

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金  
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 2020 生命周期混合
基金主代码	090006
前端交易代码	090006
后端交易代码	091006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 9 月 13 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,330,274,338.51 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有良好流动性的权益证券、固定收益证券和（或）货币市场工具等，通过调整资产配置策略和精选证券，以超越业绩比较基准，寻求在一定风险承受水平下的当期收益和资本增值的整体最大化。在 2020 年 12 月 31 日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在 2020 年 12 月 31 日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。
投资策略	本基金在组合构建中强调风险收益比的合理优化，将纪律性和科学性结合起来，建立较全面的资产、个券投资价值评价体系，不断优化投资组合配置。本基金的投资策略分为两个层次：第一个层次是资产配置策略，即在权益类、固定收益证券和货币市场工具之间的配置比例；第二个层次是权益类证券和固定收益类证券等的投资。
业绩比较基准	基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日：75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日：45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日：25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 2021 年 1 月 1 日以及该日以后：10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于生命周期型基金，2020 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日止，本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近股票基金；随着目标日期的临近，本基金逐步发展为一只低风险债券型基金。

注：大成基金管理有限公司根据《大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金合同》的相关约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2011 年 1 月 1 日起，大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金使用的业绩比较基准由原“

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×新华富时中国 A600 指数+55%×中国债券总指数
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×新华富时中国 A600 指数+75%×中国债券总指数
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	10%×新华富时中国 A600 指数+90%×中国债券总指数

”变更为“

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数

”。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

### 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	-20,392,443.67
本期利润	-148,771,055.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0437
本期基金份额净值增长率	-5.72%
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	-0.2752
期末基金资产净值	2,413,751,007.00
期末基金份额净值	0.725

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。

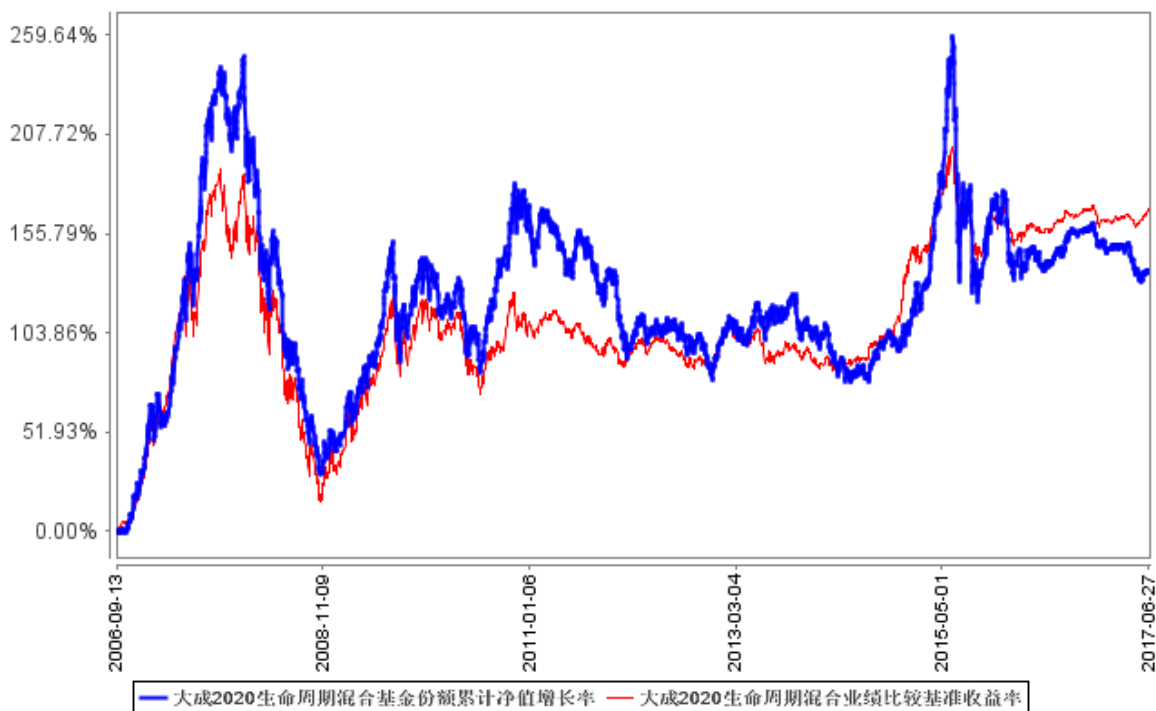
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	1.83%	0.43%	2.04%	0.19%	-0.21%	0.24%
过去三个月	-4.10%	0.50%	1.41%	0.19%	-5.51%	0.31%
过去六个月	-5.72%	0.41%	2.13%	0.18%	-7.85%	0.23%
过去一年	-2.82%	0.39%	3.40%	0.21%	-6.22%	0.18%
过去三年	26.97%	1.31%	40.61%	0.73%	-13.64%	0.58%
自基金合同生效起至今	136.45%	1.49%	168.20%	1.19%	-31.75%	0.30%

### 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. 自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。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. 按基金合同规定，本基金各个时间段的资产配置比例如下：

时间段	权益类证券比例范围	固定收益类证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	0—95%	5%—100%
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	0—75%	25%—100%
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	0—50%	50%—100%
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	0—20%	80%—100%

## §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	2014年6月26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

股票部分：

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。

债券部分：

2017 年上半年，经济稳定增长，央行积极引导金融去杠杆，引导利率中枢上行，债券市场仍处于低迷状态。由于部分可转债的公司为行业龙头，即属于市场中的那“上涨 50”，因此转债市场表现较为突出。在操作上，我们以持有高等级债券为主，对部分可转债进行了波段交易。

##### 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 0.725 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.72%，业绩比较基准收益率为 2.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票方面：

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为主，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，强势美元的预期增长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。

债券方面：

展望下半年，经济温和增长的动能仍在，资金仍有偏紧预期，10 年期国债利率居高难下，监管主基调仍是去杠杆，信用违约风险会有所暴露，因此尽管目前信用债的利率具备一定吸引力，但谈大机会仍然过早。可转债的投资机会也随着部分正股估值偏高而机会下降。因此，在操作上，

利率债仍以持有高等级债券为主，另外配置部分正股估值不高的可转债。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

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	12,549,963.17	355,607,756.98
结算备付金	6,178,418.99	6,363,986.83
存出保证金	549,268.16	435,442.43
交易性金融资产	2,217,949,417.44	2,416,077,446.15
其中：股票投资	1,029,972,432.86	1,052,743,487.17
基金投资	-	-
债券投资	1,187,976,984.58	1,363,333,958.98
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	151,958,645.99	143,500,320.25
应收证券清算款	17,090,829.48	-
应收利息	17,706,237.46	12,445,154.22
应收股利	-	-
应收申购款	9,148.79	4,204.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,423,991,929.48	2,934,434,311.06
<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	5,000,000.00	150,000,000.00
应付证券清算款	-	99,562,601.03
应付赎回款	1,073,030.93	596,126.80
应付管理人报酬	2,372,096.40	2,763,344.29
应付托管费	454,651.82	529,640.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	830,643.75	1,695,017.80
应交税费	34,923.20	34,923.20
应付利息	-	61,355.37

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	475,576.38	496,345.29
负债合计	10,240,922.48	255,739,354.77
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,330,274,338.51	3,485,081,953.18
未分配利润	-916,523,331.51	-806,386,996.89
所有者权益合计	2,413,751,007.00	2,678,694,956.29
负债和所有者权益总计	2,423,991,929.48	2,934,434,311.06

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.725 元，基金份额总额 3,330,274,338.51 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

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>	-124,430,495.88	-313,970,505.33
1.利息收入	22,211,214.57	19,619,744.04
其中：存款利息收入	998,143.70	1,832,027.59
债券利息收入	19,649,397.78	15,651,574.87
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,563,673.09	2,136,141.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-18,353,847.48	-273,677,267.02
其中：股票投资收益	-15,703,729.82	-265,854,624.62
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-10,174,959.41	-13,968,970.38
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	7,524,841.75	6,146,327.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-128,378,611.90	-59,978,087.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	90,748.93	65,105.31
<b>减：二、费用</b>	24,340,559.69	26,963,495.58
1. 管理人报酬	15,174,177.03	16,482,059.64
2. 托管费	2,908,383.91	3,159,061.39

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,482,050.17	7,046,754.36
5. 利息支出	2,501,416.54	-
其中：卖出回购金融资产支出	2,501,416.54	-
6. 其他费用	274,532.04	275,620.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-148,771,055.57</b>	<b>-340,934,000.91</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-148,771,055.57</b>	<b>-340,934,000.91</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

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）	3,485,081,953.18	-806,386,996.89	2,678,694,956.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-148,771,055.57	-148,771,055.57
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）	-154,807,614.67	38,634,720.95	-116,172,893.72
其中：1.基金申购款	6,435,409.48	-1,626,856.03	4,808,553.45
2.基金赎回款	-161,243,024.15	40,261,576.98	-120,981,447.17
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）	3,330,274,338.51	-916,523,331.51	2,413,751,007.00
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）	3,741,509,957.00	-609,921,627.53	3,131,588,329.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-340,934,000.91	-340,934,000.91
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）	-87,596,019.47	22,010,568.10	-65,585,451.37
其中：1.基金申购款	28,884,647.37	-7,516,621.78	21,368,025.59
2.基金赎回款	-116,480,666.84	29,527,189.88	-86,953,476.96
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）	3,653,913,937.53	-928,845,060.34	2,725,068,877.19

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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。



**6.4.4 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	175,013,064.03	7.51%	116,981,145.76	2.56%

**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	71,695,413.94	24.72%	-	0.00%

**6.4.4.1.3 债券回购交易**

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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
光大证券	247,000,000.00	5.60%	-	0.00%

**6.4.4.1.4 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。

**6.4.4.1.5 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	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	159,490.14	7.51%	70,334.99	8.85%
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	106,605.77	2.56%	56,259.30	2.56%

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	15,174,177.03	16,482,059.64
其中：支付销售机构的客户维护费	2,457,413.50	2,672,905.38

注：自基金合同生效日起至 2010 年 12 月 31 日止，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；自 2011 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止，管理费年费率变更为 1.4%；2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日止，管理费年费率变更为 1.2%。管理费逐日计提，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 X 管理费年费率 / 当年天数。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

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托管费	2,908,383.91	3,159,061.39

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.23% 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 X 0.23% / 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**

本报告期内及上年度可比期间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。

**6.4.4.4 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**

本报告期内本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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	12,549,963.17	939,528.42	166,770,476.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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**

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**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	2017年	2017	新股流	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-

	羽	6 月 15 日	年 7 月 17 日	通受限							
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40		-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26		-
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		-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37		-
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		-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76		-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.5.2 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	停牌日期	停牌原	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	-----	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

	称		因							
002596	海南瑞泽	2017年5月22日	临时停牌	8.29	-	-	10,279,475	93,600,763.21	85,216,847.75	-
600485	信威集团	2016年12月26日	临时停牌	14.59	-	-	3,172,393	56,110,443.12	46,285,213.87	-
002509	天广中茂	2017年6月12日	临时停牌	9.20	-	-	2,508,340	22,709,373.92	23,076,728.00	-

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。

#### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.5.3.1 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形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## §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	1,029,972,432.86	42.49
	其中：股票	1,029,972,432.86	42.49
2	固定收益投资	1,187,976,984.58	49.01
	其中：债券	1,187,976,984.58	49.01
	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	151,958,645.99	6.27
	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	18,728,382.16	0.77
7	其他各项资产	35,355,483.89	1.46
8	合计	2,423,991,929.48	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	279,777,104.74	11.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	471,678,035.89	19.54
E	建筑业	42,245,228.16	1.75
F	批发和零售业	26,093,736.69	1.08
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	189,017,872.36	7.83
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	4,763,585.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	16,389,230.40	0.68
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	1,029,972,432.86	42.67

## 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	600310	桂东电力	28,302,969	194,158,367.34	8.04
2	600969	郴电国际	11,383,192	161,641,326.40	6.70
3	600565	迪马股份	29,096,684	160,322,728.84	6.64
4	000685	中山公用	9,034,817	98,931,246.15	4.10
5	002596	海南瑞泽	10,279,475	85,216,847.75	3.53
6	600485	信威集团	3,172,393	46,285,213.87	1.92
7	000401	冀东水泥	3,000,000	46,170,000.00	1.91
8	002047	宝鹰股份	4,889,494	42,245,228.16	1.75
9	000709	河钢股份	8,000,000	33,520,000.00	1.39
10	600739	辽宁成大	1,337,423	24,113,736.69	1.00

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	600310	桂东电力	251,146,030.33	9.38
2	600565	迪马股份	188,240,166.98	7.03
3	002596	海南瑞泽	95,022,147.00	3.55
4	000685	中山公用	61,781,685.57	2.31
5	000401	冀东水泥	54,790,865.27	2.05
6	600969	郴电国际	44,280,301.48	1.65
7	300237	美晨科技	38,484,028.54	1.44

8	000709	河钢股份	34,100,000.00	1.27
9	002146	荣盛发展	24,881,410.00	0.93
10	002047	宝鹰股份	23,910,336.32	0.89
11	600739	辽宁成大	23,790,680.92	0.89
12	002509	天广中茂	22,709,373.92	0.85
13	000826	启迪桑德	22,094,686.56	0.82
14	002149	西部材料	20,052,381.88	0.75
15	002573	清新环境	19,009,228.72	0.71
16	600629	华建集团	18,997,348.52	0.71
17	000623	吉林敖东	17,807,087.40	0.66
18	600055	万东医疗	15,750,525.74	0.59
19	002037	久联发展	15,249,280.60	0.57
20	002482	广田集团	14,123,484.00	0.53

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	000826	启迪桑德	202,301,630.77	7.55
2	300237	美晨科技	108,921,489.95	4.07
3	601888	中国国旅	99,234,753.25	3.70
4	000601	韶能股份	65,973,317.27	2.46
5	600016	民生银行	52,259,938.59	1.95
6	002047	宝鹰股份	51,792,074.46	1.93
7	300197	铁汉生态	48,164,283.70	1.80
8	300447	全信股份	41,433,254.06	1.55
9	600565	迪马股份	31,902,312.03	1.19
10	002310	东方园林	22,182,129.27	0.83
11	600629	华建集团	19,496,985.84	0.73
12	000623	吉林敖东	18,490,821.38	0.69
13	600055	万东医疗	15,865,530.43	0.59
14	002011	盾安环境	15,213,699.51	0.57
15	002037	久联发展	15,009,783.21	0.56
16	002482	广田集团	13,634,540.43	0.51
17	002081	金螳螂	11,725,354.74	0.44



18	000423	东阿阿胶	11,713,872.00	0.44
19	000157	中联重科	9,772,645.30	0.36
20	000967	盈峰环境	9,471,991.84	0.35

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	1,229,299,263.43
卖出股票收入（成交）总额	1,101,557,457.78

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	91,637,371.60	3.80
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	223,781,499.00	9.27
	其中：政策性金融债	223,781,499.00	9.27
4	企业债券	200,404,500.00	8.30
5	企业短期融资券	350,861,000.00	14.54
6	中期票据	60,420,000.00	2.50
7	可转债（可交换债）	126,670,613.98	5.25
8	同业存单	134,202,000.00	5.56
9	其他	-	0.00
10	合计	1,187,976,984.58	49.22

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111799073	17 晋城银行 CD047	1,200,000	119,532,000.00	4.95
2	136826	16 国网 01	1,000,000	96,940,000.00	4.02
3	123001	蓝标转债	815,818	85,505,884.58	3.54
4	019546	16 国债 18	838,440	83,751,771.60	3.47
5	011697015	16 平安租赁 SCP001	500,000	50,220,000.00	2.08

#### 7.7 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。

**7.8 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**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**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	549,268.16
2	应收证券清算款	17,090,829.48
3	应收股利	-
4	应收利息	17,706,237.46
5	应收申购款	9,148.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	35,355,483.89
---	----	---------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110034	九州转债	40,888,305.00	1.69
2	123001	蓝标转债	85,505,884.58	3.54

#### 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002596	海南瑞泽	85,216,847.75	3.53	临时停牌
2	600485	信威集团	46,285,213.87	1.92	临时停牌

#### 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 (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
183,940	18,105.22	2,030,113.84	0.06%	3,328,244,224.67	99.94%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	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（2006年9月13日）基金份额总额	1,112,964,439.35
本报告期期初基金份额总额	3,485,081,953.18
本报告期基金总申购份额	6,435,409.48
减：本报告期基金总赎回份额	161,243,024.15
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	3,330,274,338.51

## §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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
招商证券	2	404,460,730.07	17.36%	368,596.18	17.36%	-
海通证券	2	392,377,633.85	16.84%	357,573.07	16.84%	-
万联证券	1	263,233,467.26	11.30%	239,883.61	11.30%	-
中信建投证券	1	253,780,763.00	10.89%	231,274.50	10.89%	-
华泰证券	2	228,975,513.26	9.83%	208,674.45	9.83%	-
光大证券	2	175,013,064.03	7.51%	159,490.14	7.51%	-
申银万国	1	155,881,603.20	6.69%	142,060.36	6.69%	-
广发证券	1	89,265,830.17	3.83%	81,344.67	3.83%	-
长江证券	1	78,752,226.73	3.38%	71,766.00	3.38%	-
湘财证券	1	60,716,373.53	2.61%	55,328.08	2.61%	-
国泰君安	1	54,234,905.61	2.33%	49,424.36	2.33%	-
中信证券	2	49,143,902.40	2.11%	44,785.37	2.11%	-
平安证券	1	45,146,429.40	1.94%	41,140.75	1.94%	-
安信证券	2	37,934,465.31	1.63%	34,569.89	1.63%	-
东方证券	1	26,014,858.84	1.12%	23,706.49	1.12%	-
华宝证券	1	14,503,969.80	0.62%	13,217.28	0.62%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	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：

本报告期内增加交易单元：无；

本报告期内退租交易单元：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------



	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
招商证券	43,916,155.47	15.14%	191,100,000.00	4.33%	-	0.00%
海通证券	135,552,469.31	46.73%	1,240,000,000.00	28.10%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	263,124,000.00	5.96%	-	0.00%
中信建投 证券	-	0.00%	193,300,000.00	4.38%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	391,000,000.00	8.86%	-	0.00%
光大证券	71,695,413.94	24.72%	247,000,000.00	5.60%	-	0.00%
申银万国	9,570,163.60	3.30%	659,000,000.00	14.93%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	117,000,000.00	2.65%	-	0.00%
长江证券	14,174,897.90	4.89%	259,000,000.00	5.87%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	50,000,000.00	1.13%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	220,000,000.00	4.99%	-	0.00%
平安证券	6,790,780.80	2.34%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	582,000,000.00	13.19%	-	0.00%
华宝证券	8,346,263.26	2.88%	-	0.00%	-	0.00%

### §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