

大成定增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	大成定增灵活配置混合
场内简称	大成定增
基金主代码	160921
交易代码	160921
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 19 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	1,005,616,196.89 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在封闭期内，本基金主要参与上市公司股票定向增发，基金管理人在控制风险的前提下，追求基金资产长期稳健增值。 转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人在控制风险和保持资产流动性的基础上，主要采用多策略投资于股票，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、市场面、政策面等因素的分析研究，结合与定增事件相关的情绪指标确定股票、债券及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
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	2017 年	2016 年 8 月 19 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	11,483,977.37	163,807.76
本期利润	-1,321,828.03	1,556,137.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0013	0.0015
本期基金份额净值增长率	-0.20%	0.20%
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	0.0002	0.0002
期末基金资产净值	1,005,850,506.22	1,007,172,334.25
期末基金份额净值	1.000	1.002

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。

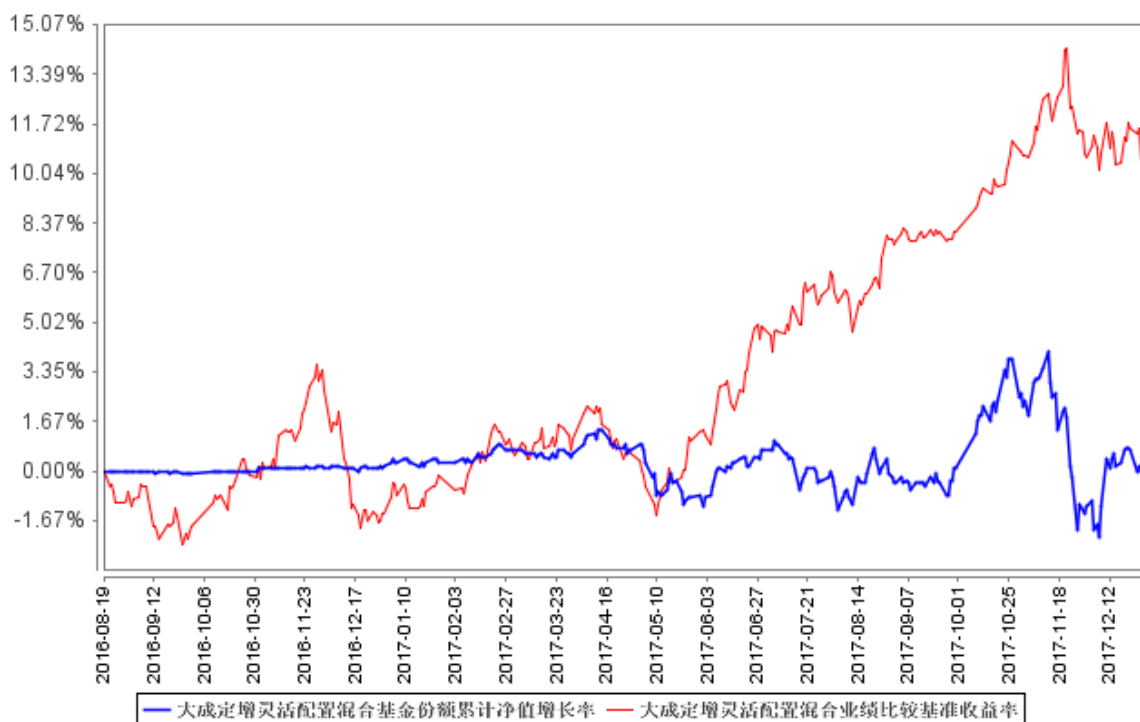
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.10%	0.62%	2.88%	0.48%	-2.98%	0.14%
过去六个月	-0.70%	0.48%	6.08%	0.42%	-6.78%	0.06%
过去一年	-0.20%	0.37%	12.79%	0.39%	-12.99%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.00%	0.31%	11.21%	0.40%	-11.21%	-0.09%

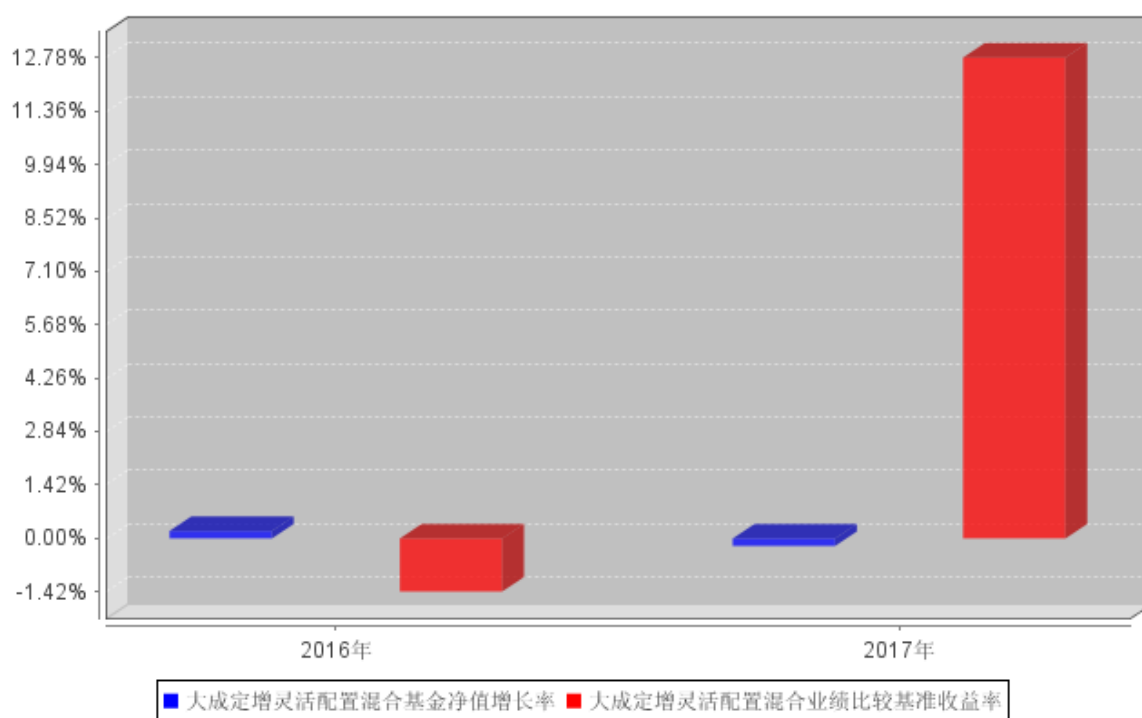
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金的《基金合同》生效日为2016年8月19日，截至本报告期末，基金成立已满一年；

2、按基金合同规定，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有关约定。截至报告期末，本基金投资顺丰控股（002352）因定增股票估值方式变更，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：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		
戴军先生	本基金基金经理，研究部副总监	2016年8月19日	-	6年	金融学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司，历任研究员、行业研究主管、大成价值增长基金经理助理，2015年5月21日至2015年7月23日任大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年7月24日起任大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年8月19日起任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任研究部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国。
石国武先生	本基金基金经理，大类资产配置部总	2016年8月19日	2017年9月12日	15年	工学硕士。2002年12月至2012年11月就职于博时基金管理有限公司，历任系统分析员、股票投资部投资经理助理、特定资产部

	监			<p>投资经理。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 4 月 18 日至 2017 年 9 月 12 日担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014 年 8 月 23 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日至 2016 年 3 月 8 日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 18 日至 2015 年 7 月 23 日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 7 月 24 日至 2016 年 5 月 25 日任大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 9 月 23 日至 2017 年 3 月 18 日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。2016 年 8 月 19 日至 2017 年 9 月 12 日任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日至 2017 年 9 月 12 日任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任大类资产配置部总监兼社保基金及机构投资部总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	---	--	--	---

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

经过三年超常规发展，2017 年监管机构开始对再融资市场加强了管控，先后出台再融资新规和减持新规，并控制了定增项目的发行节奏。在此影响下，一年期定增市场规模较 2016 年下降 30% 以上。同时，在经济回暖、利率上行、监管加强背景下，A 股运行结构和风格显著区别于过去三年，大市值、低估值、龙头白马股重获机构的青睐，并且有愈演愈烈趋势。定增股票池以中小市值公司为主，也暴露出一定的局限性。

报告期内，大成定增面对极其复杂的市场状况，按时完成了建仓计划，定增获配仓位达到 65% 以上，并获取到顺丰控股等标志性项目，同时开始建立二级市场仓位，并参与打新。

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 1.000 元；本报告期基金份额净值增长率为 -0.20%，业绩比较基准收益率为 12.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

可以预见的未来一年，政局稳定，经济保持中高速发展，同时产业结构升级和消费升级提速，这为企业盈利端继续成长提供了较好的基础。金融监管进入新一轮加强周期，溯本清源，有利于抑制不合理杠杆和泡沫。我们认为在合理收益预期下，A 股市场仍是积极可为的。目前大成定增核心持仓品种质地较优，基本面与估值匹配度高，未来一年风险收益比较佳。同时，我们也会根据市场情况，调整二级市场仓位，弥补现有组合在风格、行业配置上的不足。

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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成定增灵活配置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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本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：大成定增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	221,961,736.43	16,226,751.61
结算备付金	280,060.07	4,545,454.55
存出保证金	107,555.12	5,513.33
交易性金融资产	785,440,761.65	126,825,940.88
其中：股票投资	785,440,761.65	126,825,940.88
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	-	700,000,000.00
应收证券清算款	-	160,053,666.39
应收利息	45,594.32	1,126,758.70
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,007,835,707.59	1,008,784,085.46
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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,277,477.66	1,279,304.63
应付托管费	212,912.95	213,217.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	194,810.76	29,229.16
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	300,000.00	90,000.00
负债合计	1,985,201.37	1,611,751.21
所有者权益：		
实收基金	1,005,616,196.89	1,005,616,196.89
未分配利润	234,309.33	1,556,137.36
所有者权益合计	1,005,850,506.22	1,007,172,334.25
负债和所有者权益总计	1,007,835,707.59	1,008,784,085.46

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.000 元，基金份额总额

1005616196.89 份。

7.2 利润表

会计主体：大成定增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 8 月 19 日(基金合 同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	17,767,977.54	8,228,714.07
1. 利息收入	7,840,234.56	7,897,034.00
其中：存款利息收入	2,572,808.92	908,289.55
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	5,267,425.64	6,988,744.45
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	22,733,548.38	-1,060,993.84
其中：股票投资收益	18,762,061.30	-1,060,993.84
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	3,971,487.08	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-12,805,805.40	1,392,329.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	344.31
减：二、费用	19,089,805.57	6,672,576.71
1. 管理人报酬	15,145,356.59	5,525,072.32

2. 托管费	2,524,226.09	920,845.37
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	912,838.39	65,638.62
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	507,384.50	161,020.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,321,828.03	1,556,137.36
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,321,828.03	1,556,137.36

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成定增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）	1,005,616,196.89	1,556,137.36	1,007,172,334.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,321,828.03	-1,321,828.03
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	1,005,616,196.89	234,309.33	1,005,850,506.22
项目	上年度可比期间 2016 年 8 月 19 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）	1,005,616,196.89	-	1,005,616,196.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,556,137.36	1,556,137.36
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	1,005,616,196.89	1,556,137.36	1,007,172,334.25

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>崔伟</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。该估值技术变更使本基金2017年12月31日的基金资产净值及2017年度净损益减少，相关影响非重大。

除上述事项外，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。

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、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
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8月19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	151,019,785.66	23.72%	11,308,661.31	21.52%

7.4.4.1.2 债券交易

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。

7.4.4.1.3 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8月19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	1,780,000,000.00	32.19%	-	0.00%

7.4.4.1.4 权证交易

注：本报告期本基金及上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

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	137,621.76	23.72%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年8月19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	10,305.14	21.52%	-	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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 8 月 19 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	15,145,356.59	5,525,072.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1,423,832.86	518,517.97

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 8 月 19 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	2,524,226.09	920,845.37

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：本报告期基金及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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8月19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
中国银行	221,961,736.43	2,523,840.32	16,226,751.61	865,785.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

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**

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
002352	顺丰控股	2017年8月22日	2018年8月23日	非公开发行流通受限	35.19	47.51	1,136,686	39,999,980.34	54,003,951.86	-
002352	顺丰控股	2017年8月22日	2019年8月23日	非公开发行流通受限	35.19	43.40	1,136,687	40,000,015.53	49,332,215.80	-
000513	丽珠集团	2016年9月19日	2018年9月20日	非公开发行流通受限	50.10	62.26	780,000	30,060,000.00	48,562,800.00	-
002126	银轮	2017	2018	非公	9.01	9.39	4,384,018	39,500,002.18	41,165,929.02	-

	股份	年 7月 4日	年 7月 5日	开发 行流 通受 限						
002126	银轮 股份	2017 年 7月 4日	2019 年 7月 5日	非公 开发 行流 通受 限	9.01	9.02	4,384,019	39,500,011.19	39,543,851.38	-
002705	新宝 股份	2017 年 3月 30日	2018 年 4月 2日	非公 开发 行流 通受 限	17.86	11.94	2,547,586	34,999,913.65	30,418,176.84	-
002705	新宝 股份	2017 年 3月 30日	2019 年 4月 1日	非公 开发 行流 通受 限	17.86	11.39	2,547,587	34,999,927.39	29,017,015.93	-
601689	拓普 集团	2017 年 5月 26日	2018 年 5月 24日	非公 开发 行流 通受 限	30.52	23.73	1,146,788	34,999,969.76	27,213,279.24	-
603898	好莱 客	2017 年 8月 1日	2018 年 8月 1日	非公 开发 行流 通受 限	33.81	28.61	916,888	30,999,983.28	26,232,165.68	-
601689	拓普 集团	2017 年 5月 26日	2019 年 5月 24日	非公 开发 行流 通受 限	30.52	22.79	1,146,789	35,000,000.28	26,135,321.31	-
603898	好莱 客	2017 年 8月 1日	2019 年 8月 1日	非公 开发 行流 通受 限	33.81	27.54	916,888	30,999,983.28	25,251,095.52	-
000035	中国 天楹	2017 年 7月 25日	2018 年 7月 26日	非公 开发 行流 通受 限	6.60	6.52	3,863,636	25,499,997.60	25,190,906.72	-

000035	中国天楹	2017年7月25日	2019年7月26日	非公开发行流通受限	6.60	6.21	3,863,637	25,500,004.20	23,993,185.77	-
601000	唐山港	2016年12月19日	2018年12月19日	非公开发行流通受限	4.16	4.27	4,807,693	20,000,002.88	20,528,849.11	-
002250	联化科技	2017年1月17日	2018年1月18日	非公开发行流通受限	15.96	10.48	1,879,699	29,999,996.04	19,699,245.52	-
002250	联化科技	2017年1月17日	2019年1月18日	非公开发行流通受限	15.96	10.08	1,879,699	29,999,996.04	18,947,365.92	-
603788	宁波高发	2017年8月16日	2018年8月15日	非公开发行流通受限	38.51	33.54	519,345	19,999,975.95	17,418,831.30	-
603788	宁波高发	2017年8月16日	2019年8月15日	非公开发行流通受限	38.51	31.92	519,346	20,000,014.46	16,577,524.32	-
001896	豫能控股	2017年4月26日	2018年4月27日	非公开发行流通受限	9.30	5.30	2,150,538	20,000,003.40	11,397,851.40	-
001896	豫能控股	2017年4月26日	2019年4月29日	非公开发行流通受限	9.30	4.98	2,150,538	20,000,003.40	10,709,679.24	-
603889	新澳股份	2017年8月1日	2018年8月1日	非公开发行流通受限	13.01	13.96	581,926	7,570,857.26	8,123,686.96	-

				限						
603889	新澳股份	2017年8月1日	2019年8月1日	非公开发行流通受限	13.01	13.21	581,926	7,570,857.26	7,687,242.46	-
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	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
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	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2. 丽珠医药集团股份有限公司于 2017 年 7 月 7 日(流通受限期内)，向全体股东每 10 股派 5.00 元人民币现金(含税)，同时按每 10 股转增 3 股进行资本公积金转增股本。

3. 广东新宝电器股份有限公司于 2017 年 6 月 9 日(流通受限期内)，向全体股东每 10 股派 3.50 元人民币现金(含税)，同时按每 10 股转增 3 股进行资本公积金转增股本。

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	停牌日	停牌	期末	复牌日	复牌	数量(股)	期末	期末估值	备注
------	----	-----	----	----	-----	----	-------	----	------	----

码	名称	期	原因	估值单价	期	开盘单价		成本总额	总额	
600903	贵州燃气	2017年12月28日	重大事项	16.86	2018年1月2日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
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

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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市场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	785,440,761.65	77.93
	其中：股票	785,440,761.65	77.93
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	222,241,796.50	22.05
8	其他各项资产	153,149.44	0.02
9	合计	1,007,835,707.59	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	536,065,844.67	53.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,249,669.77	2.21
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	31,321,077.12	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	146,551,691.13	14.57
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	1,950.72	0.00
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	49,216,415.69	4.89
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	785,440,761.65	78.09

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：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	002352	顺丰控股	2,273,373	103,336,167.66	10.27
2	000513	丽珠集团	1,317,980	84,311,571.00	8.38
3	002126	银轮股份	8,768,037	80,709,780.40	8.02
4	601689	拓普集团	3,029,677	71,559,714.55	7.11
5	002705	新宝股份	5,095,173	59,435,192.77	5.91
6	603898	好莱客	1,833,776	51,483,261.20	5.12
7	000035	中国天楹	7,727,273	49,184,092.49	4.89
8	600887	伊利股份	1,467,549	47,240,402.31	4.70
9	601000	唐山港	9,615,385	43,173,078.43	4.29
10	002250	联化科技	3,759,398	38,646,611.44	3.84

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	601689	拓普集团	99,034,907.88	9.83
2	002126	银轮股份	96,694,182.77	9.60
3	002352	顺丰控股	79,999,995.87	7.94
4	002705	新宝股份	79,718,662.94	7.92
5	000035	中国天楹	63,297,460.80	6.28
6	603898	好莱客	61,999,966.56	6.16
7	002250	联化科技	59,999,992.08	5.96

8	603788	宁波高发	47,876,638.41	4.75
9	600887	伊利股份	40,968,882.94	4.07
10	600585	海螺水泥	40,334,982.43	4.00
11	001896	豫能控股	40,000,006.80	3.97
12	603900	莱绅通灵	29,900,002.22	2.97
13	002242	九阳股份	27,503,163.24	2.73
14	603889	新澳股份	15,141,714.52	1.50
15	603338	浙江鼎力	11,009,697.07	1.09
16	600219	南山铝业	10,616,074.00	1.05
17	002475	立讯精密	10,034,585.00	1.00
18	600104	上汽集团	10,021,231.67	0.99
19	601939	建设银行	10,020,312.00	0.99
20	600377	宁沪高速	10,017,513.00	0.99

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	600585	海螺水泥	26,065,720.93	2.59
2	000513	丽珠集团	17,672,360.19	1.75
3	002126	银轮股份	17,140,298.16	1.70
4	000596	古井贡酒	13,402,266.43	1.33
5	000333	美的集团	13,256,464.00	1.32
6	000035	中国天楹	11,733,412.00	1.16
7	603338	浙江鼎力	11,589,397.30	1.15
8	002705	新宝股份	10,722,085.42	1.06
9	002242	九阳股份	10,430,372.00	1.04
10	600104	上汽集团	10,388,395.68	1.03
11	600219	南山铝业	10,178,598.00	1.01
12	600741	华域汽车	10,092,445.29	1.00
13	601939	建设银行	10,063,530.00	1.00
14	002603	以岭药业	9,924,250.79	0.99
15	600377	宁沪高速	9,748,743.19	0.97
16	601689	拓普集团	9,623,513.28	0.96
17	600297	广汇汽车	9,416,816.00	0.93
18	002302	西部建设	8,256,866.74	0.82
19	300003	乐普医疗	7,691,395.85	0.76

20	300015	爱尔眼科	6,807,233.66	0.68
----	--------	------	--------------	------

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	928,893,339.88
卖出股票收入（成交）总额	276,234,775.01

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券。

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

注：本报告期末本基金未持有债券。

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

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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 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	107,555.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,594.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,149.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金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	002352	顺丰控股	103,336,167.66	10.27	非公开发行
2	002126	银轮股份	80,709,780.40	8.02	非公开发行
3	002705	新宝股份	59,435,192.77	5.91	非公开发行
4	601689	拓普集团	53,348,600.55	5.30	非公开发行
5	603898	好莱客	51,483,261.20	5.12	非公开发行
6	000035	中国天楹	49,184,092.49	4.89	非公开发行
7	000513	丽珠集团	48,562,800.00	4.83	非公开发行
8	002250	联化科技	38,646,611.44	3.84	非公开发行
9	603788	宁波高发	33,996,355.62	3.38	非公开发行
10	001896	豫能控股	22,107,530.64	2.20	非公开发行

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
2,355	427,013.25	774,460,647.00	77.01%	231,155,549.89	22.99%

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	上海证券有限责任公司	15,000,291.00	31.45%
2	夏建	1,563,200.00	3.28%
3	杨凯	1,430,812.00	3.00%
4	天安人寿保险股份有限公司一万能产品	1,316,273.00	2.76%
5	李泽巧	1,070,062.00	2.24%
6	尤田	1,000,068.00	2.10%
7	曾少芬	1,000,019.00	2.10%
8	刘璟	990,115.00	2.08%
9	国联人寿保险股份有限公司一分红产品贰号	863,820.00	1.81%
10	张东生	600,404.00	1.26%

9.3 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	60,657.46	0.0060%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 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

注：无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月19日）基金份额总额	1,005,616,196.89
本报告期期初基金份额总额	1,005,616,196.89
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
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	1,005,616,196.89

§ 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、基金托管人的重大人事变动

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。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有限公司，本年度应支付的审计费用为 10 万元。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高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	209,918,536.30	32.98%	191,289.77	32.97%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	151,019,785.66	23.72%	137,621.76	23.72%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	15,992,616.77	2.51%	14,571.54	2.51%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	60,116,995.99	9.44%	54,782.48	9.44%	-
江海证券	1	4,903,158.48	0.77%	4,467.32	0.77%	-
联合证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	157,408,554.45	24.73%	143,459.02	24.73%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	2	37,223,771.36	5.85%	33,921.41	5.85%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- (一) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (二) 经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- (三) 研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- (四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- (五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金无新增交易单元。

本报告期内本基金退租交易单元：渤海证券、中投证券。

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
长江证券	-	0.00%	2,450,000,000.00	44.30%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	1,780,000,000.00	32.19%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	1,300,000,000.00	23.51%	-	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	400,017,000.00	-	-	400,017,000.00	39.78%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日