

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金  
2017 年半年度报告摘要  
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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成深证 ETF
场内简称	深证 ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 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	35,035,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国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

## 2.4 信息披露方式

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	基金管理人及基金托管人住所

## §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	-18,798,371.70
本期利润	15,356,142.17
加权平均基金份额本期利润	0.4087
本期基金份额净值增长率	3.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-5.0408
期末基金资产净值	388,714,320.02
期末基金份额净值	11.095

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

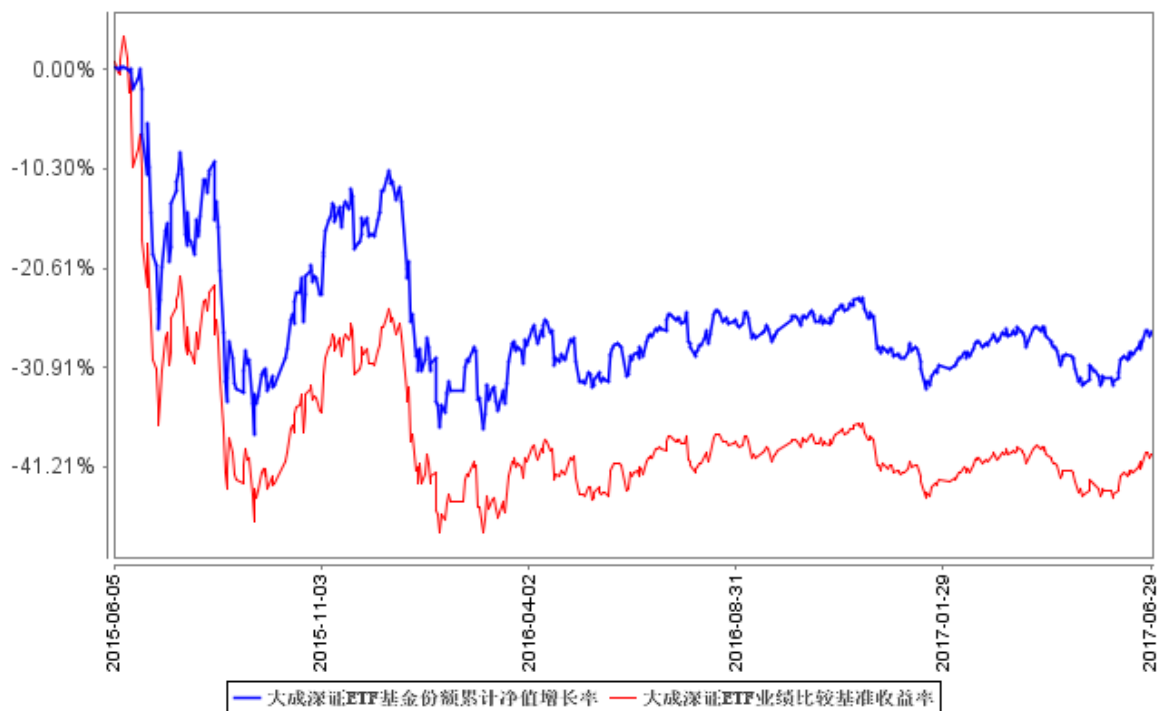
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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	6.98%	0.82%	6.74%	0.83%	0.24%	-0.01%
过去三个月	1.58%	0.87%	0.97%	0.88%	0.61%	-0.01%
过去六个月	3.87%	0.83%	3.46%	0.84%	0.41%	-0.01%
过去一年	0.50%	0.87%	0.38%	0.89%	0.12%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-27.16%	1.99%	-39.83%	2.09%	12.67%	-0.10%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## §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		
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	7 年	经济学硕士，中国注册会计师。2008 年 1 月至 2008 年 12 月先后任职于中国平安保险（集团）股份有限公司集团资金管理部、集团财务部，从事投资财务工作。2008 年 12 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计师、基金运营部基金核算中心主管、数量投资部数量分析师、数量与指数投资部高级数量分析师兼基金经理助理。2015 年 7 月 20 日至 2017 年 7 月 3 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金和大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅	本基金	2015 年 6 月 5	-	13 年	经济学硕士。2004 年 9 月至

先生	基金经 理、数 量与指 数投资 部副总 监	日		<p>2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。</p> <p>2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
----	--------------------------------------	---	--	--

注：1、杨台山先生已于 2017 年 7 月 3 日离任本基金基金经理助理职务。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

2、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

3、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

2017 年上半年，在投资的拉动下，宏观经济保持相对稳健的状态。供给侧改革相配合，大宗商品价格保持稳定，CPI、PPI 有所回暖。金融去杠杆政策初见成效，M2 增速开始放缓。海外方面，整体环境也趋于良好。马克龙当选法国总统，减轻了市场对于欧元区瓦解的担忧；而川普新政不达预期，令美元持续走弱，也在一定程度上缓解了人民币贬值的压力。

相对于宏观经济基本面，监管政策对流动性以及资本市场的影响更为直接。为了应对春节现金需求的流动性的冲击，央行创设了临时流动性便利工具，春节前流动性冲击低于市场预期，但之后 MLF 利率、公开市场操作、SLF 利率相继上调，形成结构性加息，表明货币政策依然中性偏紧，央行既希望避免流动性遭受冲击，也希望继续推动金融市场去杠杆。春节后，虽然 TLF

并未续作，其它节前央行投放的流动性也在逐步回收，但对市场流动性冲击不大，市场随之反弹。雄安新区消息出台后，股票市场到达短期高点，之后监管政策陆续出台，着力在金融领域去杠杆，引发了权益市场和固定收益市场在四、五月份的调整。进入六月份，为了避免出现系统性风险，监管政策有所缓和，央行也及时释放流动性，市场随之企稳走强。上半年市场基准沪深 300 指数上涨 10.78%。市场风格分化非常大，ROE 因子表现优异，家电、金融、消费等价值型板块领涨大市。

本基金标的指数深成指上涨 3.46%，涨幅低于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。上半年各项操作与指标均符合基金合同的要求。

#### 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 11.095 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.87%，业绩比较基准收益率为 3.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济有望继续维持稳定。政策取向预计没有太大的变化，仍将总体维持中性的货币政策以及积极的财政政策，以求在经济稳增长、促进结构性改革、控制金融风险等多个目标之间维持平衡。财政发力、PPP 项目落地，宏观经济可以依靠投资完成托底的任务；另一方面，货币政策空间有限，且边际效应递减，新经济周期难以展开，经济增速也不会太高。

对于股票市场，监管政策是目前最重要的影响因素。虽然金融市场去杠杆的基调没有争议，但最终的目标以及中间的路径存在非常高的不确定性。总体来说，在去杠杆的大背景下，股票市场不可能有系统性的牛市行情；而出于下半年重大政治事件的维稳考虑，发生系统性金融风险的可能性也几乎为零。预计市场仍将在一定区间内震荡，除非市场借维稳之机过度炒作，市场才可能在维稳需求消失后发生较大下行风险。市场风格受现行新股发行制度影响，将相对有利于价值型风格。一方面，打新无风险收益吸引资金入场，低估值、高分红的股票具有较高安全边际，表现稳健，适合作为低风险偏好资金的底仓配置。另一方面，新股加速发行，加大股票供给，降低了上市壳资源估值，对缺乏基本面支持的小票构成打击。

#### 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——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：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	5,256,360.92	4,117,850.66
结算备付金	10,653.07	4,794.28
存出保证金	3,007.14	13,736.64
交易性金融资产	383,870,785.77	431,449,359.25
其中：股票投资	383,870,785.77	431,449,359.25
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	26,190.14	-
应收利息	892.10	842.50
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	389,167,889.14	435,586,583.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	156,292.77	190,230.13
应付托管费	31,258.56	38,046.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,266.82	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,750.97	205,000.00
负债合计	453,569.12	433,276.15
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	533,712,434.95	620,543,637.48
未分配利润	-144,998,114.93	-185,390,330.30
所有者权益合计	388,714,320.02	435,153,307.18
负债和所有者权益总计	389,167,889.14	435,586,583.33

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 11.095 元，基金份额总额 35,035,342 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	17,002,527.12	-121,912,895.07
1.利息收入	13,067.39	27,306.62
其中：存款利息收入	13,067.39	27,268.02
债券利息收入	-	38.60
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）	-17,165,054.14	-23,439,277.11
其中：股票投资收益	-19,632,102.04	-26,661,936.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	18,862.27
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,467,047.90	3,203,797.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	34,154,513.87	-98,500,924.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	1,646,384.95	2,222,769.16
1. 管理人报酬	1,001,257.50	1,459,066.30
2. 托管费	200,251.56	291,813.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	133,874.92	177,710.85

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	311,000.97	294,178.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	15,356,142.17	-124,135,664.23
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	15,356,142.17	-124,135,664.23

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

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）	620,543,637.48	-185,390,330.30	435,153,307.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,356,142.17	15,356,142.17
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）	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
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）	533,712,434.95	-144,998,114.93	388,714,320.02
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）	885,607,308.57	-121,887,414.53	763,719,894.04
二、本期经营活动产生	-	-124,135,664.23	-124,135,664.23

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-105,111,455.76	31,189,839.14	-73,921,616.62
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-105,111,455.76	31,189,839.14	-73,921,616.62
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）	780,495,852.81	-214,833,239.62	565,662,613.19

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

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。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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。

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.4.1.1 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	10,941,368.78	12.48%	119,619,411.35	100.00%

**6.4.4.1.2 债券交易**

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	149,308.00	100.00%

**6.4.4.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.4.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.4.1.5 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	9,971.83	12.48%	5,266.82	100.00%
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	109,012.17	100.00%	65,994.23	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

**6.4.4.2 关联方报酬****6.4.4.2.1 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	1,001,257.50	1,459,066.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50% 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 × 0.50% ÷ 当年天数。

#### 6.4.4.2 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	200,251.56	291,813.27

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% ÷ 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 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。

##### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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。

#### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	5,256,360.92	12,484.46	8,128,371.67	25,254.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.5 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.5.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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。

## 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	2017年4月17日	重大事項	30.68	-	-	76,000	3,469,590.63	2,331,680.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事項	3.43	2017年7月26日	3.72	537,800	2,709,647.01	1,844,654.00	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事項	6.54	2017年7月5日	5.92	204,300	1,369,191.66	1,336,122.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事項	15.75	2017年8月9日	14.50	83,300	976,666.63	1,311,975.00	-
002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事項	20.24	-	-	58,720	1,355,825.28	1,188,492.80	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事項	8.27	-	-	142,500	2,284,274.96	1,178,475.00	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大事項	24.93	-	-	46,100	2,040,424.80	1,149,273.00	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事項	16.12	-	-	64,600	738,373.56	1,041,352.00	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事項	7.68	-	-	133,900	1,323,124.71	1,028,352.00	-
002168	深圳	2017	重	16.99	-	-	57,200	705,693.07	971,828.00	-

	惠程	年 1 月 23 日	大事项							
000887	中鼎股份	2017 年 4 月 27 日	重大事项目	22.09	2017 年 7 月 14 日	19.88	40,800	995,532.56	901,272.00	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事项目	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	27,000	1,126,623.62	832,140.00	-
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大事项目	23.36	-	-	28,500	860,384.97	665,760.00	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大事项目	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	32,462	665,097.50	649,240.00	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事项目	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	57,375	764,829.41	592,683.75	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项目	24.95	2017 年 7 月 4 日	22.46	22,670	732,807.36	565,616.50	-
000034	神州数码	2017 年 3 月 21 日	重大事项目	24.45	2017 年 7 月 18 日	22.01	20,500	453,747.69	501,225.00	-
300271	华宇软件	2017 年 6 月 22 日	重大事项目	16.59	2017 年 7 月 4 日	16.80	30,031	719,609.36	498,214.29	-
300267	尔康制药	2017 年 5 月 10 日	重大事项目	11.46	-	-	43,400	711,717.72	497,364.00	-
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	重大事项目	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	19,700	603,577.03	493,682.00	-
300291	华录	2017	重	20.02	-	-	24,000	726,701.40	480,480.00	-

	百纳	年 4 月 19 日	大事项								
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事项	20.23	-	-	23,180	538,879.39	468,931.40	-	
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项	9.06	-	-	47,732	744,828.88	432,451.92	-	
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事项	3.50	-	-	118,430	493,544.08	414,505.00	-	
002600	江粉磁材	2017 年 2 月 27 日	重大事项	11.46	2017 年 8 月 9 日	6.25	35,100	368,277.97	402,246.00	-	
300364	中文在线	2017 年 2 月 13 日	重大事项	37.28	-	-	10,400	544,019.71	387,712.00	-	
300098	高新兴	2017 年 6 月 22 日	重大事项	12.90	2017 年 7 月 3 日	13.18	29,900	482,826.69	385,710.00	-	
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	42,900	466,807.94	373,230.00	-	
300075	数字政通	2017 年 6 月 29 日	重大事项	20.94	2017 年 7 月 17 日	18.86	16,600	506,731.61	347,604.00	-	
002358	森源电气	2017 年 5 月 12 日	重大事项	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	20,100	459,384.80	342,102.00	-	
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	26,800	517,816.87	335,000.00	-	
300085	银之	2017	重	18.50	2017	18.88	17,777	727,076.60	328,874.50	-	

	杰	年 6 月 30 日	大 事 项		年 7 月 7 日						
002625	光启 技术	2017 年 4 月 13 日	重 大 事 项	36.36	-	-	8,700	429,062.86	316,332.00	-	-
000099	中信 海直	2017 年 5 月 4 日	重 大 事 项	11.26	-	-	27,100	549,055.97	305,146.00	-	-
300413	快乐 购	2017 年 4 月 5 日	重 大 事 项	20.29	-	-	14,900	487,630.17	302,321.00	-	-
002143	印纪 传媒	2017 年 4 月 18 日	重 大 事 项	24.93	-	-	12,100	385,776.47	301,653.00	-	-
002610	爱康 科技	2017 年 5 月 12 日	重 大 事 项	2.44	2017 年 8 月 2 日	2.44	123,000	403,421.56	300,120.00	-	-
002010	传化 智联	2017 年 6 月 30 日	重 大 事 项	15.26	2017 年 7 月 4 日	16.77	18,700	361,608.05	285,362.00	-	-
002681	奋达 科技	2017 年 6 月 22 日	重 大 事 项	12.59	2017 年 7 月 3 日	12.70	22,300	380,732.55	280,757.00	-	-
002619	巨龙 管业	2017 年 5 月 24 日	重 大 事 项	6.37	-	-	24,120	233,155.56	153,644.40	-	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。



## §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	383,870,785.77	98.64
	其中：股票	383,870,785.77	98.64
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	5,267,013.99	1.35
7	其他各项资产	30,089.38	0.01
8	合计	389,167,889.14	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,004,598.76	2.32
B	采矿业	4,897,219.29	1.26
C	制造业	237,521,126.02	61.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,300,532.61	1.36
E	建筑业	7,714,046.02	1.98
F	批发和零售业	9,550,873.20	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,702,608.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,785,616.58	10.49
J	金融业	23,853,006.72	6.14
K	房地产业	19,647,959.33	5.05
L	租赁和商务服务业	5,376,743.65	1.38
M	科学研究和技术服务业	350,028.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	7,359,599.66	1.89
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	3,015,140.12	0.78
R	文化、体育和娱乐业	6,739,012.10	1.73
S	综合	978,566.40	0.25

合计	383,796,676.46	98.73
----	----------------	-------

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	66,469.69	0.02
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	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	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	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
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	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	74,109.31	0.02

### 7.2.3 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前十名股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	299,200	12,318,064.00	3.17
2	000333	美的集团	279,750	12,040,440.00	3.10
3	000725	京东方 A	1,597,900	6,647,264.00	1.71
4	000858	五粮液	116,300	6,473,258.00	1.67
5	000002	万科 A	258,800	6,462,236.00	1.66

6	002415	海康威视	186,025	6,008,607.50	1.55
7	300498	温氏股份	228,104	5,346,757.76	1.38
8	000001	平安银行	530,200	4,978,578.00	1.28
9	000063	中兴通讯	148,600	3,527,764.00	0.91
10	002450	康得新	150,810	3,396,241.20	0.87

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的半年度报告正文。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
2	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
3	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
4	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
5	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的半年度报告正文。

### 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	300498	温氏股份	6,950,064.60	1.60
2	300516	久之洋	1,685,766.00	0.39
3	000333	美的集团	1,211,506.00	0.28
4	002044	美年健康	1,116,060.98	0.26
5	300296	利亚德	949,505.00	0.22
6	000008	神州高铁	810,474.97	0.19
7	000059	华锦股份	808,377.00	0.19
8	300458	全志科技	730,768.00	0.17
9	000413	东旭光电	690,719.00	0.16
10	002797	第一创业	626,803.00	0.14
11	300185	通裕重工	550,342.00	0.13
12	300118	东方日升	547,352.00	0.13
13	002716	金贵银业	546,285.98	0.13
14	000766	通化金马	531,566.00	0.12
15	002411	必康股份	527,898.00	0.12

16	002624	完美世界	525,402.00	0.12
17	002643	万润股份	514,340.00	0.12
18	002366	台海核电	513,797.00	0.12
19	000034	神州数码	498,015.78	0.11
20	002709	天赐材料	495,686.00	0.11

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	000002	万科 A	3,305,476.00	0.76
2	300516	久之洋	833,618.00	0.19
3	000538	云南白药	626,327.00	0.14
4	000410	*ST 沈机	617,774.00	0.14
5	002312	*ST 三泰	570,575.00	0.13
6	000816	智慧农业	558,537.00	0.13
7	000651	格力电器	539,523.00	0.12
8	000401	冀东水泥	538,502.32	0.12
9	002028	思源电气	532,618.22	0.12
10	000666	经纬纺机	527,425.00	0.12
11	000616	海航投资	517,866.00	0.12
12	000100	TCL 集团	513,508.00	0.12
13	000572	海马汽车	495,720.00	0.11
14	000830	鲁西化工	474,687.00	0.11
15	000652	泰达股份	474,591.00	0.11
16	000735	罗牛山	458,831.80	0.11
17	000897	津滨发展	458,114.00	0.11
18	000528	柳 工	452,025.00	0.10
19	002071	长城影视	450,000.00	0.10
20	002450	康得新	449,732.00	0.10

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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	43,700,716.41
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	47,688,696.72
--------------	---------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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 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。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

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

#### 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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	3,007.14
2	应收证券清算款	26,190.14
3	应收股利	-
4	应收利息	892.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,089.38

### 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

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002879	长缆科技	23,660.26	0.01	新股未流通
2	002882	金龙羽	18,389.20	0.00	新股未流通
3	300670	大烨智能	13,760.87	0.00	新股未流通
4	300672	国科微	10,659.36	0.00	新股未流通
5	300671	富满电子	7,639.62	0.00	新股未流通

### 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
9,535	3,674.39	362,712.00	1.04%	34,672,630.00	98.96%

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.57%
2	林莹	197,096.00	0.56%
3	戴济民	196,967.00	0.56%
4	贺雅宁	196,965.00	0.56%
5	寇胜利	196,694.00	0.56%
6	张小丽	183,386.00	0.52%
7	吕君	180,000.00	0.51%
8	靳艳华	140,369.00	0.40%
9	谢元禄	131,444.00	0.38%
10	刘小彦	131,310.00	0.37%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月5日）基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	40,735,342.00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	5,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	35,035,342.00



## §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，杜鹃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。

### 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

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	
国泰君安	2	76,701,374.71	88.80%	69,899.39	88.80%	-
光大证券	2	10,941,368.78	11.20%	9,971.83	11.20%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-

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。

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本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。

本报告期内本基金退租交易单元：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。

**§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。
----

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日