

大成新锐产业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

|  |           |
|--|-----------|
| <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>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12        |
| 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.....       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12        |
| 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..... | 12        |
| 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.....     | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 16        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>31</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 31        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 31        |
| 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.....     | 32        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 32        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 35        |
| 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.....    | 35        |
| 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..... | 35        |
| 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..... | 35        |
| 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.....    | 35        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 35        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 35        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 35        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>36</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 36        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 36        |
| 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.....     | 36        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>37</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>37</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 37        |
| 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.....      | 37        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 37        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 37        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 38        |
| 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.....         | 38        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 38        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 40        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>43</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.....    | 43        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 43        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>43</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 43        |
| 12.2 存放地点.....           | 43        |
| 12.3 查阅方式.....           | 43        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金名称       | 大成新锐产业混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 大成新锐产业混合        |
| 基金主代码      | 090018          |
| 交易代码       | 090018          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2012 年 3 月 20 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 | 53,141,199.27 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于新锐产业中的优质上市公司，分享中国经济增长新锐力量的成长收益，追求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金采用自上而下、自下而上相结合的积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析，实施大类资产配置；分析中国经济结构转型背景下社会意识（可持续发展观等）、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响，研究各个新锐产业发展所处的阶段特征和商业前景，结合各个新锐产业股票群体的流动性、整体估值水平和动量，实施新锐产业之行业配置。对新锐产业各公司在所属行业的竞争优势进行细致分析（包括技术变迁路径与核心技术、技术制式与商业模式、市场策略与需求融合、人力资源等诸多方面），结合股票基本面指标分析（包括成长性指标、估值水平），精选优质上市公司股票，力求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 | 本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种。   |

### 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<br>7088 号招商银行大厦 32<br>层 | 北京市东城区建国门内大街 69<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<br>层 | 北京市西城区复兴门内大街 28<br>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       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《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          | 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       | -3,059.87                             |
| 本期利润          | -6,380,915.38                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1072                               |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.47%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | -6.46%                                |
| 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      | 31,460,303.02                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5920                                |
| 期末基金资产净值      | 84,601,502.29                         |
| 期末基金份额净值      | 1.592                                 |
| 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   | 119.53%                               |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

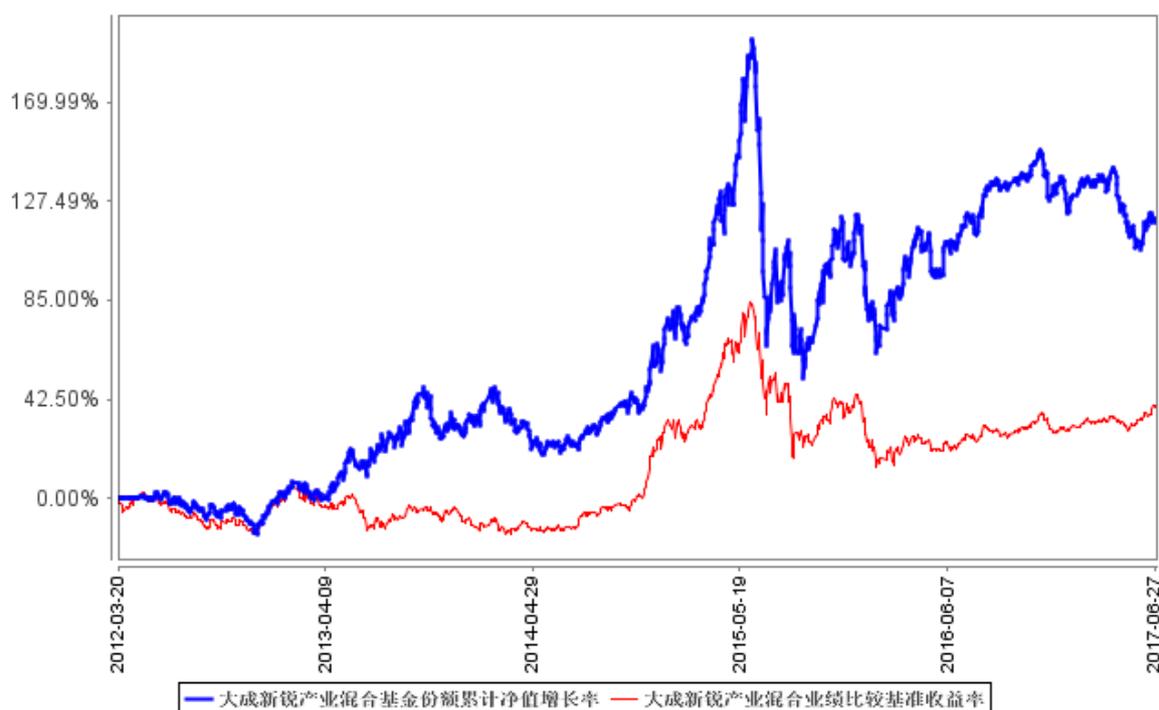
3、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 4.53%    | 1.01%       | 4.19%      | 0.54%         | 0.34%   | 0.47% |
| 过去三个月      | -5.46%   | 1.02%       | 4.92%      | 0.50%         | -10.38% | 0.52% |
| 过去六个月      | -6.46%   | 0.89%       | 8.59%      | 0.46%         | -15.05% | 0.43% |
| 过去一年       | 3.04%    | 0.85%       | 13.05%     | 0.54%         | -10.01% | 0.31% |
| 过去三年       | 77.03%   | 1.92%       | 59.62%     | 1.40%         | 17.41%  | 0.52% |
| 自基金合同生效起至今 | 119.53%  | 1.69%       | 39.74%     | 1.25%         | 79.79%  | 0.44% |

#### 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：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。

## §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 |        |  |
| 周德昕先生 | 本基金基金经理 | 2015年5月23日      | -    | 14年    | 财务管理学硕士。曾任职于哈里投资有限公司、新疆证券有限责任公司及广发证券股份有限公司，从事投资研究工作。2007年3月至2012年3月任职于招商基金管理有限公司，历任高级研究员、研究组长、助理基金经理及招商大盘蓝筹股票型证券投资基金及招商中小盘精选股票型证券投资基金基金经理。2012年4月至2014年4月任职于安信证券股份有限公司，历任证券投资部执行总经理及资产管理部副总经理。2014年4月加入大成基金管理有限公司，现任股票投资部成长组投资总监。2014年6月26日起任大 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 23 日至 2015 年 7 月 2 日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 3 日起任大成新锐产业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 |
|--|--|--|--|--|--|

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

2017 年上半年，宏观经济基本面趋于稳定增长状况，螺纹钢为代表的工业原料价格大幅上涨，重卡、工程机械需求同比大幅增长。在此背景下，加上在遏制资产泡沫的主旨下，央行在货币政策上引导“中性”，三会积极配合金融去杠杆，使得市场流动性不时出现紧张局面，在债券和权益市场出现大面积下跌的背景下，央行进行了多次安抚性操作，使得年中的流动性没有出现大问题。在股市上，政策上积极放行 IPO，严厉打击重组并购，引导价值投资，成功进入 MSCI 指数。在上述背景下，第二季度的股票市场出现了明显的 3000-50 现象。操作上，权益部分组合，主要围绕 PPP、一带一路、电网改造、资产折价股、军民融合、国企改革上做了布局，并在新疆、雄安两个主题上做了适量交易。

##### 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 1.592 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.46%，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

展望下半年，宏观经济预计呈现温和增长的态势，相比于上半年，经济增长的动能有所减弱。同时中央抑制资产泡沫的主基调不会改变，货币政策维持中性，操作上以不出现系统性风险的偏紧思路，积极引导去杠杆，清理地方债务问题，因此，利率中枢仍居高难下。从海外市场来看，随着特朗普在政治上压力的减缓，强势美元的预期增强及兑现将对人民币资产构成压力。另外 19 大将是下半年最为重要的事件，诸多国内政策将会以此为中心。综上，我们预计，下半年权益市场将呈现震荡的格局，机会仍然是结构性的，因此“着眼于中长期优质增长的公司”将是组合的首选。

#### 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验，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：大成新锐产业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         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.3.1    | 5,119,420.30                   | 16,598,957.81                    |
| 结算备付金           |            | 81,184.80                      | 923,557.42                       |
| 存出保证金           |            | 91,666.70                      | 200,978.14                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.3.2    | 78,067,381.10                  | 102,377,857.29                   |
| 其中：股票投资         |            | 78,067,381.10                  | 102,377,857.29                   |
| 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         |            | 1,724,767.20                   | 1,071,222.83                     |
| 应收利息            | 6.4.3.5    | 1,810.43                       | 3,907.86                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 17,028.38                      | 1,238,043.61                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.3.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 85,103,258.91                  | 122,414,524.96                   |
| <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>上年度末<br/>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          | 6.4.3.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |

|               |          |               |                |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 应付赎回款         |          | 92,049.29     | 182,501.86     |
| 应付管理人报酬       |          | 104,163.77    | 153,850.78     |
| 应付托管费         |          | 17,360.64     | 25,641.78      |
| 应付销售服务费       |          | -             | -              |
| 应付交易费用        | 6.4.3.7  | 149,038.21    | 267,717.02     |
| 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  | 139,144.71    | 120,687.78     |
| 负债合计          |          | 501,756.62    | 750,399.22     |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |                |
| 实收基金          | 6.4.3.9  | 53,141,199.27 | 71,466,274.32  |
| 未分配利润         | 6.4.3.10 | 31,460,303.02 | 50,197,851.42  |
| 所有者权益合计       |          | 84,601,502.29 | 121,664,125.74 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 85,103,258.91 | 122,414,524.96 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.592 元，基金份额总额 53,141,199.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成新锐产业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<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | -4,706,432.00                            | 2,411,160.71                                  |
| 1.利息收入                |          | 46,158.31                                | 50,479.56                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.3.11 | 46,158.31                                | 50,404.88                                     |
| 债券利息收入                |          | -  | 74.68   |
| 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）      |          | 1,572,023.62                             | 1,935,089.42                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.3.12 | 1,029,689.07                             | 1,592,097.31                                  |
| 基金投资收益                |          | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.3.13 | -  | -   |
| 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 | 542,334.55                               | 342,992.11                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.17 | -6,377,855.51                            | 385,387.39                                    |

|                            |           |               |              |
|----------------------------|-----------|---------------|--------------|
| 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  | 53,241.58     | 40,204.34    |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 1,674,483.38  | 1,887,451.92 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.6.2.1 | 735,640.85    | 514,284.19   |
| 2. 托管费                     | 6.4.6.2.2 | 122,606.81    | 85,713.98    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.6.2.3 | -             | -            |
| 4. 交易费用                    | 6.4.3.19  | 665,347.90    | 1,135,677.86 |
| 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  | 150,887.82    | 151,775.89   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | -6,380,915.38 | 523,708.79   |
| 减：所得税费用                    |           | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | -6,380,915.38 | 523,708.79   |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成新锐产业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<br>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）                        | 71,466,274.32                         | 50,197,851.42  | 121,664,125.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -6,380,915.38  | -6,380,915.38  |
| 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）      | -18,325,075.05                        | -12,356,633.02 | -30,681,708.07 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 8,849,083.50                          | 5,832,075.14   | 14,681,158.64  |
| 2. 基金赎回款                               | -27,174,158.55                        | -18,188,708.16 | -45,362,866.71 |
| 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） | -                                     | -              | -              |



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 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 5,119,420.30           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 5,119,420.30           |

#### 6.4.3.2 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        | 85,622,392.24          | 78,067,381.10 | -7,555,011.14 |
| 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     | 85,622,392.24 | 78,067,381.10 | -7,555,011.14 |

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,740.41          |
| 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  | 32.85             |
| 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         | 37.17             |
| 合计         | 1,810.43          |

#### 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 | 149,038.21      |
| 银行间市场应付交易费用 | -               |
| 合计          | 149,038.21      |

#### 6.4.3.8 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       | 294.18                 |
| 预提费用        | 138,850.53             |
| 合计          | 139,144.71             |

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 71,466,274.32                         | 71,466,274.32  |
| 本期申购          | 8,849,083.50                          | 8,849,083.50   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -27,174,158.55                        | -27,174,158.55 |
| 本期末           | 53,141,199.27                         | 53,141,199.27  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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           | 68,457,299.31  | -18,259,447.89 | 50,197,851.42  |
| 本期利润           | -3,059.87      | -6,377,855.51  | -6,380,915.38  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -18,059,165.37 | 5,702,532.35   | -12,356,633.02 |
| 其中：基金申购款       | 8,799,439.34   | -2,967,364.20  | 5,832,075.14   |
| 基金赎回款          | -26,858,604.71 | 8,669,896.55   | -18,188,708.16 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 50,395,074.07  | -18,934,771.05 | 31,460,303.02  |

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|           |           |
|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 41,404.66 |
| 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 | 3,311.69  |
| 其他        | 1,441.96  |
| 合计        | 46,158.31 |

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 228,247,983.48             |
| 减：卖出股票成本总额 | 227,218,294.41             |
| 买卖股票差价收入   | 1,029,689.07               |

#### 6.4.3.13 债券投资收益

本基金报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 542,334.55                 |
| 合计          | 542,334.55                 |

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -6,377,855.51              |
| ——股票投资     | -6,377,855.51              |
| ——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      | -6,377,855.51 |

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 35,027.93                  |
| 基金转换费收入 | 18,213.65                  |
| 合计      | 53,241.58                  |

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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 665,347.90                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 665,347.90                 |

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 19,835.79                  |
| 信息披露费     | 119,014.74                 |
| 银行划款手续费   | 2,937.29                   |
| 债券托管帐户维护费 | 9,000.00                   |
| 其他        | 100.00                     |
| 合计        | 150,887.82                 |

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 光大证券  | 34,208,464.69              | 7.83%            | 57,050,378.60                   | 7.57%            |

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |         |          |         |
|-------|----------------------------|---------|----------|---------|
|       | 当期佣金                       | 占当期佣金总量 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 |

|       |                                 | 的比例        |           | 总额的比例        |
|-------|---------------------------------|------------|-----------|--------------|
| 光大证券  | 31,174.01                       | 7.83%      | 31,174.01 | 20.92%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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  | 51,991.30                       | 7.57%      | 51,991.30 | 15.07%       |

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。

#### 6.4.6.2 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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 735,640.85                 | 514,284.19                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 297,418.84                 | 192,622.96                      |

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 122,606.81                 | 85,713.98                       |

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

**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**

本报告期内本基金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之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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>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 | 5,119,420.30               | 41,404.66 | 26,721,599.74                   | 44,218.21 |

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。

**6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.6.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

**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**

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

**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 | 复牌开盘价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|--------|------|-------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|--------|------|-------|-------|--------|--------|----|

|        |      |                 |        |       |                 |       |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|--------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 002596 | 海南瑞泽 | 2017 年 5 月 22 日 | 重大资产重组 | 8.29  | -               | -     | 452,900 | 4,152,426.28 | 3,754,541.00 | - |
| 300030 | 阳普医疗 | 2017 年 5 月 16 日 | 重大资产重组 | 11.62 | 2017 年 8 月 15 日 | 11.62 | 50,000  | 719,874.77   | 581,000.00   | - |

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。

### 6.4.8.3 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，本基金无从事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，本基金无从事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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

其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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.9.3 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、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖

出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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。

#### 6.4.9.4 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、存出保证金及应收申购款等。

##### 6.4.9.4.1.1 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                   | 5,119,420.30 | -     | -     | -             | 5,119,420.30  |
| 结算备付金                  | 81,184.80    | -     | -     | -             | 81,184.80     |
| 存出保证金                  | 91,666.70    | -     | -     | -             | 91,666.70     |
| 交易性金融资产                | -            | -     | -     | 78,067,381.10 | 78,067,381.10 |
| 应收证券清算款                | -            | -     | -     | 1,724,767.20  | 1,724,767.20  |
| 应收利息                   | -            | -     | -     | 1,810.43      | 1,810.43      |
| 应收申购款                  | -            | -     | -     | 17,028.38     | 17,028.38     |
| 资产总计                   | 5,292,271.80 | -     | -     | 79,810,987.11 | 85,103,258.91 |
| 负债                     |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                  | -            | -     | -     | 92,049.29     | 92,049.29     |

|                     |               |      |      |                |                |
|---------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 104,163.77     | 104,163.77     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 17,360.64      | 17,360.64      |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 149,038.21     | 149,038.21     |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 139,144.71     | 139,144.71     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 501,756.62     | 501,756.62     |
| 利率敏感度缺口             | 5,292,271.80  | -    | -    | 79,309,230.49  | 84,601,502.29  |
| 上年度末<br>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                | 16,598,957.81 | -    | -    | -              | 16,598,957.81  |
| 结算备付金               | 923,557.42    | -    | -    | -              | 923,557.42     |
| 存出保证金               | 200,978.14    | -    | -    | -              | 200,978.14     |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 102,377,857.29 | 102,377,857.29 |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -    | 1,071,222.83   | 1,071,222.83   |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 3,907.86       | 3,907.86       |
| 应收申购款               | 5,109.35      | -    | -    | 1,232,934.26   | 1,238,043.61   |
| 其他资产                | -             | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计                | 17,728,602.72 | -    | -    | 104,685,922.24 | 122,414,524.96 |
| 负债                  |               |      |      |                |                |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 182,501.86     | 182,501.86     |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 153,850.78     | 153,850.78     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 25,641.78      | 25,641.78      |
| 应付交易费用              | -             | -    | -    | 267,717.02     | 267,717.02     |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 120,687.78     | 120,687.78     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 750,399.22     | 750,399.22     |
| 利率敏感度缺口             | 17,728,602.72 | -    | -    | 103,935,523.02 | 121,664,125.74 |

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 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。

#### 6.4.9.4.3 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或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下、自下而上”相结合的积极主动的投资策略，通过对作为新兴生产力代表的新锐产业的内外部环境条件、政策导向、科技进步等各方面的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的比例范围为 60%-95%；现金以及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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行；本基金将 80%以上的股票资产投资于新锐产业相关股票。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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 78,067,381.10          | 92.28                    | 102,377,857.29           | 84.15                 |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | 0.00                     | —                        | 0.00                  |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                      | 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            | 78,067,381.10          | 92.28                    | 102,377,857.29           | 84.15                 |

#### 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：人民币万元） |                |
|    |                      | 本期末（2017 年 6 月               | 上年度末（2016 年 12 |

|  |                | 30 日 ) | 月 31 日 ) |
|--|----------------|--------|----------|
|  | 1. 业绩比较基准上升 5% | 增加 496 | 增加 791   |
|  | 2. 业绩比较基准下降 5% | 减少 496 | 减少 791   |

#### 6.4.10 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              | 78,067,381.10 | 91.73         |
|    | 其中：股票             | 78,067,381.10 | 91.73         |
| 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      | 5,200,605.10  | 6.11          |
| 7  | 其他各项资产            | 1,835,272.71  | 2.16          |
| 8  | 合计                | 85,103,258.91 | 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         | -             | 0.00          |
| B  | 采矿业              | -             | 0.00          |
| C  | 制造业              | 28,054,641.00 | 33.16         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 21,693,308.40 | 25.64         |
| E  | 建筑业              | 2,438,800.00  | 2.88          |
| F  | 批发和零售业           | 4,687,800.00  | 5.54          |
| 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  | -             | 0.00          |
| J  | 金融业              | -             | 0.00          |
| K  | 房地产业             | 13,309,029.16 | 15.73         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | 0.00          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 3,179,800.00  | 3.76          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,704,002.54  | 5.56          |
| 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        | 78,067,381.10 | 92.28 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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  | 000685 | 中山公用 | 745,600   | 8,164,320.00 | 9.65         |
| 2  | 600969 | 郴电国际 | 493,802   | 7,011,988.40 | 8.29         |
| 3  | 600565 | 迪马股份 | 1,226,600 | 6,758,566.00 | 7.99         |
| 4  | 000709 | 河钢股份 | 1,610,000 | 6,745,900.00 | 7.97         |
| 5  | 600310 | 桂东电力 | 950,000   | 6,517,000.00 | 7.70         |
| 6  | 000401 | 冀东水泥 | 420,000   | 6,463,800.00 | 7.64         |
| 7  | 002573 | 清新环境 | 249,947   | 4,704,002.54 | 5.56         |
| 8  | 600739 | 辽宁成大 | 260,000   | 4,687,800.00 | 5.54         |
| 9  | 002596 | 海南瑞泽 | 452,900   | 3,754,541.00 | 4.44         |
| 10 | 000863 | 三湘印象 | 449,913   | 3,293,363.16 | 3.89         |
| 11 | 002146 | 荣盛发展 | 330,000   | 3,257,100.00 | 3.85         |
| 12 | 601766 | 中国中车 | 320,000   | 3,238,400.00 | 3.83         |
| 13 | 002116 | 中国海诚 | 260,000   | 3,179,800.00 | 3.76         |
| 14 | 601003 | 柳钢股份 | 700,000   | 3,136,000.00 | 3.71         |
| 15 | 300446 | 乐凯新材 | 80,000    | 2,725,600.00 | 3.22         |
| 16 | 600939 | 重庆建工 | 227,500   | 2,438,800.00 | 2.88         |
| 17 | 002096 | 南岭民爆 | 135,000   | 1,409,400.00 | 1.67         |
| 18 | 300030 | 阳普医疗 | 50,000    | 581,000.00   | 0.69         |

### 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  | 002596 | 海南瑞泽 | 9,424,585.00 | 7.75           |
| 2  | 600310 | 桂东电力 | 9,017,832.26 | 7.41           |
| 3  | 002037 | 久联发展 | 8,231,757.00 | 6.77           |
| 4  | 300237 | 美晨科技 | 7,382,817.00 | 6.07           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5  | 000709 | 河钢股份 | 6,973,400.00 | 5.73 |
| 6  | 002573 | 清新环境 | 6,957,304.30 | 5.72 |
| 7  | 000401 | 冀东水泥 | 6,747,049.21 | 5.55 |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 6,237,163.80 | 5.13 |
| 9  | 600565 | 迪马股份 | 5,987,206.00 | 4.92 |
| 10 | 000826 | 启迪桑德 | 5,836,140.48 | 4.80 |
| 11 | 600969 | 郴电国际 | 5,397,062.53 | 4.44 |
| 12 | 600739 | 辽宁成大 | 4,677,324.13 | 3.84 |
| 13 | 002047 | 宝鹰股份 | 4,619,778.00 | 3.80 |
| 14 | 600055 | 万东医疗 | 4,245,431.68 | 3.49 |
| 15 | 600629 | 华建集团 | 4,230,688.00 | 3.48 |
| 16 | 000778 | 新兴铸管 | 3,867,000.00 | 3.18 |
| 17 | 002096 | 南岭民爆 | 3,690,600.40 | 3.03 |
| 18 | 002146 | 荣盛发展 | 3,398,025.00 | 2.79 |
| 19 | 000863 | 三湘印象 | 3,328,322.03 | 2.74 |
| 20 | 600395 | 盘江股份 | 3,308,549.00 | 2.72 |
| 21 | 600581 | 八一钢铁 | 3,269,035.00 | 2.69 |
| 22 | 601766 | 中国中车 | 3,225,600.00 | 2.65 |
| 23 | 601003 | 柳钢股份 | 3,199,511.00 | 2.63 |
| 24 | 002116 | 中国海诚 | 3,130,988.29 | 2.57 |
| 25 | 000623 | 吉林敖东 | 2,986,752.04 | 2.45 |
| 26 | 601588 | 北辰实业 | 2,953,514.53 | 2.43 |
| 27 | 300446 | 乐凯新材 | 2,943,479.16 | 2.42 |
| 28 | 603008 | 喜临门  | 2,939,013.49 | 2.42 |
| 29 | 002482 | 广田集团 | 2,725,084.00 | 2.24 |
| 30 | 601919 | 中远海控 | 2,670,000.00 | 2.19 |
| 31 | 600939 | 重庆建工 | 2,491,657.00 | 2.05 |
| 32 | 600428 | 中远海特 | 2,488,000.00 | 2.04 |

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（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  | 300237 | 美晨科技 | 17,801,460.79 | 14.63          |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2  | 300447 | 全信股份 | 10,600,955.00 | 8.71 |
| 3  | 002047 | 宝鹰股份 | 7,948,005.70  | 6.53 |
| 4  | 002037 | 久联发展 | 7,602,094.45  | 6.25 |
| 5  | 600969 | 郴电国际 | 7,432,270.99  | 6.11 |
| 6  | 000826 | 启迪桑德 | 6,352,482.10  | 5.22 |
| 7  | 000513 | 丽珠集团 | 5,967,456.35  | 4.90 |
| 8  | 002032 | 苏泊尔  | 5,919,315.65  | 4.87 |
| 9  | 300059 | 东方财富 | 5,863,711.19  | 4.82 |
| 10 | 002310 | 东方园林 | 5,365,535.00  | 4.41 |
| 11 | 600055 | 万东医疗 | 5,040,254.56  | 4.14 |
| 12 | 000778 | 新兴铸管 | 5,031,000.00  | 4.14 |
| 13 | 002596 | 海南瑞泽 | 4,965,623.00  | 4.08 |
| 14 | 000423 | 东阿阿胶 | 4,627,046.00  | 3.80 |
| 15 | 300197 | 铁汉生态 | 4,447,957.00  | 3.66 |
| 16 | 601699 | 潞安环能 | 4,373,925.00  | 3.60 |
| 17 | 600629 | 华建集团 | 4,274,757.00  | 3.51 |
| 18 | 002673 | 西部证券 | 3,924,449.32  | 3.23 |
| 19 | 600581 | 八一钢铁 | 3,771,330.00  | 3.10 |
| 20 | 002296 | 辉煌科技 | 3,240,161.19  | 2.66 |
| 21 | 601588 | 北辰实业 | 3,117,034.35  | 2.56 |
| 22 | 603008 | 喜临门  | 3,073,341.67  | 2.53 |
| 23 | 000623 | 吉林敖东 | 2,953,012.43  | 2.43 |
| 24 | 002011 | 盾安环境 | 2,929,021.16  | 2.41 |
| 25 | 600395 | 盘江股份 | 2,821,971.00  | 2.32 |
| 26 | 002683 | 宏大爆破 | 2,795,042.49  | 2.30 |
| 27 | 601919 | 中远海控 | 2,707,813.00  | 2.23 |
| 28 | 600428 | 中远海特 | 2,677,627.00  | 2.20 |
| 29 | 002482 | 广田集团 | 2,663,963.00  | 2.19 |
| 30 | 600449 | 宁夏建材 | 2,439,410.00  | 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 | 209,285,673.73 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 228,247,983.48 |

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**

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以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

**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的备选股票库之外的股票。****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   | 91,666.70    |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,724,767.20 |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 1,810.43     |
| 5 | 应收申购款   | 17,028.38    |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 1,835,272.71 |

#### 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

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  | 002596 | 海南瑞泽 | 3,754,541.00 | 4.44          | 停牌       |

#### 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<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 |
| 4,894        | 10,858.44     | 10,213,007.17 | 19.22%     | 42,928,192.10 | 80.78%     |

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 | 24.22      | 0.0000%  |

#### 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 |
|-----------------|---|

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012年3月20日）基金份额总额 | 2,049,911,272.87 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 71,466,274.32    |
| 本报告期基金总申购份额               | 8,849,083.50     |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 27,174,158.55    |
| 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              | 53,141,199.27    |

### §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

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 |    |
| 中信建投 | 2      | 117,365,563.59 | 26.85%       | 106,950.73 | 26.85%     | -  |
| 银河证券 | 4      | 97,396,501.45  | 22.28%       | 88,756.49  | 22.28%     | -  |
| 万和证券 | 1      | 93,644,563.13  | 21.42%       | 85,341.34  | 21.43%     | -  |
| 光大证券 | 2      | 34,208,464.69  | 7.83%        | 31,174.01  | 7.83%      | -  |
| 申万宏源 | 2      | 20,761,869.36  | 4.75%        | 18,920.61  | 4.75%      | -  |
| 国金证券 | 2      | 20,327,190.86  | 4.65%        | 18,523.73  | 4.65%      | -  |
| 东吴证券 | 1      | 17,578,771.18  | 4.02%        | 16,020.74  | 4.02%      | -  |
| 安信证券 | 1      | 9,199,851.56   | 2.10%        | 8,383.77   | 2.10%      | -  |
| 西部证券 | 1      | 6,769,883.19   | 1.55%        | 6,169.56   | 1.55%      | -  |
| 兴业证券 | 2      | 4,372,334.00   | 1.00%        | 3,984.24   | 1.00%      | -  |
| 东北证券 | 2      | 3,422,010.14   | 0.78%        | 3,118.57   | 0.78%      | -  |
| 中原证券 | 1      | 3,389,067.00   | 0.78%        | 3,088.35   | 0.78%      | -  |
| 红塔证券 | 1      | 3,225,600.00   | 0.74%        | 2,939.61   | 0.74%      | -  |
| 世纪证券 | 1      | 2,890,937.95   | 0.66%        | 2,634.31   | 0.66%      | -  |
| 瑞银证券 | 2      | 1,606,483.00   | 0.37%        | 1,464.07   | 0.37%      | -  |
| 平安证券 | 1      | 930,772.82     | 0.21%        | 848.23     | 0.21%      | -  |
| 山西证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 上海证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 华创证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 华泰证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 华西证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 联讯证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 民生证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |

|      |   |   |       |   |       |   |
|------|---|---|-------|---|-------|---|
| 南京证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 北京高华 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 川财证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 第一创业 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 东方证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 东兴证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 方正证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国盛证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国信证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 海通证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 天风证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国泰君安 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 爱建证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 广发证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 长城证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 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% | - |
| 中泰证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中银国际 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 招商证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中金公司 | 3 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |

注：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。

本报告期内增加交易单元：西藏东财、天风证券、瑞银证券。

本报告期内退租交易单元：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  | 大成新锐产业混合型证券投资基金更新招募说明书（2017年1期）-摘要       | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年5月5日  |
| 2  | 大成新锐产业混合型证券投资基金更新招募说明书（2017年1期）          | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017年5月5日  |
| 3  | 大成新锐产业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 |
| 4  | 大成新锐产业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25日 |
| 5  | 大成新锐产业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 |
| 6  | 大成新锐产业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 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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  |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |
| 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6月28日 |

|    |   |                 |                 |
|----|---|-----------------|-----------------|
| 13 | 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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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  |
| 17 | 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 |
| 18 | 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 |
| 19 | 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  |
| 20 | 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  |
| 21 | 大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告                | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 1 月 19 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的公告                | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 4 月 1 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的公告                | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 4 月 28 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的公告                | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2017 年 5 月 27 日 |
| 25 | 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  |
| 26 | 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  |
| 27 | 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  |
| 28 | 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  |
| 29 | 大成基金管理有限公司关于旗下                            | 中国证监会指定报        | 2017 年 1 月 17 日 |

|    |  |                 |            |
|----|--|-----------------|------------|
|    | 部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告                 | 刊及本公司网站         |            |
| 30 | 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 |
| 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1月17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2月11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3月17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4月18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22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5月12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24日 |
| 38 | 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 |
| 39 | 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 |
| 40 | 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 |
| 41 | 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 |
| 42 | 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 |
| 43 | 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 |
| 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27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28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29日 |
| 47 | 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 |
| 48 | 大成基金关于旗下部分基金增加                           | 中国证监会指定报        | 2017年6月16日 |

|    |                                       |                 |                 |
|----|---------------------------------------|-----------------|-----------------|
|    | 平安证券股份有限公司为销售机构的公告                    | 刊及本公司网站         |                 |
| 49 | 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 |
| 50 | 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

无。

### §12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立大成新锐产业股票型证券投资基金的文件；
- (二) 《大成新锐产业股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型以及修订基金合同部分条款的公告》
- (三) 《大成新锐产业混合型证券投资基金基金合同》；
- (四) 《大成新锐产业混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- (六) 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