

大成动态量化配置策略混合型  
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	大成动态量化配置混合
基金主代码	003147
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	130,412,346.52 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，并通过数学建模的方式根据宏观经济变量以及风险预警指标动态调整资产配置的比例，在有效控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。
投资策略	本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，确定当前市场环境下的主要投资方向和资产配置比例。同时，量化模型通过持续跟踪宏观经济变量、风险预警指标等，判断不同资产类别在当前市场环境下的风险收益状态，根据市场环境变化时，动态调整投资组合结构、各类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
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	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
--------------------	---

址	
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 9 月 20 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	11,849,894.10	-3,708,634.39
本期利润	17,889,179.64	-10,590,940.15
加权平均基金份额本期利润	0.0731	-0.0239
本期基金份额净值增长率	5.30%	-2.83%
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	0.0232	-0.0283
期末基金资产净值	133,431,640.69	362,672,812.02
期末基金份额净值	1.0232	0.9717

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。

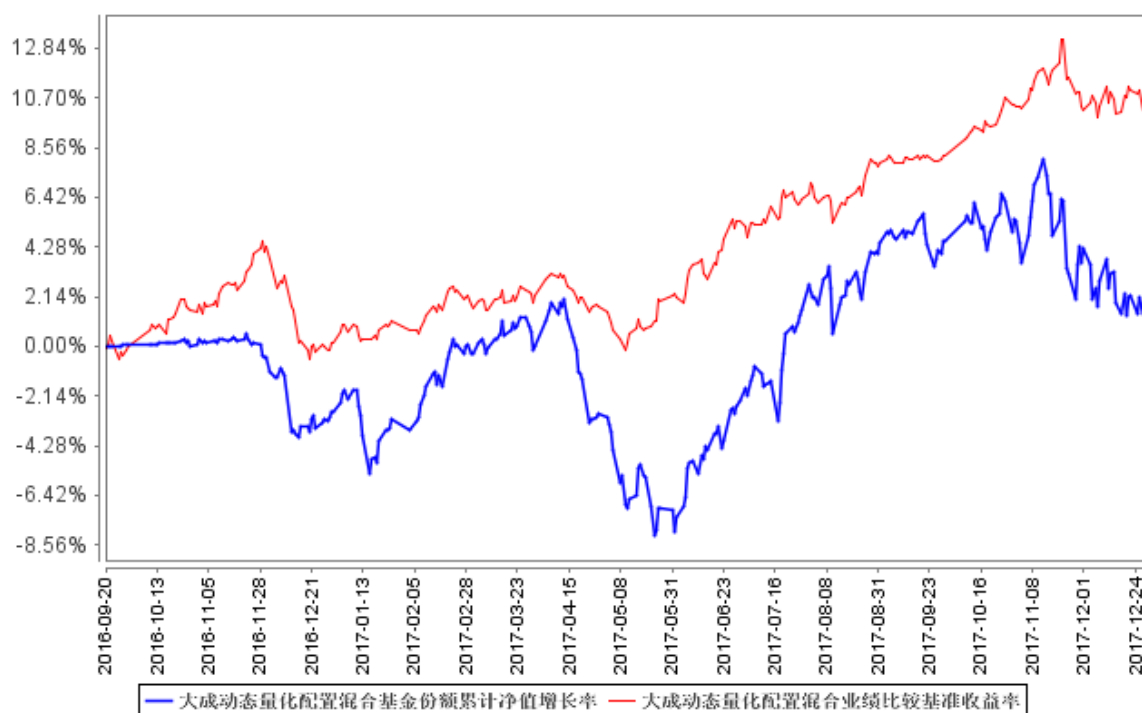
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

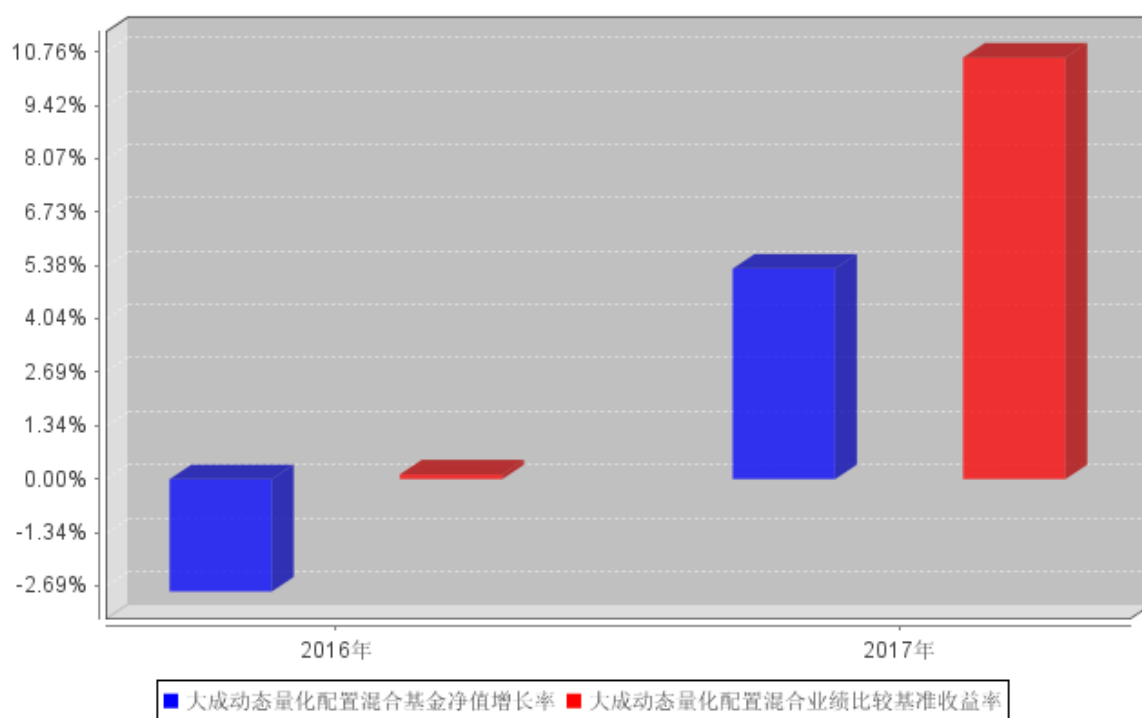
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.10%	0.83%	2.33%	0.40%	-4.43%	0.43%
过去六个月	4.83%	0.73%	5.12%	0.35%	-0.29%	0.38%
过去一年	5.30%	0.67%	10.62%	0.32%	-5.32%	0.35%
自基金合同生效起至今	2.32%	0.61%	10.75%	0.34%	-8.43%	0.27%

### 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：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 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：无。

## §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		
黎新平先生	本基金基金经理，数量与指数投资部总监	2016 年 9 月 20 日	-	9 年	经济学博士。2008 年 7 月至 2015 年 6 月历任 Aristeia capital 量化投资部资深策略师、投资经理。2015 年 7 月加入大成基金管理有限公司，现任数量与指数投资部总监。自 2016 年 9 月 20 日起担任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。自 2017 年 3 月 18 日起任大成绝对收益策略混合型发起式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 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 年市场呈现“一九分化”的极端行情，以指数权重股为代表的蓝筹大白马股票强势上涨，上证 50 上涨 25.08%，沪深 300 上涨 21.78%，上证综指上涨 6.56%，而中证 500 下跌 0.20%，创业板指下跌 10.67%。资金抱团“漂亮 50”的情形也在“存量博弈”中进一步推动了中小市值股票以及创业板股票的弱势，加剧了市场进一步分化。从因子表现上，大市值、低市盈率、绩优股成为最重要的推动因子，全年保持强势。而高估值成长、小盘、反转则成为亏损最为严重的大类因子。从行业看，2017 年表现最好的行业是家电、食品饮料；而纺织服装、传媒、计算机则表现相对落后。

大成动态量化采用动态多因子选股模型进行量化股票组合的操作，在选股及行业配置上相对分散。随着二季度以来严监管及金融去杠杆政策预期的影响，A 股市场开始呈现极端结构分化行情并持续到年末，资金密集扎堆于指数权重以及家电白酒等大白马股票。这种集中于指数权重及个别行业的极端分化状态对于行业及市值分布相对均衡的量化策略形成不利的市场环境。大成动态量化以估值、盈利、质量等基本面因子作为主要选股因子，并注意控制高估值、小市值等风险因子的暴露，但由于策略采用了较为均衡的市值和行业的配置，在指数权重大幅上涨及市场大多股票弱势下跌的结构分化行情中，产生了较大的波动。

#### 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 1.0232 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.30%，业绩比较基准收益率为 10.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从历史数据看，2017 年市场的分化结构已经到达相对极端的状态，并造成许多量化策略的严重失效。随着估值的调整，这种极端的分化终会有所缓解。在全球经济同步复苏以及流动性仍然偏紧的大背景下，2018 年盈利能力、业绩、估值等仍会是投资的主线，但随着价值投资实质性理念重视，一些在其他行业或其他板块的低估值、盈利能力良好的公司将会受到关注。而部分中小创企业也已经到达估值合理的价位，具备业绩基本面支撑的“中小板蓝筹”及“创业板蓝筹”将迎来超跌补涨的空间。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风

险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金管理人将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。

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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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，未发现有关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：大成动态量化配置策略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
<b>资 产：</b>		
银行存款	10,876,030.71	13,282,789.55
结算备付金	3,427,691.02	21,149,633.45
存出保证金	1,175,628.85	2,700,504.54
交易性金融资产	108,514,292.14	253,888,348.53
其中：股票投资	108,288,456.94	179,070,568.53
基金投资	-	-
债券投资	225,835.20	74,817,780.00
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	10,000,000.00	72,000,000.00
应收证券清算款	13,698.63	-
应收利息	1,036.87	575,747.14
应收股利	-	-
应收申购款	3,007.17	31,064.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	134,011,385.39	363,628,087.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	14,778.96	4,207.68
应付管理人报酬	138,332.22	374,921.43
应付托管费	28,819.22	78,108.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	137,777.91	413,027.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,036.39	85,010.43
负债合计	579,744.70	955,275.95
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	130,412,346.52	373,233,229.95
未分配利润	3,019,294.17	-10,560,417.93
所有者权益合计	133,431,640.69	362,672,812.02
负债和所有者权益总计	134,011,385.39	363,628,087.97

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0232 元，基金份额总额

130,412,346.52 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成动态量化配置策略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 9 月 20 日(基金合 同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	23,720,516.90	-8,002,074.14
1. 利息收入	1,805,065.11	2,574,950.91
其中：存款利息收入	155,731.28	275,229.08
债券利息收入	957,418.87	347,339.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	691,914.96	1,952,382.19
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,527,771.31	-4,577,472.18
其中：股票投资收益	16,084,762.63	-3,830,446.09
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,778,427.72	-408,422.19
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	104,740.00	-341,720.00
股利收益	3,116,696.40	3,116.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,039,285.54	-6,882,305.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	348,394.94	882,752.89
<b>减：二、费用</b>	5,831,337.26	2,588,866.01
1. 管理人报酬	2,949,404.88	1,495,098.25



2. 托管费	614,459.33	311,478.79
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,875,875.05	688,791.77
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	391,598.00	93,497.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>17,889,179.64</b>	<b>-10,590,940.15</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>17,889,179.64</b>	<b>-10,590,940.15</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成动态量化配置策略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）	373,233,229.95	-10,560,417.93	362,672,812.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,889,179.64	17,889,179.64
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）	-242,820,883.43	-4,309,467.54	-247,130,350.97
其中：1. 基金申购款	13,894,431.81	182,869.50	14,077,301.31
2. 基金赎回款	-256,715,315.24	-4,492,337.04	-261,207,652.28
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）	130,412,346.52	3,019,294.17	133,431,640.69
项目	上年度可比期间 2016 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		



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(“中国农业银行”)	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 9 月 20 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	405,126,544.13	33.56%	66,235,915.94	12.77%

###### 7.4.4.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 9 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 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	229,800.00	0.47%	10,863,394.80	23.80%

###### 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 9 月 20 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	310,000,000.00	31.13%	2,290,000,000.00	36.42%

#### 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	369,194.82	33.56%	9,591.39	6.96%
关联方名称	上年度可比期间 2016年9月20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	60,361.30	12.77%	-	-

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9月20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	2,949,404.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,102,251.46	584,507.86

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 1.20% 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 X 1.20% / 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9月20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	614,459.33	311,478.79
----------------	------------	------------

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9月20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	10,876,030.71	132,508.37	13,282,789.55	233,324.63

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

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

金额单位：人民币元

7.4.5.1.1 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

300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

## 7.4.5.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123006	东财转债	2017年12月20日	2018年1月29日	新债流通受限	100.00	100.00	1,439	143,900.00	143,900.00	-
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	新债流通受限	100.00	100.00	272	27,200.00	27,200.00	-

## 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
300032	金龙机电	2017年11月27日	重大事项	13.89	-	-	68,482	990,392.48	951,214.98	-
300040	九洲电气	2017年12月18日	重大事项	9.67	2018年1月2日	9.67	31,400	337,550.00	303,638.00	-
002082	万邦德	2017年12月18日	重大事项	13.97	-	-	20,900	332,276.00	291,973.00	-
300038	梅泰诺	2017年12月	重大事项	48.60	-	-	5,700	209,019.00	277,020.00	-

		26 日								
002745	木林森	2017 年 12 月 28 日	重大事项	45.50	2018 年 1 月 5 日	46.50	3,800	208,963.00	172,900.00	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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

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

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	108,288,456.94	80.81
	其中：股票	108,288,456.94	80.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	225,835.20	0.17
	其中：债券	225,835.20	0.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,000,000.00	7.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,303,721.73	10.67
8	其他各项资产	1,193,371.52	0.89
9	合计	134,011,385.39	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	-	-
B	采矿业	3,357,740.80	2.52
C	制造业	61,133,516.76	45.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	745,959.00	0.56
E	建筑业	526,769.00	0.39
F	批发和零售业	7,071,049.20	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	6,232,998.28	4.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,658,114.55	6.49
J	金融业	8,572,591.12	6.42
K	房地产业	6,454,719.60	4.84
L	租赁和商务服务业	1,867,472.00	1.40

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	246,757.20	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	336,128.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	3,084,641.43	2.31
S	综合	-	-
	合计	108,288,456.94	81.16

### 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	600050	中国联通	600,000	3,798,000.00	2.85
2	300088	长信科技	447,600	3,504,708.00	2.63
3	002110	三钢闽光	138,000	2,668,920.00	2.00
4	300072	三聚环保	61,600	2,164,008.00	1.62
5	600340	华夏幸福	65,800	2,065,462.00	1.55
6	002352	顺丰控股	36,600	1,843,176.00	1.38
7	601238	广汽集团	73,600	1,814,976.00	1.36
8	002271	东方雨虹	44,800	1,790,208.00	1.34
9	601088	中国神华	75,200	1,742,384.00	1.31
10	000581	威孚高科	71,700	1,720,800.00	1.29

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	600340	华夏幸福	6,561,348.19	1.81
2	300059	东方财富	5,933,680.39	1.64
3	300072	三聚环保	5,853,703.71	1.61
4	601229	上海银行	5,763,095.66	1.59
5	000036	华联控股	5,236,751.54	1.44
6	600133	东湖高新	5,194,214.00	1.43

7	300088	长信科技	5,127,257.00	1.41
8	600016	民生银行	5,091,853.00	1.40
9	002352	顺丰控股	4,993,546.00	1.38
10	600641	万业企业	4,950,854.98	1.37
11	600230	沧州大化	4,499,059.00	1.24
12	600050	中国联通	4,430,918.00	1.22
13	002648	卫星石化	4,167,748.76	1.15
14	002271	东方雨虹	4,134,314.40	1.14
15	600057	象屿股份	4,119,438.19	1.14
16	000055	方大集团	4,104,964.00	1.13
17	600303	曙光股份	4,006,478.49	1.10
18	603518	维格娜丝	3,819,080.31	1.05
19	600508	上海能源	3,803,183.33	1.05
20	600688	上海石化	3,742,988.74	1.03

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	600133	东湖高新	7,042,235.00	1.94
2	002714	牧原股份	6,761,099.37	1.86
3	000036	华联控股	6,202,973.16	1.71
4	600016	民生银行	6,014,059.00	1.66
5	002372	伟星新材	4,773,128.94	1.32
6	600547	山东黄金	4,755,507.72	1.31
7	601229	上海银行	4,639,686.60	1.28
8	600742	一汽富维	4,414,357.78	1.22
9	600303	曙光股份	4,401,915.00	1.21
10	600508	上海能源	4,337,827.53	1.20
11	600340	华夏幸福	4,320,991.56	1.19
12	600230	沧州大化	4,116,584.00	1.14
13	300059	东方财富	4,085,777.92	1.13
14	601998	中信银行	4,017,261.00	1.11
15	002648	卫星石化	3,869,907.00	1.07
16	600720	祁连山	3,847,066.87	1.06
17	002271	东方雨虹	3,829,061.00	1.06

18	300072	三聚环保	3,740,355.00	1.03
19	600641	万业企业	3,711,507.55	1.02
20	000488	晨鸣纸业	3,700,142.04	1.02

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	561,375,066.25
卖出股票收入（成交）总额	652,951,358.03

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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	225,835.20	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	225,835.20	0.17

### 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

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	123006	东财转债	1,439	143,900.00	0.11
2	110030	格力转债	520	54,735.20	0.04
3	128024	宁行转债	272	27,200.00	0.02

### 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1803	IC1803	4	4,969,600.00	-137,240.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-137,240.00
股指期货投资本期收益（元）					104,740.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-80,920.00

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期流动性、套保有效等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上力求实现长期稳定增值。

### 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：本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

## 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，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	1,175,628.85
2	应收证券清算款	13,698.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,036.87
5	应收申购款	3,007.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,193,371.52

### 8.12.4 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	110030	格力转债	54,735.20	0.04

### 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
4,173	31,251.46	49,944,319.46	38.30%	80,468,027.06	61.70%

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	1,495,148.91	1.1465%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月20日）基金份额总额	560,560,675.30
本报告期期初基金份额总额	373,233,229.95
本报告期基金总申购份额	13,894,431.81
减:本报告期基金总赎回份额	256,715,315.24
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	130,412,346.52



## § 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)，本年度支付的审计费用为 6 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	
光大证券		2405,126,544.13	33.56%	369,194.82	33.56%	-
第一创业		1124,489,412.90	10.31%	113,447.07	10.31%	-
西部证券		1119,443,440.81	9.89%	108,849.61	9.89%	-
兴业证券		2103,034,022.17	8.53%	93,893.27	8.53%	-
国金证券	2	93,451,280.48	7.74%	85,162.32	7.74%	-
天风证券	2	75,697,138.01	6.27%	68,982.96	6.27%	-
国泰君安	2	73,026,768.38	6.05%	66,549.97	6.05%	-
中信建投	2	59,075,350.43	4.89%	53,836.88	4.89%	-
红塔证券	1	53,833,554.99	4.46%	49,058.01	4.46%	-
东吴证券	1	26,850,822.88	2.22%	24,469.37	2.22%	-
万和证券	1	20,993,046.34	1.74%	19,131.47	1.74%	-

东方证券	1	14,876,655.82	1.23%	13,557.46	1.23%	-
上海证券	1	11,687,286.87	0.97%	10,650.54	0.97%	-
联讯证券	1	9,896,041.30	0.82%	9,018.34	0.82%	-
中信证券	2	7,275,940.36	0.60%	6,630.36	0.60%	-
方正证券	1	7,043,858.15	0.58%	6,419.16	0.58%	-
中金公司	3	1,250,123.00	0.10%	1,139.42	0.10%	-
华西证券	1	162,228.78	0.01%	147.86	0.01%	-
山西证券	1	67,872.12	0.01%	61.87	0.01%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

安信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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。

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	229,800.00	0.47%	310,000,000.00	31.13%	-	-
兴业证券	23,709,625.20	48.92%	356,000,000.00	35.75%	-	-
国金证券	18,397,714.45	37.96%	80,000,000.00	8.03%	-	-
天风证券	6,131,753.43	12.65%	25,800,000.00	2.59%	-	-
国泰君安	-	-	169,000,000.00	16.97%	-	-
红塔证券	-	-	20,000,000.00	2.01%	-	-
中信证券	-	-	15,000,000.00	1.51%	-	-
方正证券	-	-	20,000,000.00	2.01%	-	-

## §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