

大成健康产业混合型证券投资基金
2016 年年度报告摘要
2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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。

大成健康产业股票型证券投资基金基金合同已于 2014 年 1 月 24 日生效。自基金合同生效以来，本基金运作平稳。根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成健康产业混合”；基金类别变更为“混合型”。基金代码保持不变，仍为 090020。上述事项已报中国证监会备案。因上述变更基金名称及基金类别事宜，基金管理人对《基金合同》和《托管协议》的相关条款进行了相应修改。在修改过程中，基金管理人根据《运作办法》和基金运作实际情况，对《基金合同》的部分条款进行了必要的调整。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。

按照基金合同约定，本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形，不需要召开基金份额持有人大会。本基金更名后，《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》、《大成健康产业股票型证券投资基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成健康产业混合型证券投资基金承担和继承。

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 3 月 23 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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 2016 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 | 大成健康产业混合 |
| 基金主代码 | 090020 |
| 交易代码 | 090020 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 1 月 24 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 | 35,048,729.88 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实施行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。 为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所以套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。 |
| 业绩比较基准 | 申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。 |

注：根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康

产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

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 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§ 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 | 2016 年 | 2015 年 | 2014 年 |
|---------------|----------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益 | -5,329,241.32 | 769,391.42 | -2,500,612.84 |
| 本期利润 | -12,203,163.93 | 7,832,978.02 | -2,787,457.95 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3127 | 0.2051 | -0.0493 |
| 本期基金份额净值增长率 | -27.09% | 26.81% | -5.31% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0929 | 0.1608 | -0.0191 |
| 期末基金资产净值 | 31,793,957.24 | 46,762,223.82 | 35,373,079.73 |
| 期末基金份额净值 | 0.907 | 1.244 | 0.981 |

注：1. 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。

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. 本基金自 2014 年 1 月 24 日起由大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转为大成健康产业股票型证券投资基金，所涉及的相关累计数据计算起始日从本次年报开始由原大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金成立日变更为大成健康产业股票型证券投资基金合同生效日。

3.2 基金净值表现

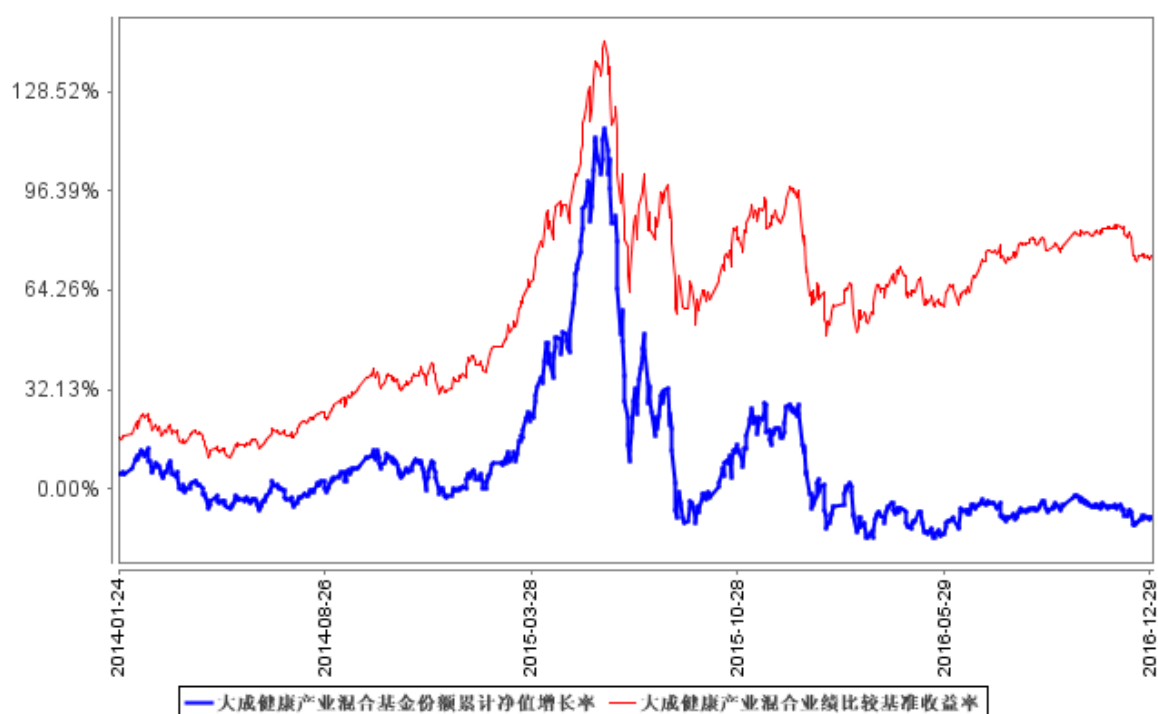
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -4.73% | 0.91% | -2.07% | 0.65% | -2.66% | 0.26% |
| 过去六个月 | -2.99% | 0.94% | 3.65% | 0.68% | -6.64% | 0.26% |
| 过去一年 | -27.09% | 1.89% | -10.00% | 1.39% | -17.09% | 0.50% |
| 自基金合同生效起至今 | -12.45% | 2.25% | 51.76% | 1.58% | -64.21% | 0.67% |

注：1. 根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

2. 本基金自 2014 年 1 月 24 日起由大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转为大成健康产业股票型证券投资基金，所涉及的相关数据计算起始日从本次年报开始由原大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金成立日变更为大成健康产业股票型证券投资基金合同生效日。

3.2.2 自基金转型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

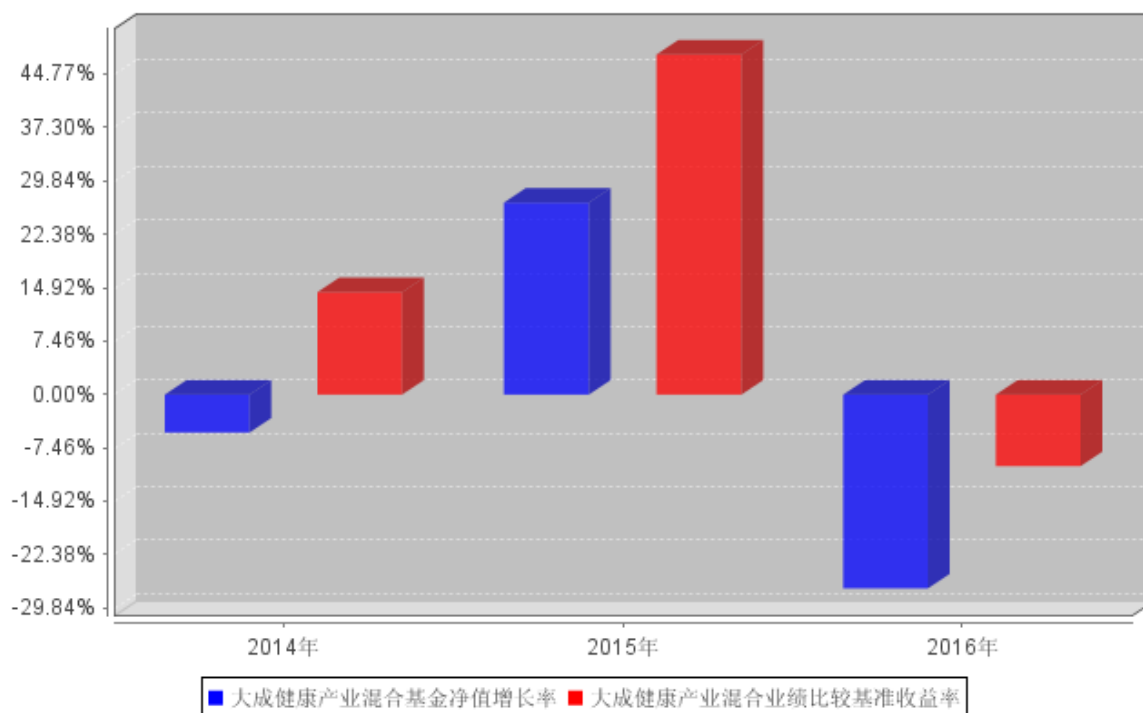


注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日(基金合同生效日)起六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。

3、根据《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

3.2.3 自基金转型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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2014 年 1 月 24 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2016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，4只QDII基金及68只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|------|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨挺先生 | 本基金基金经理 | 2014年6月26日 | - | 9年 | 工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员；2012年8月起任职于大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员。2014年3月18日起任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014年6月26日至2015年7月21日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理。2015年7月8日任大成正向回报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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成健康产业混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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 9 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 2 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

2016 年的 A 股市场年初遭遇市场熔断后快速下挫，创出年内最低点，之后指数缓慢上行。最终，上证综指下跌 12.31%、深证成指下跌 19.64%、中小板指下跌 22.89%、创业板指下跌 27.71%。按照申万一级行业分类，唯一涨跌幅较为正的的行业是食品饮料（5.72%）；其他行业跌幅靠前的分别是传媒（-31.32%）、计算机（-30.04%）、交通运输（-21.83%）、休闲服务（-21.37%）、公用事业（-17.92%）、房地产（-17.56%），以创业板为代表的新兴产业板块遭遇了深幅调整。

年初伴随市场熔断而来的巨幅调整是出乎我们意料的，而年初我们较高的仓位也使得一月结束时我们已经遭受了较大的损失。当时我们判断点位已经处于低位，并且市场风险大幅释放，因此在之后全年我们持续维持了较高的仓位，以试图挽回一月份承受的损失。可惜的是基于组合特色，我们在品种选择上选择了较为稳健的医疗、消费和部分成长类公司，但是回顾来看，2016 年市场触底后反弹的先锋是以黄金为代表的有色股以及长期触底的钢铁、煤炭类周期股，之后的家电和白酒蓝筹也有不错表现，但在我们组合中配置较少。因此我们虽然在 2016 年的剩余时间中组合净值有所回升，但是依然离挽回一季度的损失有较大差距。

目前组合调整和配置思路如下：年初经历熔断和股灾的心理阴影虽然还未完全消除，但是在反复的市场震荡中已经有所减轻，加上市场点位相对较低，因此连续暴跌的风险不大。从宏观经济来看，经济有企稳迹象，部分微观数据反映出部分复苏的迹象，因此我们判断市场可能处于酝酿上涨的底部区域。因此在本季度我们略微加大了仓位弹性，并以 2017 年的长期布局着眼开始配置组合，主要聚焦在业绩确定回暖和未来景气持续高涨的行业。

在这样的思路下，我们组合继续以医疗和消费为主要配置，减持了三季度配置的电子类股票，加大了部分有涨价和高景气预期的化工类公司，并继续加大了医疗类股票的比重，最后，自下而上选择了个别个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 0.907 元。本报告期内基金份额净值增长率为-27.09%，同期业绩比较基准收益率-10.00%，低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年的展望依然是迷雾重重，整体来说我们处于股灾后的修正期和宏观经济下一轮周期的启动期，我们将主要从盈利能力、市场流动性和风险偏好三个方面来阐述。

盈利判断：从地产周期、库存周期、时间周期、PPI 周期四个方面来验证 2017 年 A 股将再度进入下行周期。（1）地产周期：A 股的构成大部分是传统周期性行业，而这些传统行业很多都在地产产业链上，我们预计地产产业链景气将在 2017 年进一步回落。因此，我们预测 2017 年 A 股盈利下行。（2）库存周期：从历史上来看，产成品库存上行周期一般是 1 到 2 年，在产成品库存上升的后期，企业盈利会提前开始见顶回落。16 年产成品库存是上行周期，因此，我们预计 17 年产成品周期见顶而企业盈利将会下行。（3）时间周期：A 股的盈利周期一般是三年，其中一年盈利回升周期，两年盈利回落周期，而 2016 年的盈利向上回升一年，因此我们预计 2017 年将是盈利回落期。（4）PPI 周期：随着国内工业品持续涨价，PPI 将会进一步回升，使得 A 股的毛利率和盈利增速趋于下降。

流动性判断：2017 年利率水平有望先升后降，流动性先紧后升。因短期内基础货币和货币乘数的扩张受限（基础货币：外汇占款一直以来是基础货币的主要投放方式人民币汇率不断下跌，外汇占款持续下降，基础货币承压；货币乘数：预计 17 年地产市场的调控将使房贷减速，以及或将 MPA 考核纳入表外理财，对广义信贷的约束加强，都会对货币乘数产生负面影响），在 2017 年上半年物价和房价压力依然很大以及中美利差在不断缩小，为控制资本外流，货币政策难以宽松。但下半年随着经济增长和价格水平的回落，货币宽松空间有望打开。

风险偏好判断：2017 年风险偏好有望先降后升。“调结构”和“稳增长”的矛盾已经显现，“调结构”和“稳增长”都需要获得财政的支持，资源匹配难度加大。若“去产能”和“去杠杆”，则可能带来宏观数据下行，加大了“稳增长”的难度。因此，17 年上半年预计风险偏好仍处于较低的水平。但 17 年下半年“十九大”的改革预期或将能够提升风险偏好。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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”）在对大成健康产业混合型证券

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合规守信、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 审计报告

本基金 2016 年年度财务报告已经安永华明会计师事务所（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：大成健康产业混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 5,000,770.43 | 2,891,279.65 |
| 结算备付金 | 157,727.69 | 568,077.57 |
| 存出保证金 | 16,594.76 | 69,376.57 |
| 交易性金融资产 | 26,052,345.30 | 42,227,368.00 |
| 其中：股票投资 | 26,052,345.30 | 42,227,368.00 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 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 | 934,764.44 | 1,442,476.32 |
| 应收利息 | 1,057.07 | 1,026.77 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 947.61 | 19,309.69 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 32,164,207.30 | 47,218,914.57 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2016年12月31日 | 2015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 | 157,280.93 | - |
| 应付赎回款 | 5,925.49 | 63,089.68 |
| 应付管理人报酬 | 39,814.20 | 62,059.30 |
| 应付托管费 | 6,635.68 | 10,343.22 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 80,571.59 | 240,960.79 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 80,022.17 | 80,237.76 |
| 负债合计 | 370,250.06 | 456,690.75 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 35,048,729.88 | 37,604,250.04 |
| 未分配利润 | -3,254,772.64 | 9,157,973.78 |
| 所有者权益合计 | 31,793,957.24 | 46,762,223.82 |
| 负债和所有者权益总计 | 32,164,207.30 | 47,218,914.57 |

注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健

康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效已满一年。

2、 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.907 元，基金份额总额 35,048,729.88 份。

7.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| 一、收入 | -10,551,275.32 | 10,422,541.20 |
| 1. 利息收入 | 36,661.78 | 53,938.59 |
| 其中：存款利息收入 | 36,661.78 | 53,938.59 |
| 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 | - | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -3,744,712.84 | 3,066,373.81 |
| 其中：股票投资收益 | -3,887,579.38 | 2,933,086.92 |
| 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 | 142,866.54 | 133,286.89 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -6,873,922.61 | 7,063,586.60 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 30,698.35 | 238,642.20 |
| 减：二、费用 | 1,651,888.61 | 2,589,563.18 |
| 1. 管理人报酬 | 545,968.60 | 731,912.96 |
| 2. 托管费 | 90,994.70 | 121,985.53 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 823,252.09 | 1,527,838.46 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 191,673.22 | 207,826.23 |

| | | |
|---------------------|----------------|--------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -12,203,163.93 | 7,832,978.02 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -12,203,163.93 | 7,832,978.02 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 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） | 37,604,250.04 | 9,157,973.78 | 46,762,223.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -12,203,163.93 | -12,203,163.93 |
| 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） | -2,555,520.16 | -209,582.49 | -2,765,102.65 |
| 其中：1. 基金申购款 | 26,795,412.27 | -2,204,341.80 | 24,591,070.47 |
| 2. 基金赎回款 | -29,350,932.43 | 1,994,759.31 | -27,356,173.12 |
| 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） | 35,048,729.88 | -3,254,772.64 | 31,793,957.24 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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） | 36,061,686.85 | -688,607.12 | 35,373,079.73 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利 | - | 7,832,978.02 | 7,832,978.02 |

| | | | |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| 润) | | | |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | 1,542,563.19 | 2,013,602.88 | 3,556,166.07 |
| 其中：1. 基金申购款 | 146,106,349.71 | 56,295,676.46 | 202,402,026.17 |
| 2. 基金赎回款 | -144,563,786.52 | -54,282,073.58 | -198,845,860.10 |
| 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) | 37,604,250.04 | 9,157,973.78 | 46,762,223.82 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

 罗登攀 周立新 周立新
 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.2 税项

7.4.2.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1%，由出让方缴纳；

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、

债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 |
| 广东证券股份有限公司（“广东证券”） | 基金管理人的股东（2016 年 4 月 25 日前） |
| 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董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券将所持大成基金 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。

(2)以下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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 | 50,646,493.89 | 9.26% | 43,788,833.21 | 4.31% |

7.4.4.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.4.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 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 | 46,156.56 | 9.26% | 143.34 | 0.18% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 | 39,906.80 | 4.35% | 39,906.80 | 16.56% |

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后的净额列示。

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

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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年 12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月 31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 545,968.60 | 731,912.96 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 181,091.33 | 240,509.44 |

注：(1) 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2016 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 39,814.20 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 62,059.30 元）。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年 12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月 31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 90,994.70 | 121,985.53 |

注：(1) 基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2016 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 6,635.68 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 10,343.22 元）。

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

本基金本报告期末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

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 5,024,120.60 | 5,024,120.60 |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 5,024,120.60 | 5,024,120.60 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 14.33% | 13.36% |

注：基金管理人申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 | | 上年度可比期间 | |
|------------|----------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 |
| 中国银行股份有限公司 | 5,000,770.43 | 32,011.40 | 2,891,279.65 | 46,578.62 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 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其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2016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**

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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**

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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 | 26,052,345.30 | 81.00 |
| | 其中：股票 | 26,052,345.30 | 81.00 |
| 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 | 5,158,498.12 | 16.04 |
| 7 | 其他各项资产 | 953,363.88 | 2.96 |
| 8 | 合计 | 32,164,207.30 | 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 | - | 0.00 |
| C | 制造业 | 20,054,855.37 | 63.08 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 817,674.00 | 2.57 |
| E | 建筑业 | 872,340.00 | 2.74 |
| F | 批发和零售业 | 4,306,557.53 | 13.55 |
| 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 | - | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 918.40 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | 0.00 |
| P | 教育 | - | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | 0.00 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 26,052,345.30 | 81.94 |

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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 | 000513 | 丽珠集团 | 32,600 | 1,939,700.00 | 6.10 |
| 2 | 603108 | 润达医疗 | 57,500 | 1,757,200.00 | 5.53 |
| 3 | 002007 | 华兰生物 | 45,200 | 1,615,900.00 | 5.08 |
| 4 | 600998 | 九州通 | 74,700 | 1,549,278.00 | 4.87 |
| 5 | 300447 | 全信股份 | 27,900 | 1,547,892.00 | 4.87 |
| 6 | 600056 | 中国医药 | 78,600 | 1,495,758.00 | 4.70 |
| 7 | 300180 | 华峰超纤 | 56,300 | 1,379,350.00 | 4.34 |
| 8 | 000661 | 长春高新 | 12,100 | 1,353,385.00 | 4.26 |
| 9 | 002422 | 科伦药业 | 79,900 | 1,287,988.00 | 4.05 |
| 10 | 600110 | 诺德股份 | 118,585 | 1,264,116.10 | 3.98 |

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 | 002422 | 科伦药业 | 5,191,661.49 | 11.10 |
| 2 | 002007 | 华兰生物 | 4,762,672.80 | 10.18 |
| 3 | 002235 | 安妮股份 | 4,092,037.00 | 8.75 |
| 4 | 600056 | 中国医药 | 4,055,972.28 | 8.67 |
| 5 | 002117 | 东港股份 | 3,712,496.78 | 7.94 |
| 6 | 002294 | 信立泰 | 3,704,531.99 | 7.92 |
| 7 | 600136 | 当代明诚 | 3,544,350.01 | 7.58 |
| 8 | 002234 | 民和股份 | 3,412,461.15 | 7.30 |
| 9 | 603818 | 曲美家居 | 3,294,636.00 | 7.05 |
| 10 | 002050 | 三花智控 | 3,137,275.48 | 6.71 |
| 11 | 600386 | 北巴传媒 | 3,014,148.00 | 6.45 |
| 12 | 002674 | 兴业科技 | 2,973,451.00 | 6.36 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,781,810.40 | 5.95 |
| 14 | 002597 | 金禾实业 | 2,727,974.37 | 5.83 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 15 | 000926 | 福星股份 | 2,720,709.00 | 5.82 |
| 16 | 002601 | 佰利联 | 2,690,773.01 | 5.75 |
| 17 | 300098 | 高新兴 | 2,630,235.00 | 5.62 |
| 18 | 002245 | 澳洋顺昌 | 2,578,207.00 | 5.51 |
| 19 | 300401 | 花园生物 | 2,537,682.66 | 5.43 |
| 20 | 600110 | 诺德股份 | 2,537,189.00 | 5.43 |
| 21 | 300230 | 永利股份 | 2,437,772.00 | 5.21 |
| 22 | 603108 | 润达医疗 | 2,362,544.00 | 5.05 |
| 23 | 002777 | 久远银海 | 2,340,690.00 | 5.01 |
| 24 | 603788 | 宁波高发 | 2,313,703.76 | 4.95 |
| 25 | 002626 | 金达威 | 2,275,287.00 | 4.87 |
| 26 | 002167 | 东方锆业 | 2,204,757.00 | 4.71 |
| 27 | 600303 | 曙光股份 | 2,166,184.02 | 4.63 |
| 28 | 002584 | 西陇科学 | 2,078,728.50 | 4.45 |
| 29 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,070,825.65 | 4.43 |
| 30 | 000100 | TCL 集团 | 2,057,812.00 | 4.40 |
| 31 | 002665 | 首航节能 | 2,000,389.00 | 4.28 |
| 32 | 300499 | 高澜股份 | 1,889,857.00 | 4.04 |
| 33 | 000513 | 丽珠集团 | 1,882,881.34 | 4.03 |
| 34 | 000596 | 古井贡酒 | 1,868,173.72 | 4.00 |
| 35 | 000529 | 广弘控股 | 1,865,554.25 | 3.99 |
| 36 | 000892 | 星美联合 | 1,858,252.90 | 3.97 |
| 37 | 601677 | 明泰铝业 | 1,858,063.00 | 3.97 |
| 38 | 002001 | 新 和 成 | 1,850,619.02 | 3.96 |
| 39 | 600998 | 九州通 | 1,846,016.00 | 3.95 |
| 40 | 600458 | 时代新材 | 1,838,677.63 | 3.93 |
| 41 | 002675 | 东诚药业 | 1,812,246.20 | 3.88 |
| 42 | 002127 | 南极电商 | 1,769,264.66 | 3.78 |
| 43 | 002381 | 双箭股份 | 1,767,989.00 | 3.78 |
| 44 | 002258 | 利尔化学 | 1,738,247.70 | 3.72 |
| 45 | 002355 | 兴民智通 | 1,708,827.00 | 3.65 |
| 46 | 600990 | 四创电子 | 1,668,060.00 | 3.57 |
| 47 | 600257 | 大湖股份 | 1,664,391.35 | 3.56 |
| 48 | 600161 | 天坛生物 | 1,651,862.27 | 3.53 |
| 49 | 600079 | 人福医药 | 1,646,077.00 | 3.52 |
| 50 | 300198 | 纳川股份 | 1,624,756.00 | 3.47 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 51 | 601688 | 华泰证券 | 1,609,369.00 | 3.44 |
| 52 | 000581 | 威孚高科 | 1,604,121.00 | 3.43 |
| 53 | 600485 | 信威集团 | 1,553,712.00 | 3.32 |
| 54 | 600048 | 保利地产 | 1,546,081.00 | 3.31 |
| 55 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,537,409.00 | 3.29 |
| 56 | 002281 | 光迅科技 | 1,531,193.00 | 3.27 |
| 57 | 002169 | 智光电气 | 1,512,420.17 | 3.23 |
| 58 | 600584 | 长电科技 | 1,493,227.00 | 3.19 |
| 59 | 300072 | 三聚环保 | 1,489,475.00 | 3.19 |
| 60 | 601607 | 上海医药 | 1,477,568.00 | 3.16 |
| 61 | 002076 | 雪莱特 | 1,472,077.89 | 3.15 |
| 62 | 600518 | 康美药业 | 1,459,902.00 | 3.12 |
| 63 | 000650 | 仁和药业 | 1,456,154.50 | 3.11 |
| 64 | 000661 | 长春高新 | 1,423,582.76 | 3.04 |
| 65 | 002411 | 必康股份 | 1,420,809.58 | 3.04 |
| 66 | 300241 | 瑞丰光电 | 1,418,463.00 | 3.03 |
| 67 | 300404 | 博济医药 | 1,412,898.08 | 3.02 |
| 68 | 601388 | 怡球资源 | 1,391,900.00 | 2.98 |
| 69 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,380,578.00 | 2.95 |
| 70 | 300228 | 富瑞特装 | 1,380,344.00 | 2.95 |
| 71 | 300447 | 全信股份 | 1,354,162.00 | 2.90 |
| 72 | 002458 | 益生股份 | 1,353,222.00 | 2.89 |
| 73 | 300180 | 华峰超纤 | 1,351,318.00 | 2.89 |
| 74 | 002604 | 龙力生物 | 1,346,049.00 | 2.88 |
| 75 | 600976 | 健民集团 | 1,345,865.42 | 2.88 |
| 76 | 600338 | 西藏珠峰 | 1,319,590.00 | 2.82 |
| 77 | 000925 | 众合科技 | 1,314,931.35 | 2.81 |
| 78 | 300354 | 东华测试 | 1,305,605.00 | 2.79 |
| 79 | 002456 | 欧菲光 | 1,296,819.00 | 2.77 |
| 80 | 600322 | 天房发展 | 1,296,585.00 | 2.77 |
| 81 | 300331 | 苏大维格 | 1,287,148.00 | 2.75 |
| 82 | 002230 | 科大讯飞 | 1,267,916.00 | 2.71 |
| 83 | 300389 | 艾比森 | 1,267,508.63 | 2.71 |
| 84 | 300153 | 科泰电源 | 1,265,679.64 | 2.71 |
| 85 | 600682 | 南京新百 | 1,260,932.00 | 2.70 |
| 86 | 000531 | 穗恒运 A | 1,231,344.00 | 2.63 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 87 | 002196 | 方正电机 | 1,202,052.00 | 2.57 |
| 88 | 300422 | 博世科 | 1,161,436.76 | 2.48 |
| 89 | 600259 | 广晟有色 | 1,158,797.00 | 2.48 |
| 90 | 603898 | 好莱客 | 1,148,989.02 | 2.46 |
| 91 | 000910 | 大亚圣象 | 1,146,992.39 | 2.45 |
| 92 | 600880 | 博瑞传播 | 1,143,678.00 | 2.45 |
| 93 | 600198 | 大唐电信 | 1,140,923.41 | 2.44 |
| 94 | 300136 | 信维通信 | 1,140,836.00 | 2.44 |
| 95 | 002522 | 浙江众成 | 1,136,824.00 | 2.43 |
| 96 | 002264 | 新华都 | 1,128,892.92 | 2.41 |
| 97 | 002172 | 澳洋科技 | 1,123,980.00 | 2.40 |
| 98 | 002766 | 索菱股份 | 1,104,104.16 | 2.36 |
| 99 | 000810 | 创维数字 | 1,100,418.00 | 2.35 |
| 100 | 300364 | 中文在线 | 1,096,999.00 | 2.35 |
| 101 | 002668 | 奥马电器 | 1,096,596.00 | 2.35 |
| 102 | 000722 | 湖南发展 | 1,083,921.95 | 2.32 |
| 103 | 300461 | 田中精机 | 1,075,069.14 | 2.30 |
| 104 | 600211 | 西藏药业 | 1,066,194.00 | 2.28 |
| 105 | 600498 | 烽火通信 | 1,058,543.07 | 2.26 |
| 106 | 002126 | 银轮股份 | 1,051,466.00 | 2.25 |
| 107 | 603008 | 喜临门 | 1,038,951.85 | 2.22 |
| 108 | 000911 | 南宁糖业 | 1,031,184.58 | 2.21 |
| 109 | 000903 | 云内动力 | 1,024,468.00 | 2.19 |
| 110 | 603968 | 醋化股份 | 1,012,125.00 | 2.16 |
| 111 | 600589 | 广东榕泰 | 987,153.00 | 2.11 |
| 112 | 002425 | 凯撒文化 | 983,348.00 | 2.10 |
| 113 | 300197 | 铁汉生态 | 973,017.00 | 2.08 |
| 114 | 000018 | 神州长城 | 967,433.00 | 2.07 |
| 115 | 300144 | 宋城演艺 | 957,428.57 | 2.05 |
| 116 | 300318 | 博晖创新 | 953,855.00 | 2.04 |
| 117 | 600628 | 新世界 | 950,503.89 | 2.03 |
| 118 | 000698 | 沈阳化工 | 948,453.00 | 2.03 |
| 119 | 600273 | 嘉化能源 | 946,249.00 | 2.02 |
| 120 | 600851 | 海欣股份 | 942,381.00 | 2.02 |
| 121 | 000718 | 苏宁环球 | 941,528.00 | 2.01 |
| 122 | 300347 | 泰格医药 | 941,436.52 | 2.01 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 123 | 000711 | 京蓝科技 | 936,911.84 | 2.00 |
|-----|--------|------|------------|------|

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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 | 002355 | 兴民智通 | 4,821,833.80 | 10.31 |
| 2 | 002422 | 科伦药业 | 3,803,480.37 | 8.13 |
| 3 | 002294 | 信立泰 | 3,737,856.08 | 7.99 |
| 4 | 002117 | 东港股份 | 3,641,547.57 | 7.79 |
| 5 | 002235 | 安妮股份 | 3,591,391.50 | 7.68 |
| 6 | 002019 | 亿帆医药 | 3,573,978.08 | 7.64 |
| 7 | 002234 | 民和股份 | 3,468,024.66 | 7.42 |
| 8 | 600682 | 南京新百 | 3,419,624.10 | 7.31 |
| 9 | 603818 | 曲美家居 | 3,367,368.52 | 7.20 |
| 10 | 600386 | 北巴传媒 | 3,362,663.34 | 7.19 |
| 11 | 000926 | 福星股份 | 3,346,691.55 | 7.16 |
| 12 | 002007 | 华兰生物 | 3,283,264.16 | 7.02 |
| 13 | 600136 | 当代明诚 | 3,260,655.54 | 6.97 |
| 14 | 600079 | 人福医药 | 3,249,580.97 | 6.95 |
| 15 | 002597 | 金禾实业 | 3,240,540.00 | 6.93 |
| 16 | 002601 | 佰利联 | 2,937,084.00 | 6.28 |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,899,173.80 | 6.20 |
| 18 | 000078 | 海王生物 | 2,856,358.20 | 6.11 |
| 19 | 300401 | 花园生物 | 2,844,285.10 | 6.08 |
| 20 | 300078 | 思创医惠 | 2,774,661.12 | 5.93 |
| 21 | 002245 | 澳洋顺昌 | 2,759,869.84 | 5.90 |
| 22 | 300072 | 三聚环保 | 2,666,077.41 | 5.70 |
| 23 | 600056 | 中国医药 | 2,589,777.96 | 5.54 |
| 24 | 300499 | 高澜股份 | 2,526,114.80 | 5.40 |
| 25 | 603788 | 宁波高发 | 2,523,670.16 | 5.40 |
| 26 | 002127 | 南极电商 | 2,495,518.66 | 5.34 |
| 27 | 300098 | 高新兴 | 2,466,527.00 | 5.27 |
| 28 | 000952 | 广济药业 | 2,362,680.17 | 5.05 |
| 29 | 002050 | 三花智控 | 2,333,662.11 | 4.99 |
| 30 | 600584 | 长电科技 | 2,324,910.05 | 4.97 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 31 | 002167 | 东方锆业 | 2,323,875.00 | 4.97 |
| 32 | 300230 | 永利股份 | 2,310,915.42 | 4.94 |
| 33 | 002626 | 金达威 | 2,240,540.07 | 4.79 |
| 34 | 002584 | 西陇科学 | 2,229,825.46 | 4.77 |
| 35 | 002665 | 首航节能 | 2,143,578.41 | 4.58 |
| 36 | 002674 | 兴业科技 | 2,138,588.23 | 4.57 |
| 37 | 002777 | 久远银海 | 2,127,157.00 | 4.55 |
| 38 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,009,080.28 | 4.30 |
| 39 | 000100 | TCL 集团 | 1,988,500.60 | 4.25 |
| 40 | 002001 | 新 和 成 | 1,988,423.29 | 4.25 |
| 41 | 000596 | 古井贡酒 | 1,961,928.14 | 4.20 |
| 42 | 600458 | 时代新材 | 1,894,784.00 | 4.05 |
| 43 | 002258 | 利尔化学 | 1,892,522.00 | 4.05 |
| 44 | 002381 | 双箭股份 | 1,830,188.00 | 3.91 |
| 45 | 601677 | 明泰铝业 | 1,827,947.44 | 3.91 |
| 46 | 002675 | 东诚药业 | 1,754,127.40 | 3.75 |
| 47 | 600257 | 大湖股份 | 1,711,842.85 | 3.66 |
| 48 | 600303 | 曙光股份 | 1,691,460.00 | 3.62 |
| 49 | 000581 | 威孚高科 | 1,674,783.00 | 3.58 |
| 50 | 002281 | 光迅科技 | 1,671,459.42 | 3.57 |
| 51 | 000892 | 星美联合 | 1,651,933.09 | 3.53 |
| 52 | 600110 | 诺德股份 | 1,619,406.71 | 3.46 |
| 53 | 600161 | 天坛生物 | 1,581,472.40 | 3.38 |
| 54 | 000516 | 国际医学 | 1,557,765.00 | 3.33 |
| 55 | 000925 | 众合科技 | 1,557,433.10 | 3.33 |
| 56 | 603883 | 老百姓 | 1,556,028.00 | 3.33 |
| 57 | 600338 | 西藏珠峰 | 1,512,079.46 | 3.23 |
| 58 | 000810 | 创维数字 | 1,493,274.54 | 3.19 |
| 59 | 000650 | 仁和药业 | 1,489,737.35 | 3.19 |
| 60 | 600990 | 四创电子 | 1,488,875.66 | 3.18 |
| 61 | 002421 | 达实智能 | 1,486,412.59 | 3.18 |
| 62 | 300153 | 科泰电源 | 1,464,599.18 | 3.13 |
| 63 | 601607 | 上海医药 | 1,460,323.00 | 3.12 |
| 64 | 002456 | 欧菲光 | 1,453,944.00 | 3.11 |
| 65 | 002730 | 电光科技 | 1,433,555.67 | 3.07 |
| 66 | 300404 | 博济医药 | 1,433,418.15 | 3.07 |
| 67 | 002604 | 龙力生物 | 1,431,717.83 | 3.06 |
| 68 | 002517 | 恺英网络 | 1,422,676.86 | 3.04 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 69 | 600518 | 康美药业 | 1,421,265.94 | 3.04 |
| 70 | 002411 | 必康股份 | 1,419,089.00 | 3.03 |
| 71 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,418,238.00 | 3.03 |
| 72 | 600048 | 保利地产 | 1,414,890.51 | 3.03 |
| 73 | 601688 | 华泰证券 | 1,408,309.00 | 3.01 |
| 74 | 002169 | 智光电气 | 1,399,391.00 | 2.99 |
| 75 | 300241 | 瑞丰光电 | 1,389,841.00 | 2.97 |
| 76 | 600485 | 信威集团 | 1,378,697.00 | 2.95 |
| 77 | 002264 | 新华都 | 1,370,205.00 | 2.93 |
| 78 | 600198 | 大唐电信 | 1,338,745.00 | 2.86 |
| 79 | 300331 | 苏大维格 | 1,335,129.00 | 2.86 |
| 80 | 000531 | 穗恒运 A | 1,325,550.00 | 2.83 |
| 81 | 002076 | 雪莱特 | 1,310,913.80 | 2.80 |
| 82 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,293,600.00 | 2.77 |
| 83 | 002458 | 益生股份 | 1,283,999.00 | 2.75 |
| 84 | 000529 | 广弘控股 | 1,270,842.50 | 2.72 |
| 85 | 300228 | 富瑞特装 | 1,263,726.00 | 2.70 |
| 86 | 600259 | 广晟有色 | 1,260,875.00 | 2.70 |
| 87 | 002230 | 科大讯飞 | 1,246,175.00 | 2.66 |
| 88 | 002196 | 方正电机 | 1,241,408.00 | 2.65 |
| 89 | 002172 | 澳洋科技 | 1,239,477.00 | 2.65 |
| 90 | 300109 | 新开源 | 1,239,381.00 | 2.65 |
| 91 | 600217 | 中再资环 | 1,203,524.00 | 2.57 |
| 92 | 300198 | 纳川股份 | 1,201,449.85 | 2.57 |
| 93 | 600322 | 天房发展 | 1,143,908.00 | 2.45 |
| 94 | 002425 | 凯撒文化 | 1,136,944.00 | 2.43 |
| 95 | 000566 | 海南海药 | 1,136,610.00 | 2.43 |
| 96 | 603898 | 好莱客 | 1,136,413.00 | 2.43 |
| 97 | 300354 | 东华测试 | 1,129,318.00 | 2.42 |
| 98 | 300136 | 信维通信 | 1,128,901.86 | 2.41 |
| 99 | 600880 | 博瑞传播 | 1,106,647.99 | 2.37 |
| 100 | 002668 | 奥马电器 | 1,105,884.00 | 2.36 |
| 101 | 000910 | 大亚圣象 | 1,096,509.35 | 2.34 |
| 102 | 000903 | 云内动力 | 1,096,112.00 | 2.34 |
| 103 | 300389 | 艾比森 | 1,083,724.92 | 2.32 |
| 104 | 002522 | 浙江众成 | 1,050,626.00 | 2.25 |
| 105 | 002467 | 二六三 | 1,045,041.00 | 2.23 |
| 106 | 600498 | 烽火通信 | 1,040,787.00 | 2.23 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 107 | 600211 | 西藏药业 | 1,032,587.00 | 2.21 |
| 108 | 600122 | 宏图高科 | 1,028,853.00 | 2.20 |
| 109 | 000711 | 京蓝科技 | 1,009,603.00 | 2.16 |
| 110 | 603008 | 喜临门 | 1,005,611.70 | 2.15 |
| 111 | 300364 | 中文在线 | 980,195.36 | 2.10 |
| 112 | 002434 | 万里扬 | 969,615.00 | 2.07 |
| 113 | 300422 | 博世科 | 962,917.00 | 2.06 |
| 114 | 002686 | 亿利达 | 962,096.50 | 2.06 |
| 115 | 601388 | 怡球资源 | 947,899.33 | 2.03 |
| 116 | 000018 | 神州长城 | 935,782.00 | 2.00 |

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 | 270,698,452.13 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 276,111,972.84 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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**

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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**

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

8.12.2 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。

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 | 16,594.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | 934,764.44 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,057.07 |
| 5 | 应收申购款 | 947.61 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 953,363.88 |

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 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 |
| 2,904 | 12,069.12 | 5,024,120.60 | 14.33% | 30,024,609.28 | 85.67% |

注：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 | 9,915.53 | 0.0283% |

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（2014年1月24日）基金份额总额 | 22,376,979.98 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 37,604,250.04 |
| 本报告期基金总申购份额 | 26,795,412.27 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 29,350,932.43 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 35,048,729.88 |

§ 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

基金管理人于 2016 年 6 月 25 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十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期应支付的审计费用为 3 万元整。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、报告期内基金管理人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并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内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 | |
| 申银万国 | 1 | 61,039,334.88 | 11.16% | 55,625.14 | 11.16% | - |
| 财富证券 | 1 | 55,059,395.86 | 10.07% | 50,177.13 | 10.06% | - |
| 光大证券 | 2 | 50,646,493.89 | 9.26% | 46,156.56 | 9.26% | - |
| 招商证券 | 2 | 47,776,131.11 | 8.74% | 43,544.44 | 8.73% | - |
| 国海证券 | 1 | 39,511,354.86 | 7.23% | 36,006.82 | 7.22% | - |
| 江海证券 | 1 | 35,680,471.80 | 6.53% | 32,517.60 | 6.52% | - |
| 东莞证券 | 1 | 34,261,171.10 | 6.27% | 31,220.69 | 6.26% | - |
| 广州证券 | 1 | 29,166,017.13 | 5.33% | 26,576.80 | 5.33% | - |
| 长江证券 | 1 | 25,787,370.32 | 4.72% | 23,499.65 | 4.71% | - |
| 中投证券 | 3 | 23,098,540.80 | 4.22% | 21,353.46 | 4.28% | - |
| 广发证券 | 1 | 22,679,032.65 | 4.15% | 20,672.33 | 4.15% | - |
| 渤海证券 | 2 | 20,308,032.77 | 3.71% | 18,506.99 | 3.71% | - |
| 华宝证券 | 1 | 16,387,133.07 | 3.00% | 14,935.67 | 3.00% | - |
| 国都证券 | 1 | 14,548,295.93 | 2.66% | 13,259.96 | 2.66% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 13,166,319.15 | 2.41% | 11,998.91 | 2.41% | - |
| 方正证券 | 1 | 12,998,428.61 | 2.38% | 11,845.60 | 2.38% | - |
| 海通证券 | 2 | 11,690,790.27 | 2.14% | 10,652.98 | 2.14% | - |
| 万联证券 | 1 | 10,542,245.81 | 1.93% | 9,606.80 | 1.93% | - |
| 华福证券 | 1 | 6,431,176.00 | 1.18% | 5,859.15 | 1.18% | - |
| 安信证券 | 2 | 4,720,295.00 | 0.86% | 4,301.48 | 0.86% | - |
| 华泰证券 | 2 | 3,159,979.93 | 0.58% | 2,880.08 | 0.58% | - |
| 民生证券 | 1 | 3,002,110.23 | 0.55% | 2,735.82 | 0.55% | - |
| 中信建投 | 1 | 2,958,870.84 | 0.54% | 2,698.32 | 0.54% | - |
| 恒泰证券 | 1 | 2,191,432.96 | 0.40% | 1,997.43 | 0.40% | - |
| 中航证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 西南证券 | 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% | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|-------|---|-------|---|
| 东方证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中信证券 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 英大证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 东海证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国泰君安 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 平安证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 国信证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 天源证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 中金公司 | 2 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 湘财证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 东兴证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 银河证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | 0.00% | - | 0.00% | - |
| 东吴证券 | 1 | - | 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、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：恒泰证券、方正证券、中信建投证券、平安证券。退出交易单元：中泰证券。

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

无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《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。

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（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。

3、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。

大成基金管理有限公司
2017 年 3 月 25 日