计                   | 128,630,238.71 | -     | -     | 1,547,147.46 | 130,177,386.17 |
| 负债                     |                |       |       |              |                |
| 应付赎回款                  | -              | -     | -     | 266,582.61   | 266,582.61     |
| 应付管理人报酬                | -              | -     | -     | 182,034.71   | 182,034.71     |
| 应付托管费                  | -              | -     | -     | 30,339.13    | 30,339.13      |
| 应付交易费用                 | -              | -     | -     | 243,289.18   | 243,289.18     |
| 其他负债                   | -              | -     | -     | 48,810.67    | 48,810.67      |
| 负债总计                   | -              | -     | -     | 771,056.30   | 771,056.30     |
| 利率敏感度缺口                | 128,630,238.71 | -     | -     | 776,091.16   | 129,406,329.87 |

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者予以分类。

## 6.4.13.4.1.2 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（单位：人民币元） |
|    |                    | 本期末（2017 年 6 月 30 日）        |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 130,000.00                  |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -120,000.00                 |

## 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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，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其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票等权益类资产占基金资产的比例不低于 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 191,075.43             | 0.15          |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                      | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                      | —             |
| 其他            | —                      | —             |
| 合计            | 191,075.43             | 0.15          |

##### 6.4.13.4.3.2 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：人民币元） |
|    |                      | 本期末（2017 年 6 月 30 日）        |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 2,820,000.00                |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -2,820,000.00               |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。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 投资组合报告

## 7.1 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              | 191,075.43     | 0.15          |
|    | 其中：股票             | 191,075.43     | 0.15          |
| 2  | 固定收益投资            | 69,971,000.00  | 53.75         |
|    | 其中：债券             | 69,971,000.00  | 53.75         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 38,000,000.00  | 29.19         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 20,604,459.48  | 15.83         |
| 7  | 其他各项资产            | 1,410,851.26   | 1.08          |
| 8  | 合计                | 130,177,386.17 | 100.00        |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 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（元）    | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -             |
| B  | 采矿业              | -          | -             |
| C  | 制造业              | 191,075.43 | 0.15          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -             |
| E  | 建筑业              | -          | -             |
| F  | 批发和零售业           | -          | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -          | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -          | -             |
| J  | 金融业              | -          | -             |
| K  | 房地产业             | -          | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -          | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -          | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -          | -             |

|   |               |            |      |
|---|---------------|------------|------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -          | -    |
| P | 教育            | -          | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -          | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -          | -    |
| S | 综合            | -          | -    |
|   | 合计            | 191,075.43 | 0.15 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 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  | 603801 | 志邦股份 | 1,406 | 47,522.80 | 0.04         |
| 2  | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.04         |
| 3  | 603335 | 迪生力  | 2,230 | 24,864.50 | 0.02         |
| 4  | 603679 | 华体科技 | 809   | 21,438.50 | 0.02         |
| 5  | 603938 | 三孚股份 | 1,246 | 20,932.80 | 0.02         |
| 6  | 603286 | 日盈电子 | 890   | 13,528.00 | 0.01         |
| 7  | 603331 | 百达精工 | 999   | 9,620.37  | 0.01         |
| 8  | 603617 | 君禾股份 | 832   | 7,429.76  | 0.01         |

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 601628 | 中国人寿 | 8,149,661.00 | 6.30           |
| 2  | 601288 | 农业银行 | 8,133,180.00 | 6.28           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 8,121,294.74 | 6.28           |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 8,103,219.00 | 6.26           |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 8,091,372.30 | 6.25           |
| 6  | 601857 | 中国石油 | 8,089,843.54 | 6.25           |
| 7  | 601939 | 建设银行 | 8,084,722.00 | 6.25           |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 8,083,590.00 | 6.25           |
| 9  | 600837 | 海通证券 | 7,971,085.00 | 6.16           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 10 | 600795 | 国电电力 | 7,955,296.00 | 6.15 |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 7,942,395.40 | 6.14 |
| 12 | 601336 | 新华保险 | 7,938,818.40 | 6.13 |
| 13 | 601601 | 中国太保 | 7,938,412.79 | 6.13 |
| 14 | 601766 | 中国中车 | 7,935,950.20 | 6.13 |
| 15 | 601211 | 国泰君安 | 7,929,384.32 | 6.13 |
| 16 | 600028 | 中国石化 | 7,928,839.00 | 6.13 |
| 17 | 601878 | 浙商证券 | 93,364.05    | 0.07 |
| 18 | 603980 | 吉华集团 | 56,347.20    | 0.04 |
| 19 | 603801 | 志邦股份 | 32,998.82    | 0.03 |
| 20 | 603043 | 广州酒家 | 23,855.80    | 0.02 |

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 10,359,405.00 | 8.01           |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 9,633,433.58  | 7.44           |
| 3  | 601336 | 新华保险 | 9,499,009.68  | 7.34           |
| 4  | 601628 | 中国人寿 | 9,370,854.05  | 7.24           |
| 5  | 601601 | 中国太保 | 9,020,962.68  | 6.97           |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 8,623,840.00  | 6.66           |
| 7  | 601939 | 建设银行 | 8,529,163.00  | 6.59           |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 8,361,528.00  | 6.46           |
| 9  | 601328 | 交通银行 | 8,320,552.00  | 6.43           |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 8,311,940.00  | 6.42           |
| 11 | 601857 | 中国石油 | 8,056,140.00  | 6.23           |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 7,944,096.27  | 6.14           |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 7,895,684.00  | 6.10           |
| 14 | 600795 | 国电电力 | 7,814,016.00  | 6.04           |
| 15 | 601211 | 国泰君安 | 7,713,988.44  | 5.96           |
| 16 | 601766 | 中国中车 | 7,661,720.00  | 5.92           |
| 17 | 601878 | 浙商证券 | 189,490.35    | 0.15           |
| 18 | 603980 | 吉华集团 | 104,551.16    | 0.08           |
| 19 | 603196 | 日播时尚 | 41,620.95     | 0.03           |
| 20 | 603042 | 华脉科技 | 41,062.56     | 0.03           |

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。

#### 7.4.3 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 | 128,768,886.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 137,723,837.32 |

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。

#### 7.5 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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 69,971,000.00 | 54.07        |
|    | 其中：政策性金融债 | 69,971,000.00 | 54.07        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 69,971,000.00 | 54.07        |

#### 7.6 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  | 150207 | 15 国开 07 | 400,000 | 40,100,000.00 | 30.99        |
| 2  | 170204 | 17 国开 04 | 300,000 | 29,871,000.00 | 23.08        |

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。



## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码            | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明       |
|---------------|----|----------|---------|-----------|------------|
| 股指期货投资本期收益（元） |    |          |         |           | 190,160.00 |

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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   | 54,779.23    |
| 2  | 应收证券清算款 | 246,837.05   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 685,984.12   |
| 5  | 应收申购款   | 423,250.86   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,410,851.26 |

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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  | 603331 | 百达精工 | 9,620.37    | 0.01         | 新股锁定     |
| 2  | 603617 | 君禾股份 | 7,429.76    | 0.01         | 新股锁定     |

### 7.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 1,323        | 92,825.00     | -     | 0.00%      | 122,807,474.05 | 100.00%    |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 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 | 558,073.58 | 0.4544%  |

### 8.3 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2017 年 3 月 21 日 ）基金份额总额   | 270,543,417.05 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 8,006,298.96   |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 155,742,241.96 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 122,807,474.05 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

1、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。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履职的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

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。

### 10.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 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），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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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

| 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 |    |
| 长江证券 | 1      | 191,605,736.71 | 72.00%       | 174,608.60 | 72.00%     |    |
| 东方证券 | 1      | 73,907,659.68  | 27.77%       | 67,351.96  | 27.77%     |    |
| 中信证券 | 1      | 607,504.62     | 0.23%        | 553.62     | 0.23%      |    |
| 华创证券 | 1      |                |              |            |            |    |
| 申银万国 | 1      |                |              |            |            |    |

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本基金本报告期末所有席位均为本报告期内新增。本报告期内退租交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

| 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 |
| 长江证券 | -    | -            | 2,424,000,000.00 | 44.53%         | -    | -            |
| 东方证券 | -    | -            | 70,000,000.00    | 1.29%          | -    | -            |

|      |   |   |                  |        |   |   |
|------|---|---|------------------|--------|---|---|
| 中信证券 | - | - | 2,949,500,000.00 | 54.18% | - | - |
|------|---|---|------------------|--------|---|---|

### 10.8 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旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月28日 |
| 2  | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月27日 |
| 3  | 大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告    | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月21日 |
| 4  | 大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告         | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月16日 |
| 5  | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月14日 |
| 6  | 大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告       | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月2日  |
| 7  | 大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告       | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月2日  |
| 8  | 大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告        | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年6月2日  |
| 9  | 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 | 2017年5月27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 | 2017年5月24日 |
| 11 | 大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告            | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年5月17日 |
| 12 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年5月12日 |
| 13 | 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 | 2017年5月12日 |
| 14 | 大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告       | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年5月6日  |
| 15 | 大成基金管理有限公司关于调整                           | 中国证监会指定报        | 2017年5月4日  |

|    |  |                 |            |
|----|--|-----------------|------------|
|    | 网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告                  | 刊及本公司网站         |            |
| 16 | 大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年4月29日 |
| 17 | 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 | 2017年4月28日 |
| 18 | 大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年4月28日 |
| 19 | 大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年4月27日 |
| 20 | 大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年4月26日 |
| 21 | 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 | 2017年4月22日 |
| 22 | 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 | 2017年4月18日 |
| 23 | 大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告                  | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年4月14日 |
| 24 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年4月11日 |
| 25 | 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 | 2017年4月1日  |
| 26 | 大成智慧量化多策略灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及定投业务公告   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年3月31日 |
| 27 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年3月31日 |
| 28 | 大成基金管理有限公司更正公告                           | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年3月29日 |
| 29 | 关于增加北京恒天明泽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 | 2017年3月25日 |
| 30 | 大成智慧量化多策略灵活配置混合型基金合同生效公告                 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年3月22日 |
| 31 | 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 | 2017年3月17日 |
| 32 | 关于大成智慧量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加海通             | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年3月15日 |

|    |  |                 |                 |
|----|--|-----------------|-----------------|
|    | 证券股份有限公司为销售机构的公告                               |                 |                 |
| 33 | 关于大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加销售机构的公告              | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 3 月 14 日 |
| 34 | 大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告          | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 3 月 8 日  |
| 35 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告         | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 3 月 7 日  |
| 36 | 关于大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加中信银行股份有限公司为销售机构的公告   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 28 日 |
| 37 | 关于大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加销售机构的公告              | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 22 日 |
| 38 | 关于大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加北京银行股份有限公司为销售机构的公告   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 21 日 |
| 39 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）                   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 40 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）                   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 41 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）                    | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 42 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）                   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 43 | 关于大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 16 日 |
| 44 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告         | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 15 日 |
| 45 | 关于大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增加中国银行股份有限公司为销售机构的公告   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 14 日 |
| 46 | 大成智惠量化多策略灵活配置混合型基金招募说明书                        | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 11 日 |
| 47 | 大成智惠量化多策略灵活配置混                                 | 中国证监会指定报        | 2017 年 2 月 11 日 |



|    |   |                 |                 |
|----|---|-----------------|-----------------|
|    | 合型基金托管协议                                  | 刊及本公司网站         |                 |
| 48 | 大成智惠量化多策略灵活配置合型基金基金合同摘要                   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 11 日 |
| 49 | 大成智惠量化多策略灵活配置合型基金基金合同                     | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 11 日 |
| 50 | 大成智惠量化多策略灵活配置合型基金份额发售公告                   | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 2 月 11 日 |
| 51 | 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 | 2017 年 2 月 11 日 |
| 52 | 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 | 2017 年 1 月 19 日 |
| 53 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告    | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 1 月 17 日 |
| 54 | 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 | 2017 年 1 月 17 日 |
| 55 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告    | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 1 月 11 日 |
| 56 | 大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 1 月 11 日 |
| 57 | 关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告                    | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 1 月 6 日  |
| 58 | 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 | 2017 年 1 月 3 日  |

**§ 11 影响投资者决策的其他重要信息**

**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况**

无。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

|   |
|---|
| 无 |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日