大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告摘要

2017年12月31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：2018年3月31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2018年3月30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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2017年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成国家安全主题灵活配置混合
基金主代码	002567
交易代码	002567
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月4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	56,642,609.26份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是通过投资于与国家安全主题相关的优质上市公司，在控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	中证800指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	贺倩
	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年 5 月 4 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	16,176,543.53	-16,728,521.51
本期利润	18,151,445.72	-17,546,303.98
加权平均基金份额本期利润	0.1507	-0.0947
本期基金份额净值增长率	16.37%	-10.20%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0448	-0.1021
期末基金资产净值	59,182,208.91	137,319,931.33
期末基金份额净值	1.045	0.898

注：1、本期已实现收益指本期利息收入、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

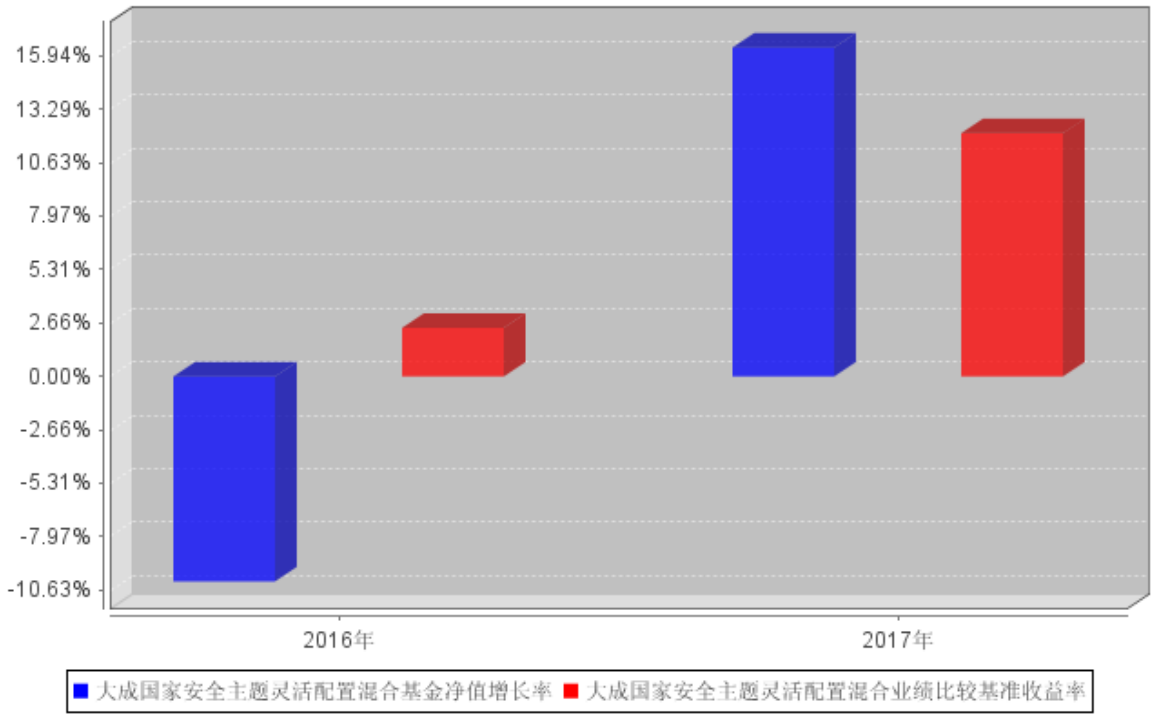
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.56%	0.99%	1.63%	0.61%	3.93%	0.38%
过去六个月	17.28%	1.13%	6.23%	0.55%	11.05%	0.58%
过去一年	16.37%	1.01%	12.10%	0.52%	4.27%	0.49%
自基金合同生效起至今	4.50%	0.99%	14.82%	0.61%	-10.32%	0.38%

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

注：1、按基金合同规定，基金管理人应当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。截至报告期末，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、截至报告期末，本基金投资的中国铝业（601600）因重大事项停牌，导致单个股票的投资比例被动超标。除此之外，报告期内本基金的其他各项投资比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2016 年 5 月 4 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金，5 只 QDII 基金及 76 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		
陈龙先生	本基金基金经理	2017 年 5 月 8 日	-	5 年	经济学硕士。2012 年 7 月至 2015 年 1 月任大成基金管理有限公司研究部助理研究员。2015 年 2 月至 2015 年 3 月任南方基金管理有限公司固定收益部研究员。2015 年 4 月至 2015 年 12 月任交银施罗德基金管理有限公司研究部高级研究员。2015 年 12 月加入大成基金管理有限公司，任股票投资部专职助理。2015 年 12 月 1 日至 2017 年 5 月 9 日担任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起担任大成国家安全主题灵活配置混合型证券

					投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
侯春燕女士	本基金基金经理	2017 年 1 月 18 日	-	7 年	经济学硕士，2010 年 6 月加入大成基金管理有限公司。历任研究员，基金经理助理。2015 年 12 月 9 日起担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 18 日起任大成消费主题混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日起担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
张君孺先生	本基金基金经理	2016 年 5 月 4 日	2017 年 1 月 18 日	7 年	经济学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司。历任研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月 24 日至 2015 年 7 月 2 日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 3 日至 2017 年 1 月 18 日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理，2016 年 5 月 4 日至 2017 年 1 月 18 日任大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。

4.3.3 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14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年宏观经济引来了开门红后，在制造业投资和出口增速的大力推动下，一季度GDP增速达到了6.9%，全年预计在6.8%左右，但市场对于宏观经济的悲观情绪已经逐步修复过来了。在货币政策方面，由于美联储加快加息步伐，国内货币政策为了应对海外的流动性对人民币汇率

的冲击，再叠加宏观经济的好转，央行从年初开始实施了中性偏紧的货币政策，二季度随着金融领域去杠杆的加强，货币政策在边际上进一步收紧，直到6月份央行才逐步宽松流动性，但随着经济的走强，全年仍然保持中性偏紧的基调不变。

在此宏观和流动性的背景下，本基金从年初开始就制定了在周期品领域的配置，包括建筑、建材、有色、银行等行业。另外一带一路也是本基金年初重仓配置的品种，但从4月中下旬开始，随着金融去杠杆逐步进行，市场风险偏好逐步下降，周期品及主题性的投资出现了明显的回落。二季度由于对消费白马股的切换时间较晚，导致基金净值有一定回撤。但随着三季度周期品的大幅上涨，本基金净值存在较大的超额收益。从9月中旬开始，也即8月份宏观经济数据公布后本基金进行了及时的调整仓位结构，降低周期品的配置比例，逐步加大对消费品和金融板块的配置比例。主要的仓位放在了如食品饮料、保险、银行等行业上面。

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1.045元；本报告期基金份额净值增长率为16.37%，业绩比较基准收益率为12.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先，对于2018年宏观经济的判断，我们比较乐观，预计全年GDP增速将会在7%左右，通胀水平仍然较为温和，PPI同比增速开始高位回落，但回落的幅度不会太大。宏观经济的主要动力来自出口、制造业投资及地产投资的超预期。在货币政策方面，央行加息预期将会逐步显现，流动性在边际上将会进一步收紧。

2017年中国经济进入了新时代，因此，市场风险偏好有所回升，但由于加息预期的不断加强，整体上A股市场仍然不存在趋势性行情，以结构性机会为主。鉴于以上的判断，我们认为核心资产仍然是2018年配置的主线，如银行、保险、白酒和家电。另外，由于宏观经济的逐步改善，我们认为部分周期品存在交易性机会，在适当的时候会加大对周期品的配置比例。在主题投资领域，我们全年都看好半导体、5G通信设备及创新药的投资机会。

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、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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三名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资

产配置部、风险管理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

注：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 12 月 31 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 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7,017,654.44	13,042,912.99
结算备付金	477,684.91	736,976.97
存出保证金	241,817.70	443,367.57
交易性金融资产	52,535,415.02	123,714,867.84
其中：股票投资	52,535,415.02	123,714,867.84
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	-	-
应收利息	1,787.09	3,696.66
应收股利	-	-
应收申购款	899.27	0.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	60,275,258.43	137,941,823.02
负债和所有者权益	**本期末 2017 年 12 月 31 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	118,274.03	-
应付赎回款	269,607.80	77,530.56
应付管理人报酬	78,091.77	178,061.20
应付托管费	13,015.31	29,676.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	353,555.95	276,427.73
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,504.66	60,195.34
负债合计	1,093,049.52	621,891.69
所有者权益：		
实收基金	56,642,609.26	152,940,101.96
未分配利润	2,539,599.65	-15,620,170.63
所有者权益合计	59,182,208.91	137,319,931.33
负债和所有者权益总计	60,275,258.43	137,941,823.02

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值为1.045元，基金份额总额

56,642,609.26份。

7.2 利润表

会计主体：大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期： 2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	24,145,774.02	-11,779,771.71
1.利息收入	249,612.01	398,970.45
其中：存款利息收入	166,506.03	347,629.81
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	83,105.98	51,340.64
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	21,736,429.73	-12,712,950.30
其中：股票投资收益	20,675,369.05	-13,030,673.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	1,061,060.68	317,723.01

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,974,902.19	-817,782.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	184,830.09	1,351,990.61
减：二、费用	5,994,328.30	5,766,532.27
1．管理人报酬	1,708,173.10	1,745,199.72
2．托管费	284,695.51	290,866.62
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	3,630,383.33	3,605,474.15
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	371,076.36	124,991.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	18,151,445.72	-17,546,303.98
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	18,151,445.72	-17,546,303.98

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31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）	152,940,101.96	-15,620,170.63	137,319,931.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,151,445.72	18,151,445.72
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）	-96,297,492.70	8,324.56	-96,289,168.14
其中：1.基金申购款	16,765,151.17	-280,285.73	16,484,865.44
2.基金赎回款	-113,062,643.87	288,610.29	-112,774,033.58
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）	56,642,609.26	2,539,599.65	59,182,208.91
项目	**上年度可比期间 2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31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）	367,042,410.54	-	367,042,410.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,546,303.98	-17,546,303.98
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）	-214,102,308.58	1,926,133.35	-212,176,175.23
其中：1.基金申购款	5,051,432.85	-198,294.27	4,853,138.58
2.基金赎回款	-219,153,741.43	2,124,427.62	-217,029,313.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	152,940,101.96	-15,620,170.63	137,319,931.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀	周立新	崔伟
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1.1 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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年11月27日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

除上述事项外，本报告期所采用的会计政策和其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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)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。

7.4.3 关联方关系

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(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
中泰信托有限责任公司	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：1. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有

关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。大成基金原股东广东证券股份有限公司自 2016 年 4 月 25 日起不再为本基金关联方。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31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	288,388,127.79	12.07%	394,038,727.05	16.09%

7.4.4.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.4.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31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	20,000,000.00	8.49%	580,000,000.00	65.91%

7.4.4.1.4 权证交易

注：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。

7.4.4.1.5 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12月31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	262,808.83	12.07%	75,722.34	21.42%
关联方名称	上年度可比期间 2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31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	359,085.94	16.09%	-	0.00%

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 4 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,708,173.10	1,745,199.72
其中：支付销售机构的客户维护费	819,237.45	837,066.55

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50% /当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 4 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	284,695.51	290,866.62

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25% /当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.4.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 5 月 4 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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	7,017,654.44	146,287.61	13,042,912.99	322,993.23

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

7.4.5 期末（ 2017 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 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
601600	中国铝业	2017 年 9 月 12 日	重大事项	6.67	2018 年 2 月 26 日	7.28	945,900	7,426,847.00	6,309,153.00	-

600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项	37.94	-	-	53,500	2,147,883.00	2,029,790.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§8 投资组合报告

8.1 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	52,535,415.02	87.16
	其中：股票	52,535,415.02	87.16
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	7,495,339.35	12.44
	-	-	0.00
8	其他各项资产	244,504.06	0.41
9	合计	60,275,258.43	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）

A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	1,914,016.00	3.23
C	制造业	40,392,474.94	68.25
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	-	0.00
J	金融业	8,438,204.08	14.26
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	1,790,720.00	3.03
S	综合	-	0.00
	合计	52,535,415.02	88.77

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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	601600	中国铝业	945,900	6,309,153.00	10.66
2	000858	五 粮 液	42,900	3,426,852.00	5.79
3	601336	新华保险	48,400	3,397,680.00	5.74
4	600196	复星医药	62,700	2,790,150.00	4.71
5	600872	中炬高新	107,800	2,669,128.00	4.51
6	600143	金发科技	403,500	2,650,995.00	4.48
7	002371	北方华创	62,300	2,581,712.00	4.36
8	000063	中兴通讯	65,500	2,381,580.00	4.02
9	600585	海螺水泥	80,600	2,363,998.00	3.99
10	601939	建设银行	268,281	2,060,398.08	3.48

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)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000063	中兴通讯	20,178,591.48	14.69
2	000932	*ST 华菱	20,053,468.00	14.60
3	600477	杭萧钢构	19,156,596.70	13.95
4	601318	中国平安	18,201,249.43	13.25
5	000933	神火股份	17,865,303.33	13.01
6	000651	格力电器	17,088,570.85	12.44
7	601600	中国铝业	16,215,961.32	11.81
8	000065	北方国际	14,962,322.69	10.90
9	603008	喜临门	14,775,088.82	10.76
10	601800	中国交建	13,382,544.52	9.75
11	002126	银轮股份	13,327,366.96	9.71
12	000858	五 粮 液	13,205,019.30	9.62
13	601601	中国太保	12,983,688.72	9.46
14	601939	建设银行	12,768,780.88	9.30
15	002536	西泵股份	11,920,605.77	8.68
16	601988	中国银行	11,530,963.00	8.40
17	601336	新华保险	11,290,221.97	8.22
18	601688	华泰证券	11,188,048.00	8.15
19	600985	雷鸣科化	10,794,259.34	7.86
20	000401	冀东水泥	10,768,764.00	7.84
21	600581	八一钢铁	10,683,201.00	7.78
22	600366	宁波韵升	10,574,698.00	7.70
23	600392	盛和资源	10,103,103.00	7.36
24	000709	河钢股份	10,056,935.00	7.32
25	600782	新钢股份	9,800,562.00	7.14
26	600176	中国巨石	9,798,678.60	7.14
27	300124	汇川技术	9,276,168.94	6.76

28	600282	南钢股份	9,241,215.00	6.73
29	000597	东北制药	9,147,624.14	6.66
30	000786	北新建材	9,147,585.90	6.66
31	600585	海螺水泥	9,003,399.00	6.56
32	600029	南方航空	8,668,180.00	6.31
33	002001	新 和 成	8,629,122.00	6.28
34	000001	平安银行	8,396,447.85	6.11
35	600110	诺德股份	8,364,087.22	6.09
36	300025	华星创业	8,322,663.22	6.06
37	002142	宁波银行	8,281,314.80	6.03
38	002573	清新环境	8,236,756.15	6.00
39	603816	顾家家居	8,227,881.00	5.99
40	600104	上汽集团	8,195,021.58	5.97
41	603040	新坐标	7,991,348.00	5.82
42	300070	碧水源	7,810,244.00	5.69
43	600958	东方证券	7,638,989.00	5.56
44	000528	柳　　工	7,596,794.78	5.53
45	300035	中科电气	7,281,052.00	5.30
46	600887	伊利股份	7,261,824.00	5.29
47	600549	厦门钨业	7,235,703.00	5.27
48	000903	云内动力	7,211,477.00	5.25
49	000418	小天鹅A	7,049,670.93	5.13
50	600141	兴发集团	7,017,255.51	5.11
51	300203	聚光科技	6,976,697.99	5.08
52	600068	葛洲坝	6,942,599.00	5.06
53	601699	潞安环能	6,876,669.24	5.01
54	600340	华夏幸福	6,850,335.85	4.99
55	300144	宋城演艺	6,847,251.23	4.99
56	002236	大华股份	6,719,387.00	4.89
57	300633	开立医疗	6,701,815.42	4.88
58	600801	华新水泥	6,629,201.00	4.83
59	600198	大唐电信	6,327,630.48	4.61
60	600196	复星医药	6,308,789.00	4.59
61	300078	思创医惠	6,302,608.00	4.59
62	002466	天齐锂业	6,287,380.00	4.58
63	603869	北部湾旅	6,126,524.72	4.46

64	002430	杭氧股份	6,069,250.43	4.42
65	002371	北方华创	6,058,120.00	4.41
66	600809	山西汾酒	6,021,371.18	4.38
67	300083	劲胜智能	5,835,242.48	4.25
68	300613	富瀚微	5,828,274.00	4.24
69	601186	中国铁建	5,602,481.00	4.08
70	600685	中船防务	5,534,525.00	4.03
71	300156	神雾环保	5,495,500.63	4.00
72	600011	华能国际	5,493,828.00	4.00
73	000338	潍柴动力	5,492,477.40	4.00
74	600547	山东黄金	5,477,660.22	3.99
75	600297	广汇汽车	5,383,140.50	3.92
76	601117	中国化学	5,311,704.00	3.87
77	600507	方大特钢	5,298,144.93	3.86
78	601009	南京银行	5,245,987.00	3.82
79	300395	菲利华	5,172,001.75	3.77
80	603556	海兴电力	5,015,102.67	3.65
81	603799	华友钴业	4,979,007.00	3.63
82	603993	洛阳钼业	4,936,733.00	3.60
83	002431	棕榈股份	4,864,622.00	3.54
84	600075	新疆天业	4,803,550.76	3.50
85	002240	威华股份	4,764,626.00	3.47
86	300142	沃森生物	4,757,548.00	3.46
87	300033	同花顺	4,728,673.00	3.44
88	002812	创新股份	4,638,996.00	3.38
89	002439	启明星辰	4,377,514.56	3.19
90	600383	金地集团	4,360,325.00	3.18
91	600584	长电科技	4,341,051.96	3.16
92	002285	世联行	4,210,433.95	3.07
93	300471	厚普股份	4,203,629.88	3.06
94	000568	泸州老窖	4,195,863.18	3.06
95	300383	光环新网	4,166,660.56	3.03
96	603444	吉比特	4,161,656.00	3.03
97	600373	中文传媒	4,145,029.00	3.02
98	002244	滨江集团	4,113,010.00	3.00
99	601398	工商银行	4,112,460.00	2.99

100	002555	三七互娱	4,111,958.37	2.99
101	000717	韶钢松山	4,095,033.00	2.98
102	002281	光迅科技	4,070,438.08	2.96
103	002567	唐人神	4,067,301.36	2.96
104	000920	南方汇通	4,066,746.00	2.96
105	600162	香江控股	4,060,565.00	2.96
106	300137	先河环保	4,051,529.00	2.95
107	000609	绵石投资	4,045,223.00	2.95
108	002410	广联达	3,975,060.00	2.89
109	000807	云铝股份	3,935,405.60	2.87
110	000671	阳 光 城	3,927,460.05	2.86
111	000910	大亚圣象	3,830,677.82	2.79
112	601766	中国中车	3,828,421.00	2.79
113	600567	山鹰纸业	3,737,020.00	2.72
114	000789	万年青	3,725,292.00	2.71
115	601636	旗滨集团	3,692,737.98	2.69
116	600690	青岛海尔	3,691,890.00	2.69
117	002456	欧菲科技	3,634,564.00	2.65
118	000967	盈峰环境	3,624,765.90	2.64
119	601111	中国国航	3,588,828.00	2.61
120	000002	万　科Ａ	3,572,649.03	2.60
121	600348	阳泉煤业	3,568,449.00	2.60
122	000049	德赛电池	3,496,828.00	2.55
123	300228	富瑞特装	3,476,862.60	2.53
124	002405	四维图新	3,225,758.32	2.35
125	600310	桂东电力	3,212,491.00	2.34
126	600019	宝钢股份	3,169,144.00	2.31
127	300224	正海磁材	3,149,807.50	2.29
128	300479	神思电子	3,146,151.00	2.29
129	600111	北方稀土	2,992,339.00	2.18
130	000937	冀中能源	2,962,955.00	2.16
131	600562	国睿科技	2,915,494.47	2.12
132	603160	汇顶科技	2,853,852.00	2.08
133	601992	金隅股份	2,821,523.00	2.05
134	600879	航天电子	2,811,659.00	2.05
135	600409	三友化工	2,807,010.00	2.04

136	600582	天地科技	2,797,456.00	2.04
137	600079	人福医药	2,793,318.00	2.03
138	600858	银座股份	2,792,091.00	2.03
139	002259	升达林业	2,791,232.00	2.03
140	600031	三一重工	2,788,781.60	2.03
141	600160	巨化股份	2,777,991.60	2.02
142	300502	新易盛	2,768,225.40	2.02
143	300113	顺网科技	2,767,662.00	2.02
144	300394	天孚通信	2,761,790.80	2.01
145	000877	天山股份	2,753,333.00	2.01

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

8.4.2 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	000932	*ST 华菱	21,241,678.00	15.47
2	000063	中兴通讯	20,714,981.22	15.09
3	600477	杭萧钢构	19,743,947.75	14.38
4	601318	中国平安	19,483,198.61	14.19
5	000933	神火股份	19,411,090.20	14.14
6	000651	格力电器	17,175,467.70	12.51
7	600029	南方航空	16,604,677.36	12.09
8	603008	喜临门	16,317,264.76	11.88
9	002281	光迅科技	14,992,674.20	10.92
10	601800	中国交建	13,605,631.80	9.91
11	000065	北方国际	13,514,220.83	9.84
12	002536	西泵股份	13,502,917.92	9.83
13	601601	中国太保	13,409,151.94	9.76
14	002126	银轮股份	13,278,094.57	9.67
15	600581	八一钢铁	12,692,487.07	9.24
16	600115	东方航空	12,609,712.36	9.18
17	601688	华泰证券	11,517,782.11	8.39
18	601988	中国银行	11,421,596.00	8.32
19	000786	北新建材	11,406,123.85	8.31
20	600392	盛和资源	11,363,209.46	8.27
21	601939	建设银行	10,957,435.36	7.98
22	600366	宁波韵升	10,725,928.15	7.81

23	000858	五 粮 液	10,675,821.97	7.77
24	000401	冀东水泥	10,498,654.00	7.65
25	300461	田中精机	10,429,453.36	7.60
26	600782	新钢股份	10,257,275.00	7.47
27	600399	抚顺特钢	10,162,599.00	7.40
28	600176	中国巨石	10,119,781.97	7.37
29	300124	汇川技术	9,613,090.99	7.00
30	000709	河钢股份	9,056,929.00	6.60
31	600985	雷鸣科化	8,857,646.98	6.45
32	600282	南钢股份	8,823,830.00	6.43
33	601600	中国铝业	8,818,965.00	6.42
34	002001	新 和 成	8,654,279.00	6.30
35	600110	诺德股份	8,637,951.00	6.29
36	600685	中船防务	8,512,479.00	6.20
37	002142	宁波银行	8,407,932.54	6.12
38	600340	华夏幸福	8,388,898.00	6.11
39	600104	上汽集团	8,388,738.18	6.11
40	601336	新华保险	8,272,175.02	6.02
41	603816	顾家家居	8,013,241.02	5.84
42	000528	柳　　工	7,867,482.89	5.73
43	000597	东北制药	7,858,946.02	5.72
44	300070	碧水源	7,707,664.91	5.61
45	002573	清新环境	7,543,917.00	5.49
46	000418	小天鹅A	7,512,657.18	5.47
47	300633	开立医疗	7,489,908.77	5.45
48	600958	东方证券	7,436,235.00	5.42
49	000807	云铝股份	7,435,097.04	5.41
50	600549	厦门钨业	7,419,092.97	5.40
51	300035	中科电气	7,339,124.54	5.34
52	002466	天齐锂业	7,279,164.07	5.30
53	603040	新坐标	7,220,734.12	5.26
54	002236	大华股份	7,186,383.72	5.23
55	000903	云内动力	7,153,652.00	5.21
56	600887	伊利股份	7,117,839.00	5.18
57	600809	山西汾酒	7,117,187.00	5.18
58	600801	华新水泥	7,103,500.37	5.17
59	300078	思创医惠	7,010,976.60	5.11
60	600068	葛洲坝	6,998,372.38	5.10

61	300025	华星创业	6,950,888.89	5.06
62	600141	兴发集团	6,928,736.00	5.05
63	600362	江西铜业	6,809,297.07	4.96
64	300144	宋城演艺	6,773,836.66	4.93
65	600585	海螺水泥	6,660,338.00	4.85
66	000001	平安银行	6,633,558.57	4.83
67	300203	聚光科技	6,629,438.34	4.83
68	601699	潞安环能	6,528,670.00	4.75
69	600198	大唐电信	6,470,920.35	4.71
70	002745	木林森	6,172,588.00	4.50
71	600856	中天能源	5,992,456.48	4.36
72	600507	方大特钢	5,681,713.00	4.14
73	300613	富瀚微	5,666,817.00	4.13
74	300083	劲胜智能	5,649,858.62	4.11
75	600011	华能国际	5,644,857.00	4.11
76	300156	神雾环保	5,535,668.41	4.03
77	002738	中矿资源	5,528,987.37	4.03
78	603869	北部湾旅	5,514,664.80	4.02
79	601186	中国铁建	5,484,257.05	3.99
80	601009	南京银行	5,478,584.00	3.99
81	002430	杭氧股份	5,467,592.06	3.98
82	000338	潍柴动力	5,398,291.63	3.93
83	300142	沃森生物	5,256,080.00	3.83
84	600075	新疆天业	5,229,815.53	3.81
85	600547	山东黄金	5,221,864.14	3.80
86	300339	润和软件	5,211,546.50	3.80
87	600297	广汇汽车	5,131,519.00	3.74
88	002431	棕榈股份	5,017,906.00	3.65
89	603556	海兴电力	4,895,076.10	3.56
90	300031	宝通科技	4,889,261.22	3.56
91	000717	韶钢松山	4,856,161.00	3.54
92	002240	威华股份	4,821,378.00	3.51
93	002439	启明星辰	4,717,533.00	3.44
94	002812	创新股份	4,713,318.00	3.43
95	300395	菲利华	4,705,621.00	3.43
96	603799	华友钴业	4,610,585.00	3.36
97	300137	先河环保	4,590,066.00	3.34
98	300033	同花顺	4,557,425.00	3.32

99	600072	中船科技	4,467,786.22	3.25
100	002567	唐人神	4,431,026.69	3.23
101	601117	中国化学	4,290,499.00	3.12
102	002285	世联行	4,276,825.00	3.11
103	000609	绵石投资	4,223,243.00	3.08
104	603444	吉比特	4,196,356.00	3.06
105	300471	厚普股份	4,169,048.03	3.04
106	600383	金地集团	4,123,929.28	3.00
107	000568	泸州老窖	4,122,773.50	3.00
108	002371	北方华创	4,122,489.00	3.00
109	002434	万里扬	4,115,724.00	3.00
110	601398	工商银行	4,085,047.00	2.97
111	600373	中文传媒	4,038,171.00	2.94
112	002244	滨江集团	4,031,861.20	2.94
113	002134	*ST普林	4,001,499.75	2.91
114	600584	长电科技	3,987,832.00	2.90
115	600415	小商品城	3,933,497.60	2.86
116	300383	光环新网	3,928,680.16	2.86
117	000671	阳 光 城	3,904,170.30	2.84
118	000882	华联股份	3,883,188.20	2.83
119	600690	青岛海尔	3,858,669.00	2.81
120	002555	三七互娱	3,814,420.00	2.78
121	000920	南方汇通	3,812,993.00	2.78
122	600567	山鹰纸业	3,787,141.00	2.76
123	002410	广联达	3,775,379.58	2.75
124	000967	盈峰环境	3,755,613.50	2.73
125	000789	万年青	3,739,089.26	2.72
126	002456	欧菲科技	3,652,503.00	2.66
127	300228	富瑞特装	3,572,761.40	2.60
128	600348	阳泉煤业	3,570,084.00	2.60
129	000002	万　科A	3,541,467.71	2.58
130	600196	复星医药	3,484,555.00	2.54
131	600162	香江控股	3,436,734.00	2.50
132	601636	旗滨集团	3,422,163.35	2.49
133	601111	中国国航	3,411,193.37	2.48
134	000049	德赛电池	3,404,404.00	2.48
135	002405	四维图新	3,275,896.00	2.39
136	600160	巨化股份	3,133,397.76	2.28

137	300479	神思电子	3,118,683.61	2.27
138	603160	汇顶科技	3,107,438.00	2.26
139	000937	冀中能源	3,105,821.00	2.26
140	002051	中工国际	3,046,458.25	2.22
141	600111	北方稀土	3,032,946.00	2.21
142	600019	宝钢股份	3,021,054.00	2.20
143	300224	正海磁材	2,979,601.06	2.17
144	300502	新易盛	2,947,014.64	2.15
145	600562	国睿科技	2,924,512.96	2.13
146	000039	中集集团	2,890,159.40	2.10
147	002457	青龙管业	2,888,010.12	2.10
148	603993	洛阳钼业	2,880,857.00	2.10
149	600879	航天电子	2,878,156.00	2.10
150	000523	广州浪奇	2,869,777.20	2.09
151	601899	紫金矿业	2,865,439.30	2.09
152	600031	三一重工	2,802,542.00	2.04
153	600582	天地科技	2,791,512.72	2.03
154	002790	瑞尔特	2,776,505.00	2.02
155	601611	中国核建	2,774,380.00	2.02
156	300394	天孚通信	2,773,762.00	2.02
157	600995	文山电力	2,755,757.00	2.01

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	1,148,063,464.86
卖出股票收入（成交）总额	1,241,893,188.92

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 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

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

8.8 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

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

8.9 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

注：本基金本报告期末无权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 **报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

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

8.12.3 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	241,817.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,787.09
5	应收申购款	899.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	244,504.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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	601600	中国铝业	6,309,153.00	10.66	临时停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
3,499	16,188.23	-	0.00%	56,642,609.26	100.00%

注：1、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 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	4.95	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016年5月4日 ）基金份额总额	367,042,410.54
本报告期期初基金份额总额	152,940,101.96
本报告期基金总申购份额	16,765,151.17
减:本报告期基金总赎回份额	113,062,643.87
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	56,642,609.26

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

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。

3、基金管理人于 2017 年 8 月 12 日发布了《大成基金管理有限公司督察长任职公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十七次会议审议通过，赵冰女士自 2017 年 8 月 11 日担任公司督察长，总经理罗登攀不再代为履行督察长职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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），本会计期间应支付的审计费用为 60,000.00 元。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内公司收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改行政监管措施的决定》，责令公司在三个月内对货币基金单一持有人持有比例过高的情况进行整改，并对相关责任人采取行政监管措施。截止目前，公司已经制定并落实相关整改措施，并向深圳证监局提交整改报告。

2、报告期内本基金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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
天风证券	2	459,769,122.50	19.25%	418,991.90	19.25%	-
中信建投	2	350,590,175.56	14.68%	319,500.84	14.68%	-
光大证券	2	288,388,127.79	12.07%	262,808.83	12.07%	-
东兴证券	1	223,061,746.62	9.34%	203,283.67	9.34%	-
银河证券	4	194,383,370.41	8.14%	177,136.29	8.14%	-
华西证券	1	121,900,308.89	5.10%	111,090.25	5.10%	-
齐鲁证券	1	119,092,340.96	4.99%	108,529.22	4.99%	-
国金证券	2	110,441,253.46	4.62%	100,645.77	4.62%	-
申银万国	1	81,551,275.88	3.41%	74,322.68	3.41%	-
西部证券	1	78,529,945.94	3.29%	71,562.43	3.29%	-
中金公司	2	76,196,725.80	3.19%	69,436.66	3.19%	-

联讯证券	1	72,378,395.69	3.03%	65,959.72	3.03%	-
兴业证券	2	54,841,540.31	2.30%	49,976.15	2.30%	-
华创证券	1	34,740,061.84	1.45%	31,660.36	1.45%	-
万和证券	1	22,219,473.96	0.93%	20,252.60	0.93%	-
东吴证券	1	19,812,224.80	0.83%	18,054.84	0.83%	-
中原证券	1	18,256,680.21	0.76%	16,637.85	0.76%	-
东北证券	2	18,231,990.68	0.76%	16,613.64	0.76%	-
爱建证券	1	17,575,824.47	0.74%	16,014.99	0.74%	-
东方证券	1	12,693,546.00	0.53%	11,566.30	0.53%	-
西藏东财	1	10,233,849.33	0.43%	9,325.84	0.43%	-
浙商证券	1	3,539,045.36	0.15%	3,225.34	0.15%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	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%	-
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%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	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%	-

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、南京证券。

11.7.2 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
光大证券	-	0.00%	20,000,000.00	8.49%	-	0.00%

中金公司	-	0.00%	195,500,000.00	83.01%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	20,000,000.00	8.49%	-	0.00%

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

注：无

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

大成基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日