

大成行业轮动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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62

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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	大成行业轮动混合
基金主代码	090009
交易代码	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 8 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	152,684,225.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用行业轮动效应，优化行业配置，获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的股票基金，预期风险收益水平高于混合基金、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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		刘卓	周慕冰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	9,823,420.71
本期利润	27,701,933.38
加权平均基金份额本期利润	0.2106
本期加权平均净值利润率	14.74%
本期基金份额净值增长率	15.79%
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	57,747,486.77
期末可供分配基金份额利润	0.3782
期末基金资产净值	235,123,749.19
期末基金份额净值	1.540
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	54.00%

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。

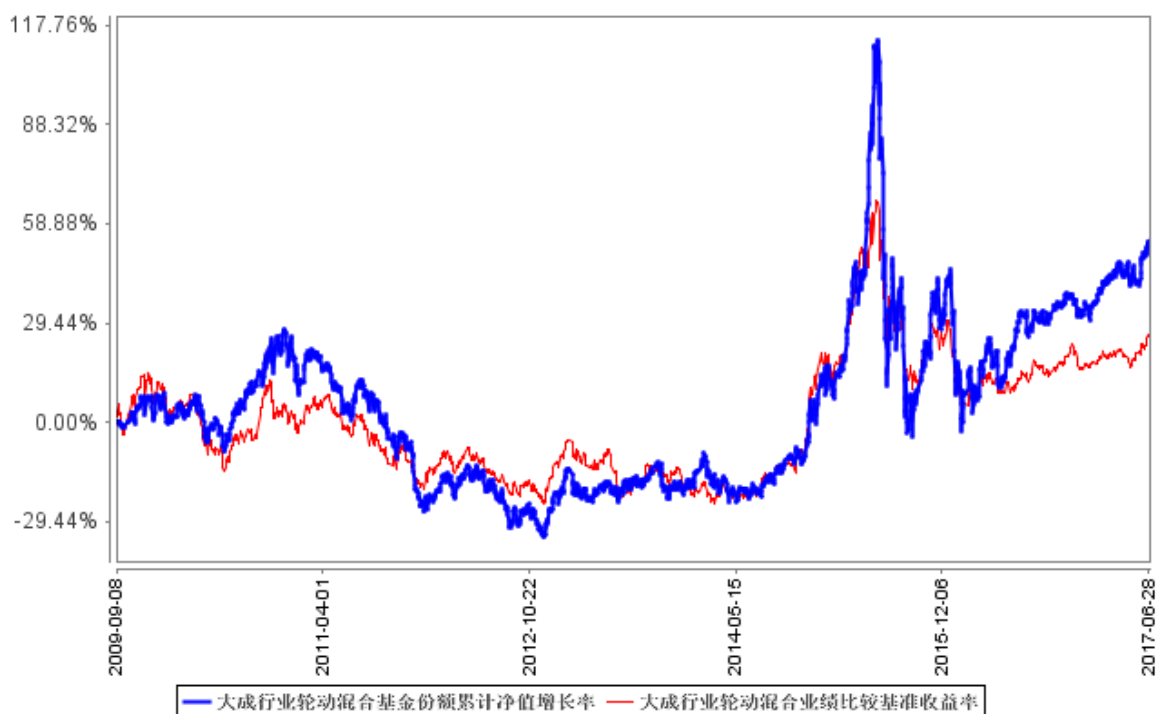
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.60%	0.88%	4.19%	0.54%	4.41%	0.34%

过去三个月	6.43%	0.92%	4.92%	0.50%	1.51%	0.42%
过去六个月	15.79%	0.78%	8.59%	0.46%	7.20%	0.32%
过去一年	20.97%	0.80%	13.05%	0.54%	7.92%	0.26%
过去三年	92.26%	2.24%	59.62%	1.40%	32.64%	0.84%
自基金合同 生效起至今	54.00%	1.72%	25.96%	1.23%	28.04%	0.49%

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



注：1. 按基金合同规定，本基金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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2. 本基金于 2015 年 7 月 3 日由大成行业轮动股票型证券投资基金更名为大成行业轮动混合型证券投资基金。

§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		
王磊先生	本基金基金经理	2015年12月14日	-	13年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日至2015年7月15日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015年7月16日到2016年3月25日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年7

				<p>月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2014 年 12 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起担任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起担任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2017 年上半年，A 股市场在一月份呈现震荡态势，中间出现一定幅度的波动，但在一月下旬之后，受到国家坚定的对部分过剩行业执行去产能政策的影响，同时受到未来推进一带一路政策的预期，市场出现了一定幅度的上涨，特别是受益国家政策的部分周期品行业，如建筑建材、钢铁等表现较好。同时，部分低估值且具有一定成长性的行业，如家电、食品饮料也表现较好。2017 年第二季度，各金融监管机构又相继出台了加强监管和金融去杠杆的各项措施，新股发行也常态化，这些措施对部分的高估值题材股产生较为明显的压力。在宏观经济和监管政策的双重作用下，市场资金不断的向白马股集中。表现在板块和指数上，上半年以中证 100 指数和上证 50 指数为代表的蓝筹白马股表现相对较好，而以创业板指数为代表的中小市值股票则表现相对弱势。

本季度中证 100 指数上涨 15.13%，上证 50 指数上涨 11.50%，上证综指上涨 2.86%，创业板指数下跌 7.34%。上半年本产品增加了部分白马蓝筹股的配置，获得了一定收益。

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 1.540 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.79%，业绩比较基准收益率为 8.59%。

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 年下半年，我们认为，宏观经济仍然将保持一个平稳的态势，继续向下的概率不大。预计货币政策仍将维持上半年中性偏紧的状态，但央行将根据实际情况进行微调，确保在紧缩过程中不会发生大的系统性金融风险。同时，各金融监管机构仍将加强金融监管，金融去杠杆的过程仍将持续。

对应到 A 股市场，我们认为，市场整体上仍将保持一个较为平稳的态势，大幅向上和向下的概率都不大，市场仍将以结构性行情为主。具体行业选择上，低估值的白马蓝筹，以及部分主题性板块，如新能源汽车，仍将有一定的投资机会。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的收益回报给投资者。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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：大成行业轮动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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	20,517,689.10	21,346,459.25
结算备付金		1,328,930.38	1,391,502.73
存出保证金		161,160.15	184,153.78
交易性金融资产	6.4.3.2	208,771,322.68	129,371,574.37
其中：股票投资		208,771,322.68	129,371,574.37
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		5,654,778.18	-
应收利息	6.4.3.5	5,569.26	5,048.80
应收股利		-	-
应收申购款		13,840.14	11,605.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		236,453,289.89	152,310,343.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	850,485.96
应付赎回款		104,307.47	47,111.47
应付管理人报酬		280,875.64	192,935.73
应付托管费		46,812.61	32,155.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	718,861.84	447,916.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	178,683.14	160,075.47
负债合计		1,329,540.70	1,730,681.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	152,684,225.71	113,260,290.64
未分配利润	6.4.3.10	82,439,523.48	37,319,372.18
所有者权益合计		235,123,749.19	150,579,662.82
负债和所有者权益总计		236,453,289.89	152,310,343.98

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.540 元，基金份额总额 152,684,225.71 份。

6.2 利润表

会计主体：大成行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		31,846,848.81	-16,659,682.40
1.利息收入		107,604.48	91,544.88
其中：存款利息收入	6.4.3.11	107,604.48	91,515.08
债券利息收入		-	29.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,849,758.21	-12,956,027.77
其中：股票投资收益	6.4.3.12	12,240,674.58	-13,766,538.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	13,072.86
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	1,609,083.63	797,438.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	17,878,512.67	-3,816,882.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	10,973.45	21,682.88
减：二、费用		4,144,915.43	3,702,998.38
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,387,190.91	1,082,044.39
2. 托管费	6.4.6.2.2	231,198.51	180,340.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	2,333,605.15	2,252,457.36

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	192,920.86	188,155.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,701,933.38	-20,362,680.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,701,933.38	-20,362,680.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 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）	113,260,290.64	37,319,372.18	150,579,662.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,701,933.38	27,701,933.38
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）	39,423,935.07	17,418,217.92	56,842,152.99
其中：1.基金申购款	51,751,792.11	22,749,925.57	74,501,717.68
2.基金赎回款	-12,327,857.04	-5,331,707.65	-17,659,564.69
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）	152,684,225.71	82,439,523.48	235,123,749.19

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	124,286,132.92	54,267,586.81	178,553,719.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,362,680.78	-20,362,680.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-3,240,499.10	-855,192.10	-4,095,691.20
其中：1.基金申购款	15,175,189.56	2,313,454.24	17,488,643.80
2.基金赎回款	-18,415,688.66	-3,168,646.34	-21,584,335.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 （净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	121,045,633.82	33,049,713.93	154,095,347.75

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>崔伟</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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

6.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

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以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

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。

6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应

纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	20,517,689.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	20,517,689.10

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	189,806,785.34	208,771,322.68	18,964,537.34
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	189,806,785.34	208,771,322.68	18,964,537.34

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.3.4 买入返售金融资产**6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	4,965.72
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	538.20
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	65.34
合计	5,569.26

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	718,861.84

银行间市场应付交易费用	-
合计	718,861.84

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	164.65
预提费用	178,518.49
合计	178,683.14

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,260,290.64	113,260,290.64
本期申购	51,751,792.11	51,751,792.11
本期赎回(以“-”号填列)	-12,327,857.04	-12,327,857.04
本期末	152,684,225.71	152,684,225.71

注：本期申购包含基金转入的份额和金额；本期赎回包含基金转出的份额和金额。

6.4.3.10 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	32,906,383.41	4,412,988.77	37,319,372.18
本期利润	9,823,420.71	17,878,512.67	27,701,933.38
本期基金份额交易产生的变动数	15,017,682.65	2,400,535.27	17,418,217.92
其中：基金申购款	19,398,710.26	3,351,215.31	22,749,925.57

基金赎回款	-4,381,027.61	-950,680.04	-5,331,707.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,747,486.77	24,692,036.71	82,439,523.48

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	95,412.20
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	10,761.32
其他	1,430.96
合计	107,604.48

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	762,228,253.75
减：卖出股票成本总额	749,987,579.17
买卖股票差价收入	12,240,674.58

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,609,083.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,609,083.63

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	17,878,512.67
——股票投资	17,878,512.67
——债券投资	-
——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	17,878,512.67

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,660.88
转换费收入	1,312.57
其他	-

合计	10,973.45
----	-----------

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，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。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,333,605.15
银行间市场交易费用	-
合计	2,333,605.15

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	5,302.37
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
其他	100.00
合计	192,920.86

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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

本基金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。

6.4.5.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	209,290,877.15	13.32%	234,528,112.63	15.67%

6.4.6.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.6.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.6.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	190,737.25	13.32%	15,370.38	2.14%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	213,726.85	15.66%	213,726.85	34.29%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬**6.4.6.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,387,190.91	1,082,044.39
其中：支付销售机构的客户维护费	321,222.02	274,142.01

注：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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	231,198.51	180,340.75

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.6.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	20,517,689.10	95,412.20	18,776,784.36	78,310.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-

300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

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认购协议的规定，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。

6.4.8.2 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
600485	信威集团	2016年12月26日	临时停牌	14.59	-	-	207,300	3,905,283.00	3,024,507.00	-
300298	三诺生物	2017年5月17日	临时停牌	16.37	2017年7月17日	16.09	150,223	3,662,534.62	2,459,150.51	-

		日	牌		日				
--	--	---	---	--	---	--	--	--	--

注：本基金截至本期末止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。本基金持有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。

6.4.9.3 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 6.4.8 期末持有的流通受限股票外，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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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、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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以	不计息	合计

2017 年 6 月 30 日			上		
资产					
银行存款	20,517,689.10	-	-	-	20,517,689.10
结算备付金	1,328,930.38	-	-	-	1,328,930.38
存出保证金	161,160.15	-	-	-	161,160.15
交易性金融资产	-	-	-	208,771,322.68	208,771,322.68
应收证券清算款	-	-	-	5,654,778.18	5,654,778.18
应收利息	-	-	-	5,569.26	5,569.26
应收申购款	-	-	-	13,840.14	13,840.14
资产总计	22,007,779.63	-	-	214,445,510.26	236,453,289.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	104,307.47	104,307.47
应付管理人报酬	-	-	-	280,875.64	280,875.64
应付托管费	-	-	-	46,812.61	46,812.61
应付交易费用	-	-	-	718,861.84	718,861.84
其他负债	-	-	-	178,683.14	178,683.14
负债总计	-	-	-	1,329,540.70	1,329,540.70
利率敏感度缺口	22,007,779.63	-	-	213,115,969.56	235,123,749.19
上年度末 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	21,346,459.25	-	-	-	21,346,459.25
结算备付金	1,391,502.73	-	-	-	1,391,502.73
存出保证金	184,153.78	-	-	-	184,153.78
交易性金融资产	-	-	-	129,371,574.37	129,371,574.37
应收利息	-	-	-	5,048.80	5,048.80
应收申购款	-	-	-	11,605.05	11,605.05
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,922,115.76	-	-	129,388,228.22	152,310,343.98

负债					
应付证券清算款		-	-	850,485.96	850,485.96
应付赎回款		-	-	47,111.47	47,111.47
应付管理人报酬		-	-	192,935.73	192,935.73
应付托管费		-	-	32,155.98	32,155.98
应付交易费用		-	-	447,916.55	447,916.55
其他负债		-	-	160,075.47	160,075.47
负债总计		-	-	1,730,681.16	1,730,681.16
利率敏感度缺口	22,922,115.76		-	-127,657,547.06	150,579,662.82

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 6 月 30 日及 2016 年 12 月 31 日均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报告期末基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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的股票，所面临的最大市场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市场价格风险，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。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%。于本报告期末，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	208,771,322.68	88.79	129,371,574.37	85.92
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	208,771,322.68	88.79	129,371,574.37	85.92

6.4.9.4.3.2 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）	上年度末（2016年12月 31日）
	业绩比较基准上升5%	13,620,000.00	11,240,901.13
	业绩比较基准下降5%	-13,620,000.00	-11,240,901.13

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	208,771,322.68	88.29
	其中：股票	208,771,322.68	88.29
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	21,846,619.48	9.24
7	其他各项资产	5,835,347.73	2.47
8	合计	236,453,289.89	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	3,623,526.40	1.54
B	采矿业	1,385,747.00	0.59
C	制造业	156,943,201.96	66.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	12,205,638.75	5.19

G	交通运输、仓储和邮政业	479.96	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	4,635,624.00	1.97
K	房地产业	10,634,885.35	4.52
L	租赁和商务服务业	8,421,656.64	3.58
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	10,912,923.00	4.64
S	综合	-	0.00
	合计	208,771,322.68	88.79

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	002050	三花智控	1,032,506	16,850,497.92	7.17
2	002640	跨境通	574,383	12,205,638.75	5.19
3	000651	格力电器	294,000	12,103,980.00	5.15
4	002126	银轮股份	1,094,099	11,006,635.94	4.68
5	300144	宋城演艺	522,900	10,912,923.00	4.64
6	000910	大亚圣象	438,239	10,885,856.76	4.63
7	002032	苏泊尔	244,036	10,017,677.80	4.26
8	002236	大华股份	417,600	9,525,456.00	4.05

9	002241	歌尔股份	487,800	9,404,784.00	4.00
10	300072	三聚环保	238,412	8,833,164.60	3.76
11	002027	分众传媒	612,039	8,421,656.64	3.58
12	600885	宏发股份	199,900	7,974,011.00	3.39
13	603008	喜临门	407,735	7,261,760.35	3.09
14	601766	中国中车	697,500	7,058,700.00	3.00
15	002466	天齐锂业	127,200	6,913,320.00	2.94
16	600340	华夏幸福	190,100	6,383,558.00	2.71
17	603556	海兴电力	126,600	5,556,474.00	2.36
18	300476	胜宏科技	211,400	4,995,382.00	2.12
19	600999	招商证券	269,200	4,635,624.00	1.97
20	600325	华发股份	509,141	4,251,327.35	1.81
21	600584	长电科技	242,600	3,893,730.00	1.66
22	002714	牧原股份	133,120	3,623,526.40	1.54
23	300303	聚飞光电	835,704	3,618,598.32	1.54
24	002434	万里扬	219,700	3,497,624.00	1.49
25	600485	信威集团	207,300	3,024,507.00	1.29
26	600597	光明乳业	217,100	2,768,025.00	1.18
27	300298	三诺生物	150,223	2,459,150.51	1.05
28	002690	美亚光电	121,200	2,324,616.00	0.99
29	002190	成飞集成	66,800	1,790,240.00	0.76
30	300566	激智科技	47,900	1,528,489.00	0.65
31	600547	山东黄金	47,900	1,385,747.00	0.59
32	603328	依顿电子	84,375	1,193,906.25	0.51
33	002530	金财互联	39,161	1,153,683.06	0.49
34	603601	再升科技	74,900	1,119,755.00	0.48
35	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
36	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02

37	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
38	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
39	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
40	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
41	002250	联化科技	900	12,870.00	0.01
42	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
43	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
44	600004	白云机场	26	479.96	0.00

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	600266	北京城建	15,852,710.64	10.53
2	002126	银轮股份	12,574,715.13	8.35
3	000402	金融街	11,614,421.00	7.71
4	002027	分众传媒	11,557,162.54	7.68
5	000910	大亚圣象	11,512,100.92	7.65
6	000001	平安银行	11,267,692.32	7.48
7	601166	兴业银行	11,003,557.00	7.31
8	002108	沧州明珠	10,960,613.30	7.28
9	603008	喜临门	10,635,354.93	7.06
10	002640	跨境通	10,575,762.71	7.02
11	300144	宋城演艺	10,253,823.31	6.81
12	000651	格力电器	9,899,492.00	6.57
13	601225	陕西煤业	9,278,659.21	6.16
14	002236	大华股份	9,260,703.11	6.15
15	600038	中直股份	9,159,156.88	6.08

16	300072	三聚环保	9,114,916.14	6.05
17	300224	正海磁材	9,009,890.09	5.98
18	002241	歌尔股份	8,949,648.51	5.94
19	600019	宝钢股份	8,908,560.92	5.92
20	600376	首开股份	8,584,964.42	5.70
21	002051	中工国际	7,969,350.90	5.29
22	002466	天齐锂业	7,943,989.00	5.28
23	600000	浦发银行	7,643,780.36	5.08
24	000858	五粮液	7,601,056.46	5.05
25	000039	中集集团	7,476,083.30	4.96
26	600340	华夏幸福	7,151,724.42	4.75
27	000758	中色股份	7,055,658.00	4.69
28	601766	中国中车	7,020,351.59	4.66
29	603737	三棵树	6,992,117.00	4.64
30	600325	华发股份	6,923,737.00	4.60
31	600183	生益科技	6,854,086.48	4.55
32	002244	滨江集团	6,799,492.00	4.52
33	600584	长电科技	6,687,912.16	4.44
34	000157	中联重科	6,685,262.00	4.44
35	600970	中材国际	6,619,640.00	4.40
36	600536	中国软件	6,596,274.00	4.38
37	000895	双汇发展	6,582,140.00	4.37
38	002285	世联行	6,567,552.60	4.36
39	300059	东方财富	6,439,853.65	4.28
40	600016	民生银行	6,439,118.00	4.28
41	603556	海兴电力	6,351,291.80	4.22
42	002690	美亚光电	6,244,192.81	4.15
43	600597	光明乳业	6,041,005.37	4.01

44	600068	葛洲坝	5,924,426.00	3.93
45	600489	中金黄金	5,889,025.00	3.91
46	600060	海信电器	5,846,846.50	3.88
47	300426	唐德影视	5,805,846.00	3.86
48	000968	蓝焰控股	5,797,483.93	3.85
49	000937	冀中能源	5,787,600.00	3.84
50	300476	胜宏科技	5,721,657.88	3.80
51	002573	清新环境	5,628,482.73	3.74
52	000063	中兴通讯	5,431,086.00	3.61
53	002396	星网锐捷	5,368,215.12	3.57
54	000037	深南电 A	5,339,772.00	3.55
55	000776	广发证券	5,316,377.57	3.53
56	601117	中国化学	5,311,765.00	3.53
57	002081	金螳螂	5,072,141.60	3.37
58	600104	上汽集团	5,068,635.00	3.37
59	600511	国药股份	4,988,079.48	3.31
60	600596	新安股份	4,984,755.00	3.31
61	600998	九州通	4,951,732.73	3.29
62	000960	锡业股份	4,918,002.00	3.27
63	601899	紫金矿业	4,866,299.00	3.23
64	600048	保利地产	4,834,378.48	3.21
65	601021	春秋航空	4,806,828.63	3.19
66	603798	康普顿	4,775,688.04	3.17
67	600835	上海机电	4,712,626.23	3.13
68	600195	中牧股份	4,685,916.00	3.11
69	600999	招商证券	4,656,660.00	3.09
70	601600	中国铝业	4,558,540.00	3.03
71	000792	盐湖股份	4,549,424.00	3.02

72	603816	顾家家居	4,427,733.00	2.94
73	000596	古井贡酒	4,421,876.37	2.94
74	002518	科士达	4,316,306.95	2.87
75	600004	白云机场	4,292,469.43	2.85
76	002019	亿帆医药	4,267,811.24	2.83
77	600030	中信证券	4,261,935.00	2.83
78	600008	首创股份	4,247,541.00	2.82
79	603040	新坐标	4,218,430.00	2.80
80	002206	海利得	4,145,006.64	2.75
81	000625	长安汽车	4,143,939.00	2.75
82	601336	新华保险	4,021,010.00	2.67
83	000698	沈阳化工	3,782,627.00	2.51
84	600688	上海石化	3,758,947.00	2.50
85	000068	华控赛格	3,756,869.76	2.49
86	000069	华侨城A	3,752,039.00	2.49
87	000920	南方汇通	3,744,249.91	2.49
88	600383	金地集团	3,722,996.00	2.47
89	000708	大冶特钢	3,673,439.00	2.44
90	002434	万里扬	3,498,399.45	2.32
91	002714	牧原股份	3,460,204.60	2.30
92	002120	韵达股份	3,434,359.86	2.28
93	603180	金牌厨柜	3,419,814.00	2.27
94	601168	西部矿业	3,414,850.00	2.27
95	600741	华域汽车	3,352,978.10	2.23
96	603799	华友钴业	3,325,966.00	2.21
97	601669	中国电建	3,316,152.00	2.20
98	600150	中国船舶	3,312,593.35	2.20
99	000999	华润三九	3,311,514.00	2.20

100	002002	鸿达兴业	3,306,505.18	2.20
101	300068	南都电源	3,296,622.11	2.19
102	600498	烽火通信	3,293,362.00	2.19
103	601058	赛轮金宇	3,289,491.40	2.18
104	000021	深科技	3,285,058.00	2.18
105	002157	正邦科技	3,284,791.00	2.18
106	600418	江淮汽车	3,267,262.54	2.17
107	300078	思创医惠	3,261,922.39	2.17
108	002234	民和股份	3,258,470.00	2.16
109	002047	宝鹰股份	3,244,361.20	2.15
110	601992	金隅股份	3,241,197.00	2.15
111	000762	西藏矿业	3,208,554.20	2.13
112	600256	广汇能源	3,203,004.00	2.13
113	600123	兰花科创	3,202,610.00	2.13
114	601677	明泰铝业	3,199,807.00	2.12
115	002585	双星新材	3,181,108.00	2.11
116	600295	鄂尔多斯	3,097,986.25	2.06
117	600320	振华重工	3,087,909.17	2.05
118	600153	建发股份	3,087,426.14	2.05
119	601699	潞安环能	3,085,848.00	2.05
120	600569	安阳钢铁	3,079,632.00	2.05
121	600089	特变电工	3,079,092.00	2.04
122	300100	双林股份	3,069,432.00	2.04
123	600889	南京化纤	3,057,154.00	2.03
124	002662	京威股份	3,052,217.00	2.03
125	603788	宁波高发	3,046,316.96	2.02
126	300166	东方国信	3,038,474.00	2.02
127	601668	中国建筑	3,033,692.00	2.01

128	601390	中国中铁	3,032,064.00	2.01
129	600966	博汇纸业	3,018,237.06	2.00
130	300394	天孚通信	3,014,452.27	2.00

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600266	北京城建	16,171,303.93	10.74
2	600038	中直股份	13,051,941.32	8.67
3	000402	金融街	11,936,677.17	7.93
4	000001	平安银行	11,627,323.12	7.72
5	002108	沧州明珠	11,218,768.89	7.45
6	601166	兴业银行	10,817,801.74	7.18
7	601899	紫金矿业	10,660,559.22	7.08
8	600060	海信电器	9,632,715.48	6.40
9	000625	长安汽车	9,465,042.94	6.29
10	601225	陕西煤业	9,462,643.64	6.28
11	600019	宝钢股份	9,387,808.73	6.23
12	300224	正海磁材	9,202,524.71	6.11
13	600376	首开股份	8,854,286.09	5.88
14	000858	五粮液	8,748,563.60	5.81
15	600489	中金黄金	8,326,787.83	5.53
16	300059	东方财富	8,074,378.00	5.36
17	002051	中工国际	8,073,447.26	5.36
18	600970	中材国际	7,942,675.88	5.27
19	600000	浦发银行	7,851,863.26	5.21
20	000039	中集集团	7,628,324.20	5.07

21	000758	中色股份	7,288,225.00	4.84
22	601669	中国电建	7,272,563.00	4.83
23	603737	三棵树	7,220,487.07	4.80
24	002285	世联行	6,885,865.99	4.57
25	000895	双汇发展	6,814,429.07	4.53
26	002244	滨江集团	6,809,189.38	4.52
27	600458	时代新材	6,790,576.35	4.51
28	600183	生益科技	6,779,242.90	4.50
29	000157	中联重科	6,726,104.00	4.47
30	600536	中国软件	6,371,814.00	4.23
31	002466	天齐锂业	6,287,608.59	4.18
32	600068	葛洲坝	6,270,247.11	4.16
33	600348	阳泉煤业	6,226,635.98	4.14
34	600016	民生银行	6,117,703.00	4.06
35	002573	清新环境	5,897,132.00	3.92
36	300426	唐德影视	5,873,922.07	3.90
37	000968	蓝焰控股	5,767,364.20	3.83
38	000937	冀中能源	5,682,897.40	3.77
39	000063	中兴通讯	5,624,999.35	3.74
40	002236	大华股份	5,337,050.16	3.54
41	002126	银轮股份	5,294,022.72	3.52
42	600104	上汽集团	5,107,504.00	3.39
43	603798	康普顿	5,079,355.46	3.37
44	000776	广发证券	5,034,654.82	3.34
45	002081	金螳螂	5,017,715.98	3.33
46	002396	星网锐捷	5,011,164.21	3.33
47	600511	国药股份	4,986,957.76	3.31
48	601600	中国铝业	4,958,473.16	3.29

49	601021	春秋航空	4,877,570.27	3.24
50	600998	九州通	4,801,947.94	3.19
51	600195	中牧股份	4,751,242.20	3.16
52	002179	中航光电	4,714,758.68	3.13
53	600048	保利地产	4,705,393.48	3.12
54	600835	上海机电	4,678,203.12	3.11
55	600547	山东黄金	4,603,981.96	3.06
56	601117	中国化学	4,587,818.00	3.05
57	002518	科士达	4,584,546.00	3.04
58	603816	顾家家居	4,581,195.88	3.04
59	600008	首创股份	4,468,565.00	2.97
60	300072	三聚环保	4,467,713.01	2.97
61	600885	宏发股份	4,407,191.18	2.93
62	000792	盐湖股份	4,350,992.49	2.89
63	000037	深南电 A	4,334,727.20	2.88
64	002019	亿帆医药	4,256,122.90	2.83
65	000596	古井贡酒	4,251,126.48	2.82
66	603008	喜临门	4,241,286.88	2.82
67	600004	白云机场	4,168,336.95	2.77
68	600030	中信证券	4,099,186.00	2.72
69	600596	新安股份	4,035,121.92	2.68
70	603040	新坐标	4,027,542.72	2.67
71	002690	美亚光电	3,994,730.69	2.65
72	000069	华侨城 A	3,970,096.00	2.64
73	600562	国睿科技	3,927,933.00	2.61
74	000960	锡业股份	3,918,832.00	2.60
75	600487	亨通光电	3,890,891.90	2.58
76	300284	苏交科	3,871,653.35	2.57

77	600332	白云山	3,824,287.36	2.54
78	002027	分众传媒	3,803,924.34	2.53
79	002206	海利得	3,796,389.35	2.52
80	000068	华控赛格	3,792,107.79	2.52
81	000708	大冶特钢	3,760,274.22	2.50
82	000698	沈阳化工	3,760,105.12	2.50
83	601311	骆驼股份	3,751,136.00	2.49
84	600688	上海石化	3,747,293.00	2.49
85	601636	旗滨集团	3,677,982.00	2.44
86	600966	博汇纸业	3,640,868.02	2.42
87	601336	新华保险	3,618,132.20	2.40
88	601168	西部矿业	3,606,638.00	2.40
89	600383	金地集团	3,584,665.50	2.38
90	300068	南都电源	3,570,244.00	2.37
91	600325	华发股份	3,472,035.60	2.31
92	300078	思创医惠	3,463,105.36	2.30
93	002120	韵达股份	3,421,944.28	2.27
94	600741	华域汽车	3,401,123.00	2.26
95	002002	鸿达兴业	3,351,696.83	2.23
96	600150	中国船舶	3,339,832.00	2.22
97	603799	华友钴业	3,328,666.00	2.21
98	600498	烽火通信	3,328,608.33	2.21
99	600597	光明乳业	3,325,303.14	2.21
100	000999	华润三九	3,304,763.00	2.19
101	603180	金牌厨柜	3,286,429.00	2.18
102	600569	安阳钢铁	3,273,594.00	2.17
103	600889	南京化纤	3,271,568.18	2.17
104	600089	特变电工	3,264,795.00	2.17

105	002234	民和股份	3,260,392.00	2.17
106	002047	宝鹰股份	3,252,360.00	2.16
107	000021	深科技	3,251,637.09	2.16
108	002662	京威股份	3,236,562.03	2.15
109	000762	西藏矿业	3,230,020.20	2.15
110	600418	江淮汽车	3,216,380.00	2.14
111	600320	振华重工	3,169,332.48	2.10
112	002157	正邦科技	3,167,914.05	2.10
113	601992	金隅股份	3,163,837.92	2.10
114	600123	兰花科创	3,160,335.00	2.10
115	601677	明泰铝业	3,159,743.00	2.10
116	601699	潞安环能	3,131,473.31	2.08
117	600256	广汇能源	3,128,635.49	2.08
118	002585	双星新材	3,122,159.00	2.07
119	601058	赛轮金宇	3,108,838.40	2.06
120	601668	中国建筑	3,106,128.00	2.06
121	300394	天孚通信	3,106,122.00	2.06
122	601390	中国中铁	3,100,590.00	2.06
123	600153	建发股份	3,086,452.90	2.05
124	603788	宁波高发	3,059,912.90	2.03
125	300166	东方国信	3,024,266.03	2.01

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	811,508,814.81
卖出股票收入（成交）总额	762,228,253.75

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”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。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资贵金属。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.12.3 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	161,160.15
2	应收证券清算款	5,654,778.18
3	应收股利	-
4	应收利息	5,569.26
5	应收申购款	13,840.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,835,347.73

7.12.4 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。

7.12.5 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不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§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 (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
11,184	13,652.02	39,986,695.01	26.19%	112,697,530.70	73.81%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

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	69,784.06	0.0457%

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 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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年9月8日）基金份额总额	3,086,196,884.20
本报告期期初基金份额总额	113,260,290.64
本报告期基金总申购份额	51,751,792.11
减：本报告期基金总赎回份额	12,327,857.04
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	152,684,225.71

§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

一、基金管理人的重大人事变动

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。代为履行职务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。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

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

本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安永华明会计师事务所（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**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
光大证券	2	209,290,877.15	13.32%	190,737.25	13.32%	—
华西证券	1	189,960,445.18	12.09%	173,122.60	12.09%	—
中信建投	2	188,476,357.87	11.99%	171,760.46	11.99%	—
招商证券	2	156,614,423.00	9.97%	142,720.98	9.97%	—
东兴证券	1	114,637,083.18	7.30%	104,473.24	7.30%	—
中泰证券	1	94,949,417.44	6.04%	86,528.43	6.04%	—
方正证券	1	94,262,273.20	6.00%	85,900.95	6.00%	—
国泰君安	2	89,468,075.40	5.69%	81,536.07	5.69%	—
中金公司	3	85,271,567.21	5.43%	77,708.67	5.43%	—
中信证券	2	52,841,016.32	3.36%	48,155.12	3.36%	—
北京高华	1	52,717,816.61	3.35%	48,041.11	3.35%	—
东方证券	1	42,912,504.08	2.73%	39,114.58	2.73%	—
银河证券	4	33,481,893.57	2.13%	30,512.02	2.13%	—
红塔证券	1	28,169,722.76	1.79%	25,668.43	1.79%	—
世纪证券	1	25,180,929.10	1.60%	22,946.77	1.60%	—
民生证券	1	24,367,364.30	1.55%	22,205.98	1.55%	—
国信证券	1	23,072,585.33	1.47%	21,026.54	1.47%	—
瑞银证券	2	17,030,614.31	1.08%	15,520.23	1.08%	—
中原证券	1	12,772,456.88	0.81%	11,636.28	0.81%	—
上海证券	1	11,691,176.21	0.74%	10,651.40	0.74%	—

兴业证券	2	7,967,236.40	0.51%	7,260.34	0.51%	-
华泰证券	1	6,916,715.86	0.44%	6,298.64	0.44%	-
海通证券	1	6,881,727.04	0.44%	6,272.14	0.44%	-
爱建证券	1	2,402,859.40	0.15%	2,189.83	0.15%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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专用席位。

2、报告期内本基金新增交易单元：西藏东财、天风证券、瑞银证券；退租交易单元：长城证券。

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

无。

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	关于大成行业轮动混合型证券投资基金增加北京唐鼎耀华投资咨询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
2	大成行业轮动混合型证券投资基金更新的招募说明书(2017年第1期)–摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月21日
3	大成行业轮动混合型证券投资基金更新的招募说明书(2017年第1期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月21日
4	大成行业轮动混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月21日
5	大成行业轮动混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年3月24日
6	大成行业轮动混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年3月25日
7	大成行业轮动混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月21日
8	关于增加北京恒天明泽基金销售	中国证监会指定报	2017年3月25日

	有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	刊及本公司网站	
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建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 5 月 4 日
22	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
23	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

24	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
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 5 月 27 日
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
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	2017 年 3 月 17 日
35	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
36	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
37	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
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	2017 年 5 月 24 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	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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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

§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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§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行业轮动股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成行业轮动混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《大成行业轮动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。

12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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。

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8月24日