

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)  
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

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 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。

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

本报告期自 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	大成中小盘混合(LOF)
场内简称	大成小盘
基金主代码	160918
交易代码	160918
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月10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	266,650,574.23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	2014年4月30日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小盘股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，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，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。

### 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	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4月10日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	-114,736,456.76	275,611,059.00	88,398,271.92
本期利润	-165,740,751.72	271,476,646.48	49,223,575.76
加权平均基金份额本期利润	-0.4874	1.0215	0.0603
本期基金份额净值增长率	-24.48%	117.84%	15.12%
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	0.7055	1.1172	0.0367
期末基金资产净值	454,777,883.29	617,332,828.67	364,097,546.25
期末基金份额净值	1.706	2.259	1.037

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。

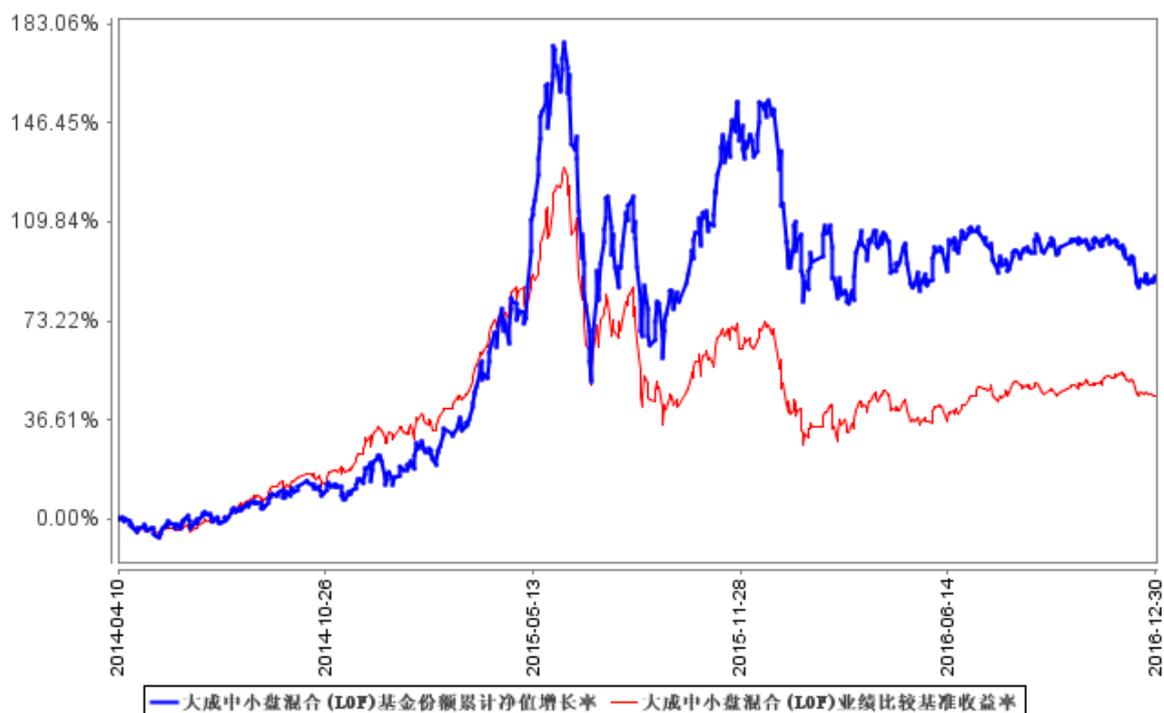
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

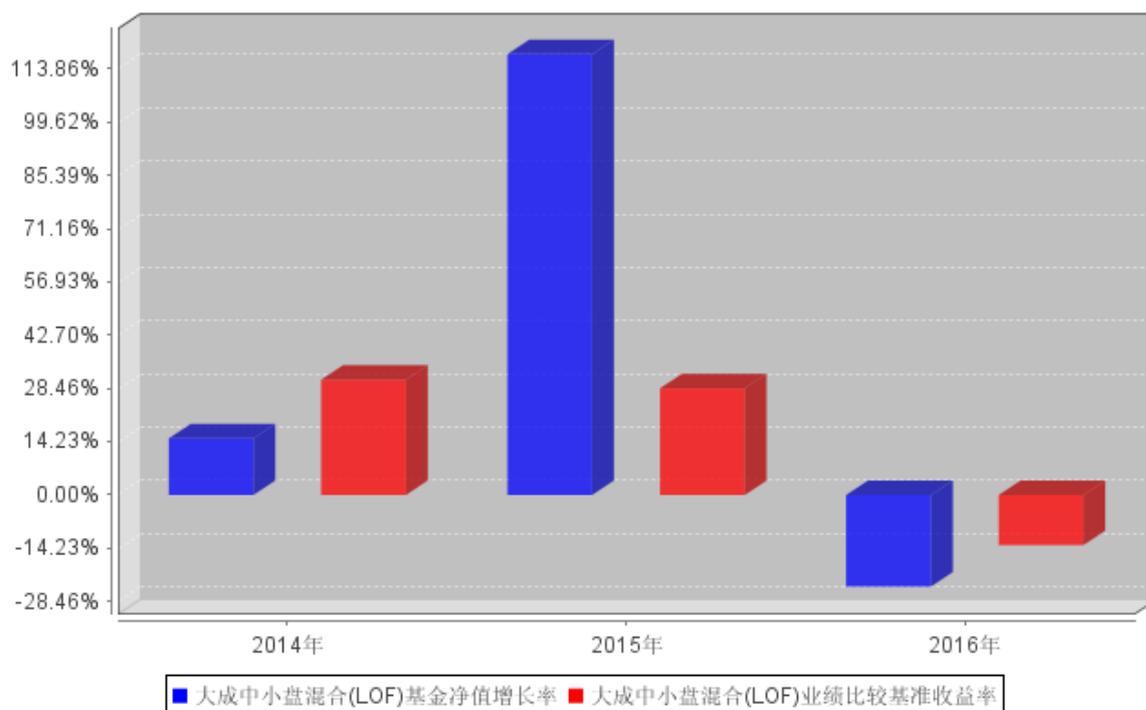
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.38%	0.88%	-0.85%	0.64%	-4.53%	0.24%
过去六个月	-7.18%	0.94%	2.39%	0.71%	-9.57%	0.23%
过去一年	-24.48%	1.87%	-13.41%	1.45%	-11.07%	0.42%
自基金合同生效起至今	89.39%	2.24%	45.59%	1.67%	43.80%	0.57%

### 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：按基金合同规定，本基金自基金转型之日 2014 年 4 月 10 日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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

本基金自 2014 年 4 月 10 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		
魏庆国先生	本基金基金经理	2015年4月7日	-	7年	经济学硕士。2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员;2012年至2013年任职于平安大华基金研究部;2013年5月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日至2015年3月30日担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。2015年4月7日至2015年7月23日起担任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2015年7月24日起任大成中

					小盘混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年4月7日至2016年8月19日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日至2016年8月19日任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2016年3月22日起任大成趋势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》、《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 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 年本产品跑输基准，向各位持有人表示深深的歉意。对操作，有以下反思：

第一是判断 2016 年是一个震荡市，但是操作手法上延续 2015 年的趋势投资思路。

第二是对于之前的传统产业有色煤炭钢铁白酒等今年表现出彩的板块，没有充分挖掘其中的投资机会。

### 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 1.706 元。本报告期内基金份额净值增长率为 -24.48%，同期业绩比较基准收益率-13.41%，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

展望 2017 年，本基金将吸取过去投资的经验和教训，深度研究个股，集中持仓，长期投资，减少交易和博弈。具体来说，就是两个方面：

第一是坚持 GARP 策略，就是估值和业绩增长的权衡。

第二是精选行业龙头，努力从长期的角度去评估一个企业的价值，精选“四有”类的公司，

即：有远大前景的行业，有野心的企业家，有壁垒的商业模式和有弹性的价格。

#### 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分配利润。

#### 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”）在大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)（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 2016 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：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

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
<b>资 产：</b>		
银行存款	48,339,074.98	155,748,366.68
结算备付金	5,956,066.67	9,560,660.51
存出保证金	551,448.26	942,126.32
交易性金融资产	403,536,900.45	498,071,117.30
其中：股票投资	403,536,900.45	498,071,117.30

基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	13,467.67	35,109.94
应收股利	-	-
应收申购款	14,808.24	3,490,908.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	458,411,766.27	667,848,289.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015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	-	42,642,705.92
应付赎回款	262,242.63	1,192,268.57
应付管理人报酬	593,788.94	727,081.64
应付托管费	98,964.81	121,180.28
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,168,422.31	5,270,428.75
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	510,464.29	561,795.41
负债合计	3,633,882.98	50,515,460.57
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	266,650,574.23	273,326,407.00
未分配利润	188,127,309.06	344,006,421.67
所有者权益合计	454,777,883.29	617,332,828.67
负债和所有者权益总计	458,411,766.27	667,848,289.24

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.706 元，基金份额总额 266,650,574.23 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

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
<b>一、收入</b>	-128,659,560.01	304,621,424.24
1. 利息收入	1,139,836.73	712,582.57
其中：存款利息收入	1,139,836.73	712,582.57
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）	-80,143,457.73	302,186,262.73
其中：股票投资收益	-81,666,773.89	301,747,215.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,523,316.16	439,047.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-51,004,294.96	-4,134,412.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,348,355.95	5,856,991.46
<b>减：二、费用</b>	37,081,191.71	33,144,777.76
1. 管理人报酬	9,143,071.97	6,721,750.90
2. 托管费	1,523,845.39	1,120,291.78
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	25,967,809.19	24,839,825.80
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	446,465.16	462,909.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-165,740,751.72	271,476,646.48
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-165,740,751.72	271,476,646.48

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

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）	273,326,407.00	344,006,421.67	617,332,828.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-165,740,751.72	-165,740,751.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,675,832.77	9,861,639.11	3,185,806.34
其中：1. 基金申购款	232,698,966.80	194,235,607.06	426,934,573.86
2. 基金赎回款	-239,374,799.57	-184,373,967.95	-423,748,767.52
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）	266,650,574.23	188,127,309.06	454,777,883.29
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）	351,218,842.97	12,878,703.28	364,097,546.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	271,476,646.48	271,476,646.48
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）	-77,892,435.97	59,651,071.91	-18,241,364.06
其中：1. 基金申购款	475,013,196.07	487,809,252.19	962,822,448.26
2. 基金赎回款	-552,905,632.04	-428,158,180.28	-981,063,812.32
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）	273,326,407.00	344,006,421.67	617,332,828.67

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>周立新</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

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人

所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 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
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。

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 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	2,300,426,286.83	13.28%	-	0.00%

##### 7.4.4.1.2 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	2,096,403.19	13.28%	4,119.36	0.19%
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	-	0.00	-	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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	9,143,071.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,215,119.66	600,336.94

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

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
	当期发生的基金应支付的托管费	1,523,845.39

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2014年4月10日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	12,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	12,000,000.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

注：基金管理人交易本基金的费率符合法律法规、交易所及本基金法律文件的有关规定。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券股份有限公司	0.00	0.0000%	6,000,000.00	2.20%

注：除基金管理人之外的其他关联方交易本基金的费率符合法律法规、交易所及本基金法律文件的有关规定。

## 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	48,339,074.98	967,046.61	155,748,366.68	606,633.98

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

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须作说明的其他关联交易事项。

## 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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限股票。

## 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
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项停牌	33.74	2017年2月8日	33.50	763,500	25,357,475.60	25,760,490.00	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大事项停牌	14.03	2017年1月23日	14.26	1,376,800	20,989,011.03	19,316,504.00	-
300213	佳讯飞鸿	2016年11月4日	重大事项停牌	25.93	2017年2月17日	25.48	738,400	20,365,891.60	19,146,712.00	-
600406	国电南瑞	2016年12月29日	重大事项停牌	16.63	-	-	549,000	9,212,243.00	9,129,870.00	-

注：本基金截至本报告期末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**

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

**7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购**

于本报告期末，本基金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	403,536,900.45	88.03
	其中：股票	403,536,900.45	88.03
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	54,295,141.65	11.84
7	其他各项资产	579,724.17	0.13
8	合计	458,411,766.27	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	276,903,551.13	60.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	44,692,964.00	9.83

F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,940,385.32	18.02
J	金融业	-	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	-	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	403,536,900.45	88.73

### 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	600686	金龙汽车	2,973,341	42,251,175.61	9.29
2	300461	田中精机	565,798	36,114,886.34	7.94
3	000065	北方国际	1,301,050	35,258,455.00	7.75
4	002777	久远银海	319,319	28,802,573.80	6.33
5	002101	广东鸿图	1,237,649	28,775,339.25	6.33
6	002635	安洁科技	763,500	25,760,490.00	5.66
7	300447	全信股份	387,700	21,509,596.00	4.73
8	300098	高新兴	1,376,800	19,316,504.00	4.25
9	300213	佳讯飞鸿	738,400	19,146,712.00	4.21
10	300236	上海新阳	495,601	19,080,638.50	4.20

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	300078	思创医惠	113,233,386.44	18.34
2	002425	凯撒文化	91,625,758.42	14.84
3	000581	威孚高科	81,372,064.67	13.18
4	000060	中金岭南	80,335,942.20	13.01
5	600198	大唐电信	77,036,471.39	12.48
6	300098	高新兴	75,585,760.15	12.24
7	002668	奥马电器	74,092,859.44	12.00
8	300236	上海新阳	73,476,275.40	11.90
9	601689	拓普集团	72,091,356.93	11.68
10	600386	北巴传媒	68,751,946.35	11.14
11	300178	腾邦国际	66,887,723.66	10.83
12	300009	安科生物	66,152,903.72	10.72
13	603398	邦宝益智	65,892,704.59	10.67
14	002730	电光科技	65,626,154.28	10.63
15	300467	迅游科技	65,008,618.02	10.53
16	002050	三花智控	64,498,711.73	10.45
17	000937	冀中能源	64,423,931.91	10.44
18	600686	金龙汽车	64,099,388.29	10.38
19	600195	中牧股份	64,050,360.96	10.38
20	601398	工商银行	63,552,166.20	10.29
21	300166	东方国信	63,443,575.66	10.28
22	002271	东方雨虹	63,037,623.64	10.21
23	600476	湘邮科技	62,399,792.98	10.11
24	002094	青岛金王	61,909,681.90	10.03
25	600068	葛洲坝	61,897,110.52	10.03
26	000810	创维数字	60,904,036.10	9.87
27	002537	海立美达	59,807,997.86	9.69
28	002655	共达电声	58,339,822.57	9.45
29	002281	光迅科技	57,554,087.13	9.32

30	600458	时代新材	55,234,127.05	8.95
31	002662	京威股份	54,904,325.08	8.89
32	000021	深科技	54,290,022.78	8.79
33	002235	安妮股份	54,272,188.00	8.79
34	000526	紫光学大	53,855,933.47	8.72
35	300033	同花顺	52,992,648.66	8.58
36	002245	澳洋顺昌	52,249,510.30	8.46
37	600826	兰生股份	51,583,838.61	8.36
38	002777	久远银海	51,348,388.58	8.32
39	002766	索菱股份	51,126,890.88	8.28
40	300395	菲利华	50,621,383.48	8.20
41	002624	完美世界	49,615,931.72	8.04
42	000925	众合科技	47,709,896.21	7.73
43	002120	韵达股份	46,750,947.75	7.57
44	300377	赢时胜	46,717,127.25	7.57
45	300018	中元股份	46,368,845.10	7.51
46	300326	凯利泰	46,095,138.49	7.47
47	300101	振芯科技	46,047,998.54	7.46
48	603869	北部湾旅	45,563,906.28	7.38
49	603993	洛阳钼业	45,469,164.25	7.37
50	603268	松发股份	44,918,745.64	7.28
51	300384	三联虹普	44,725,381.99	7.24
52	600584	长电科技	43,191,643.11	7.00
53	000807	云铝股份	43,134,558.50	6.99
54	000779	三毛派神	43,019,910.43	6.97
55	002547	春兴精工	42,317,070.67	6.85
56	002051	中工国际	42,188,566.77	6.83
57	300008	天海防务	41,936,878.52	6.79
58	601899	紫金矿业	41,409,825.24	6.71
59	002343	慈文传媒	41,328,611.61	6.69
60	600958	东方证券	40,872,275.56	6.62
61	000065	北方国际	40,731,804.44	6.60
62	002664	信质电机	39,894,460.65	6.46
63	300461	田中精机	39,229,250.86	6.35
64	002434	万里扬	39,009,129.66	6.32
65	002538	司尔特	38,626,324.95	6.26

66	000910	大亚圣象	38,399,049.85	6.22
67	002032	苏泊尔	38,206,457.54	6.19
68	600990	四创电子	38,136,664.37	6.18
69	603601	再升科技	37,793,766.80	6.12
70	300183	东软载波	37,381,899.02	6.06
71	000596	古井贡酒	37,304,216.76	6.04
72	300342	天银机电	37,004,480.28	5.99
73	600235	民丰特纸	36,714,892.30	5.95
74	002609	捷顺科技	36,270,576.54	5.88
75	000818	方大化工	36,170,308.38	5.86
76	300047	天源迪科	36,080,166.68	5.84
77	600306	*ST 商城	35,931,104.75	5.82
78	300156	神雾环保	35,557,909.74	5.76
79	601799	星宇股份	35,258,460.87	5.71
80	002101	广东鸿图	34,940,494.64	5.66
81	600547	山东黄金	34,323,892.29	5.56
82	300339	润和软件	34,044,190.54	5.51
83	002103	广博股份	33,467,596.23	5.42
84	300241	瑞丰光电	32,962,804.16	5.34
85	300304	云意电气	32,276,053.52	5.23
86	000892	欢瑞世纪	31,977,263.05	5.18
87	300224	正海磁材	31,957,436.65	5.18
88	600517	置信电气	31,769,606.08	5.15
89	002239	奥特佳	31,610,118.51	5.12
90	300396	迪瑞医疗	31,265,866.47	5.06
91	000889	茂业通信	31,237,658.88	5.06
92	000657	中钨高新	31,149,396.57	5.05
93	002264	新华都	30,964,467.50	5.02
94	000070	特发信息	30,790,595.69	4.99
95	300011	鼎汉技术	30,536,411.73	4.95
96	002587	奥拓电子	30,396,649.90	4.92
97	600149	廊坊发展	30,149,972.50	4.88
98	600197	伊力特	29,884,894.99	4.84
99	002153	石基信息	29,666,682.42	4.81
100	300165	天瑞仪器	29,466,611.58	4.77
101	300202	聚龙股份	29,465,701.66	4.77

102	300422	博世科	29,379,352.27	4.76
103	300468	四方精创	29,329,035.94	4.75
104	600809	山西汾酒	29,181,826.27	4.73
105	600571	信雅达	28,781,814.77	4.66
106	002529	海源机械	28,687,622.66	4.65
107	600645	中源协和	28,627,274.20	4.64
108	000801	四川九洲	28,623,429.07	4.64
109	000881	中广核技	28,223,872.26	4.57
110	002530	丰东股份	27,753,700.00	4.50
111	603588	高能环境	27,698,609.90	4.49
112	300230	永利股份	27,644,806.80	4.48
113	600395	盘江股份	27,076,664.83	4.39
114	300210	森远股份	27,058,012.02	4.38
115	002179	中航光电	27,036,565.03	4.38
116	603026	石大胜华	26,821,489.00	4.34
117	600536	中国软件	26,556,137.90	4.30
118	300386	飞天诚信	26,465,712.20	4.29
119	300523	辰安科技	26,355,822.21	4.27
120	601233	桐昆股份	26,204,086.27	4.24
121	002313	日海通讯	26,050,634.00	4.22
122	600856	中天能源	25,819,644.15	4.18
123	002635	安洁科技	25,357,475.60	4.11
124	002667	鞍重股份	25,326,791.85	4.10
125	300263	隆华节能	25,240,677.48	4.09
126	300493	润欣科技	24,692,069.76	4.00
127	000739	普洛药业	24,427,598.90	3.96
128	300465	高伟达	24,296,848.00	3.94
129	000948	南天信息	24,272,908.60	3.93
130	600661	新南洋	24,201,824.19	3.92
131	002669	康达新材	24,173,772.82	3.92
132	002626	金达威	23,998,594.07	3.89
133	300364	中文在线	23,913,784.00	3.87
134	300373	扬杰科技	23,882,370.54	3.87
135	603968	醋化股份	23,863,897.45	3.87
136	300444	双杰电气	23,814,828.00	3.86
137	002405	四维图新	23,710,352.99	3.84

138	600273	嘉化能源	23,699,088.00	3.84
139	601555	东吴证券	23,697,829.96	3.84
140	002462	嘉事堂	23,638,212.97	3.83
141	600161	天坛生物	23,606,900.07	3.82
142	000686	东北证券	23,473,783.00	3.80
143	000700	模塑科技	23,323,565.16	3.78
144	000911	南宁糖业	23,297,567.07	3.77
145	002649	博彦科技	23,271,963.65	3.77
146	002053	云南能投	23,112,261.62	3.74
147	600657	信达地产	22,837,504.82	3.70
148	600110	诺德股份	22,799,533.00	3.69
149	002108	沧州明珠	22,774,820.29	3.69
150	002371	北方华创	22,767,385.58	3.69
151	002686	亿利达	22,573,515.47	3.66
152	002157	正邦科技	22,463,932.12	3.64
153	002746	仙坛股份	22,460,166.49	3.64
154	000938	紫光股份	22,350,393.80	3.62
155	603108	润达医疗	22,267,536.30	3.61
156	300113	顺网科技	22,250,750.65	3.60
157	603788	宁波高发	22,020,481.19	3.57
158	600056	中国医药	22,000,075.76	3.56
159	603000	人民网	21,964,887.24	3.56
160	300473	德尔股份	21,946,767.35	3.56
161	002354	天神娱乐	21,825,020.86	3.54
162	600155	宝硕股份	21,768,339.81	3.53
163	300375	鹏翎股份	21,728,344.92	3.52
164	603008	喜临门	21,698,100.70	3.51
165	603816	顾家家居	21,659,876.88	3.51
166	600976	健民集团	21,635,067.05	3.50
167	600166	福田汽车	21,511,271.98	3.48
168	002357	富临运业	21,396,672.22	3.47
169	300145	中金环境	21,373,070.33	3.46
170	000975	银泰资源	21,338,631.26	3.46
171	000063	中兴通讯	21,317,098.51	3.45
172	601699	潞安环能	21,170,175.21	3.43
173	600498	烽火通信	21,168,662.31	3.43

174	600879	航天电子	21,077,109.60	3.41
175	600898	三联商社	21,044,645.41	3.41
176	000967	盈峰环境	21,033,557.72	3.41
177	002410	广联达	20,982,055.03	3.40
178	002322	理工环科	20,949,333.68	3.39
179	600266	北京城建	20,900,672.35	3.39
180	600741	华域汽车	20,874,016.59	3.38
181	600848	上海临港	20,862,044.84	3.38
182	603737	三棵树	20,847,752.40	3.38
183	600563	法拉电子	20,758,213.70	3.36
184	300237	美晨科技	20,680,909.07	3.35
185	300213	佳讯飞鸿	20,365,891.60	3.30
186	000531	穗恒运A	20,170,968.00	3.27
187	300447	全信股份	19,923,254.00	3.23
188	600730	中国高科	19,657,397.30	3.18
189	002137	麦达数字	19,444,198.30	3.15
190	300109	新开源	19,353,032.80	3.13
191	603020	爱普股份	18,508,187.62	3.00
192	300136	信维通信	18,285,745.82	2.96
193	002670	国盛金控	18,062,871.76	2.93
194	600460	士兰微	17,958,885.59	2.91
195	002409	雅克科技	17,710,027.20	2.87
196	600150	中国船舶	17,637,957.00	2.86
197	002383	合众思壮	17,277,287.04	2.80
198	002719	麦趣尔	17,187,186.30	2.78
199	600869	智慧能源	17,183,881.50	2.78
200	601633	长城汽车	17,167,018.16	2.78
201	000333	美的集团	17,047,727.61	2.76
202	000625	长安汽车	16,981,603.00	2.75
203	002260	德奥通航	16,662,108.05	2.70
204	000545	金浦钛业	16,623,790.12	2.69
205	000687	华讯方舟	16,548,519.55	2.68
206	002078	太阳纸业	16,496,986.00	2.67
207	300150	世纪瑞尔	16,407,124.97	2.66
208	000903	云内动力	16,385,124.00	2.65
209	002188	巴士在线	16,364,286.42	2.65

210	300436	广生堂	16,345,997.00	2.65
211	002674	兴业科技	16,334,733.65	2.65
212	603818	曲美家居	16,304,062.64	2.64
213	300155	安居宝	16,299,737.38	2.64
214	000733	振华科技	16,254,066.28	2.63
215	000030	富奥股份	16,231,254.15	2.63
216	600348	阳泉煤业	16,214,556.68	2.63
217	000957	中通客车	16,178,368.37	2.62
218	600295	鄂尔多斯	16,120,356.38	2.61
219	002643	万润股份	16,017,486.84	2.59
220	002714	牧原股份	15,852,550.84	2.57
221	600967	北方创业	15,741,553.17	2.55
222	600382	广东明珠	15,673,998.62	2.54
223	300338	开元仪器	15,615,801.00	2.53
224	002553	南方轴承	15,358,918.28	2.49
225	300306	远方光电	15,345,221.00	2.49
226	600802	福建水泥	15,116,338.70	2.45
227	300021	大禹节水	15,082,034.42	2.44
228	300325	德威新材	14,788,279.58	2.40
229	002709	天赐材料	14,741,091.85	2.39
230	600305	恒顺醋业	14,712,107.12	2.38
231	600137	浪莎股份	14,668,925.71	2.38
232	603899	晨光文具	14,582,614.95	2.36
233	002582	好想你	14,529,640.13	2.35
234	002318	久立特材	14,465,209.44	2.34
235	300130	新国都	14,322,150.00	2.32
236	601607	上海医药	14,268,881.55	2.31
237	600988	赤峰黄金	14,264,957.00	2.31
238	600801	华新水泥	14,032,258.76	2.27
239	000606	*ST 易桥	13,795,844.14	2.23
240	300331	苏大维格	13,701,403.10	2.22
241	300121	阳谷华泰	13,634,309.45	2.21
242	600315	上海家化	13,567,826.16	2.20
243	002303	美盈森	13,511,089.75	2.19
244	000513	丽珠集团	13,223,277.86	2.14
245	600690	青岛海尔	13,142,557.00	2.13

246	600597	光明乳业	13,123,660.37	2.13
247	300014	亿纬锂能	12,997,698.21	2.11
248	300322	硕贝德	12,869,784.36	2.08
249	002468	申通快递	12,639,521.00	2.05
250	002077	大港股份	12,532,429.36	2.03
251	002127	南极电商	12,523,457.00	2.03
252	603508	思维列控	12,417,033.49	2.01
253	002025	航天电器	12,361,924.00	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	300078	思创医惠	128,747,842.22	20.86
2	002425	凯撒文化	93,103,619.98	15.08
3	000581	威孚高科	85,163,704.43	13.80
4	002655	共达电声	82,962,429.52	13.44
5	002662	京威股份	81,942,516.97	13.27
6	600386	北巴传媒	79,363,213.00	12.86
7	300342	天银机电	79,253,061.47	12.84
8	000060	中金岭南	78,647,136.37	12.74
9	300098	高新兴	75,005,899.59	12.15
10	002668	奥马电器	73,661,340.31	11.93
11	601689	拓普集团	73,504,370.48	11.91
12	600198	大唐电信	71,506,624.65	11.58
13	603398	邦宝益智	70,912,425.12	11.49
14	000810	创维数字	70,386,333.26	11.40
15	601398	工商银行	67,738,163.30	10.97
16	002271	东方雨虹	64,895,130.86	10.51
17	300467	迅游科技	64,572,125.78	10.46
18	002094	青岛金王	63,963,518.55	10.36
19	000937	冀中能源	63,628,761.14	10.31
20	600068	葛洲坝	63,219,990.58	10.24
21	300178	腾邦国际	63,137,605.25	10.23
22	300009	安科生物	61,894,925.95	10.03
23	300236	上海新阳	60,032,564.94	9.72
24	002730	电光科技	59,574,088.48	9.65

25	300166	东方国信	59,573,266.00	9.65
26	002537	海立美达	59,200,255.12	9.59
27	000021	深科技	57,069,323.09	9.24
28	002050	三花智控	55,569,069.10	9.00
29	000526	紫光学大	55,452,408.65	8.98
30	002245	澳洋顺昌	54,109,153.35	8.76
31	600458	时代新材	53,874,676.94	8.73
32	002120	韵达股份	53,740,903.97	8.71
33	600195	中牧股份	53,495,052.45	8.67
34	002624	完美世界	52,174,495.39	8.45
35	000925	众合科技	51,670,672.96	8.37
36	300109	新开源	51,643,831.52	8.37
37	600990	四创电子	51,540,217.61	8.35
38	300395	菲利华	51,477,075.49	8.34
39	300033	同花顺	51,424,357.50	8.33
40	300101	振芯科技	48,704,565.15	7.89
41	002766	索菱股份	48,265,727.41	7.82
42	002434	万里扬	47,587,128.09	7.71
43	002281	光迅科技	47,163,778.22	7.64
44	603268	松发股份	46,730,926.05	7.57
45	603869	北部湾旅	45,888,215.42	7.43
46	002235	安妮股份	45,795,588.57	7.42
47	300377	赢时胜	45,239,474.17	7.33
48	603993	洛阳钼业	44,873,197.08	7.27
49	002343	慈文传媒	44,870,495.90	7.27
50	300326	凯利泰	44,665,565.87	7.24
51	600584	长电科技	44,558,706.25	7.22
52	000910	大亚圣象	44,344,968.10	7.18
53	300263	隆华节能	43,795,033.99	7.09
54	300018	中元股份	43,494,850.14	7.05
55	002547	春兴精工	43,166,335.66	6.99
56	600826	兰生股份	43,123,601.31	6.99
57	600476	湘邮科技	41,888,327.35	6.79
58	300384	三联虹普	41,835,797.50	6.78
59	002051	中工国际	41,719,051.88	6.76
60	000807	云铝股份	40,912,772.99	6.63
61	603601	再升科技	40,627,036.24	6.58
62	601899	紫金矿业	40,206,560.65	6.51

63	000779	三毛派神	39,578,981.50	6.41
64	002664	信质电机	39,446,437.38	6.39
65	600958	东方证券	39,305,118.24	6.37
66	002032	苏泊尔	38,896,013.47	6.30
67	300008	天海防务	38,599,159.22	6.25
68	300183	东软载波	38,198,136.62	6.19
69	000596	古井贡酒	37,595,400.34	6.09
70	000818	方大化工	37,423,130.80	6.06
71	300156	神雾环保	37,379,600.82	6.06
72	002538	司尔特	37,372,698.85	6.05
73	002264	新华都	37,261,074.40	6.04
74	600547	山东黄金	37,224,514.64	6.03
75	000333	美的集团	37,051,424.71	6.00
76	600235	民丰特纸	36,913,091.69	5.98
77	300304	云意电气	36,646,718.52	5.94
78	002667	鞍重股份	36,395,319.68	5.90
79	002609	捷顺科技	34,995,050.75	5.67
80	002153	石基信息	34,980,419.16	5.67
81	300339	润和软件	34,208,388.16	5.54
82	600809	山西汾酒	33,441,317.57	5.42
83	300047	天源迪科	32,124,245.18	5.20
84	300224	正海磁材	31,926,821.96	5.17
85	300011	鼎汉技术	31,712,852.59	5.14
86	600517	置信电气	31,657,175.34	5.13
87	300396	迪瑞医疗	31,505,868.23	5.10
88	002103	广博股份	31,405,262.46	5.09
89	300468	四方精创	31,017,084.98	5.02
90	600306	*ST 商城	30,477,735.64	4.94
91	000889	茂业通信	30,419,479.73	4.93
92	000892	欢瑞世纪	30,109,046.47	4.88
93	600645	中源协和	29,816,313.72	4.83
94	600149	廊坊发展	29,616,958.00	4.80
95	002529	海源机械	29,555,478.31	4.79
96	600197	伊力特	29,347,119.64	4.75
97	000657	中钨高新	29,249,948.25	4.74
98	002587	奥拓电子	28,932,627.41	4.69
99	002239	奥特佳	28,831,316.56	4.67
100	603588	高能环境	28,766,962.24	4.66

101	002530	丰东股份	28,687,951.32	4.65
102	300241	瑞丰光电	28,630,345.50	4.64
103	300202	聚龙股份	28,530,466.56	4.62
104	300373	扬杰科技	28,218,620.02	4.57
105	300165	天瑞仪器	27,965,702.00	4.53
106	000070	特发信息	27,485,450.83	4.45
107	002179	中航光电	27,342,867.13	4.43
108	000801	四川九洲	27,285,032.06	4.42
109	300422	博世科	27,209,676.11	4.41
110	300210	森远股份	27,019,828.76	4.38
111	600536	中国软件	26,733,370.30	4.33
112	300375	鹏翎股份	26,731,696.72	4.33
113	601233	桐昆股份	26,475,889.99	4.29
114	600856	中天能源	26,389,906.51	4.27
115	300386	飞天诚信	26,317,580.82	4.26
116	000881	中广核技	26,105,977.16	4.23
117	300523	辰安科技	26,043,347.44	4.22
118	600395	盘江股份	26,021,547.16	4.22
119	300230	永利股份	25,982,772.64	4.21
120	002626	金达威	25,899,566.97	4.20
121	300237	美晨科技	25,753,057.33	4.17
122	603026	石大胜华	25,649,658.40	4.15
123	000739	普洛药业	25,605,739.53	4.15
124	600110	诺德股份	25,315,315.08	4.10
125	300493	润欣科技	25,280,721.22	4.10
126	300113	顺网科技	25,169,425.42	4.08
127	002053	云南能投	24,731,314.57	4.01
128	000948	南天信息	24,729,619.80	4.01
129	300473	德尔股份	24,332,199.40	3.94
130	600571	信雅达	24,203,221.25	3.92
131	002649	博彦科技	24,078,880.73	3.90
132	600686	金龙汽车	24,021,588.70	3.89
133	002313	日海通讯	23,898,640.71	3.87
134	600976	健民集团	23,749,260.49	3.85
135	600848	上海临港	23,588,190.00	3.82
136	601555	东吴证券	23,447,307.03	3.80
137	000531	穗恒运A	23,264,419.70	3.77
138	002462	嘉事堂	23,108,559.89	3.74

139	600161	天坛生物	22,827,765.56	3.70
140	000686	东北证券	22,805,738.26	3.69
141	600166	福田汽车	22,688,128.00	3.68
142	300444	双杰电气	22,565,997.64	3.66
143	603968	醋化股份	22,536,813.49	3.65
144	002371	北方华创	22,471,206.80	3.64
145	603788	宁波高发	22,419,177.56	3.63
146	600273	嘉化能源	22,334,565.74	3.62
147	600661	新南洋	22,269,810.75	3.61
148	000911	南宁糖业	22,209,744.38	3.60
149	300364	中文在线	22,088,984.51	3.58
150	600898	三联商社	22,054,718.56	3.57
151	603816	顾家家居	21,954,485.89	3.56
152	300145	中金环境	21,838,579.90	3.54
153	600266	北京城建	21,760,544.00	3.52
154	002405	四维图新	21,667,004.54	3.51
155	002108	沧州明珠	21,637,903.07	3.51
156	300196	长海股份	21,636,209.91	3.50
157	000938	紫光股份	21,615,359.65	3.50
158	603000	人民网	21,565,455.56	3.49
159	600056	中国医药	21,462,379.82	3.48
160	603008	喜临门	21,363,139.70	3.46
161	002357	富临运业	21,196,099.73	3.43
162	600657	信达地产	21,065,611.89	3.41
163	002409	雅克科技	21,004,466.41	3.40
164	000063	中兴通讯	20,978,947.20	3.40
165	600879	航天电子	20,950,312.11	3.39
166	002410	广联达	20,941,313.55	3.39
167	002322	理工环科	20,775,795.75	3.37
168	000700	模塑科技	20,632,663.72	3.34
169	002134	天津普林	20,623,644.76	3.34
170	002746	仙坛股份	20,543,346.14	3.33
171	601699	潞安环能	20,528,450.69	3.33
172	603737	三棵树	20,507,824.34	3.32
173	002686	亿利达	20,433,512.80	3.31
174	002157	正邦科技	20,418,808.39	3.31
175	000967	盈峰环境	20,398,653.15	3.30
176	600155	宝硕股份	20,385,365.22	3.30

177	002354	天神娱乐	20,306,621.00	3.29
178	600498	烽火通信	20,189,173.19	3.27
179	000975	银泰资源	20,080,165.26	3.25
180	600563	法拉电子	20,042,362.82	3.25
181	600741	华域汽车	19,773,721.25	3.20
182	300136	信维通信	19,607,368.04	3.18
183	000985	大庆华科	19,275,796.69	3.12
184	300465	高伟达	19,257,754.77	3.12
185	600460	士兰微	19,202,815.00	3.11
186	002137	麦达数字	19,017,311.57	3.08
187	600150	中国船舶	18,554,644.00	3.01
188	603108	润达医疗	18,498,139.90	3.00
189	000590	启迪古汉	18,282,165.76	2.96
190	600730	中国高科	18,191,695.53	2.95
191	603020	爱普股份	18,108,544.64	2.93
192	600122	宏图高科	17,925,318.00	2.90
193	002670	国盛金控	17,566,030.96	2.85
194	600520	*ST中发	17,342,748.25	2.81
195	300153	科泰电源	17,332,791.92	2.81
196	002383	合众思壮	17,330,814.07	2.81
197	002719	麦趣尔	17,174,608.04	2.78
198	601633	长城汽车	17,105,779.40	2.77
199	000625	长安汽车	16,638,034.88	2.70
200	601799	星宇股份	16,569,065.00	2.68
201	600869	智慧能源	16,413,324.69	2.66
202	002777	久远银海	16,398,684.25	2.66
203	002078	太阳纸业	16,304,930.00	2.64
204	002674	兴业科技	16,162,353.87	2.62
205	300130	新国都	16,154,299.38	2.62
206	300155	安居宝	16,001,798.84	2.59
207	603318	派思股份	15,895,651.48	2.57
208	000957	中通客车	15,885,437.96	2.57
209	000687	华讯方舟	15,851,666.00	2.57
210	000030	富奥股份	15,783,827.09	2.56
211	600348	阳泉煤业	15,606,442.73	2.53
212	002188	巴士在线	15,568,140.79	2.52
213	300150	世纪瑞尔	15,512,438.04	2.51
214	000733	振华科技	15,508,278.10	2.51

215	603818	曲美家居	15,491,469.62	2.51
216	002582	好想你	15,467,895.92	2.51
217	300436	广生堂	15,417,663.00	2.50
218	000903	云内动力	15,324,767.20	2.48
219	002260	德奥通航	15,222,636.90	2.47
220	600382	广东明珠	15,200,233.64	2.46
221	300338	开元仪器	15,197,369.43	2.46
222	600967	北方创业	15,038,110.08	2.44
223	600295	鄂尔多斯	15,011,408.56	2.43
224	600305	恒顺醋业	14,839,455.24	2.40
225	002709	天赐材料	14,789,501.30	2.40
226	002643	万润股份	14,664,411.08	2.38
227	000545	金浦钛业	14,656,479.26	2.37
228	600802	福建水泥	14,594,518.15	2.36
229	002714	牧原股份	14,536,912.61	2.35
230	000606	*ST 易桥	14,292,781.10	2.32
231	300503	昊志机电	14,171,849.76	2.30
232	300014	亿纬锂能	14,149,917.00	2.29
233	600988	赤峰黄金	14,149,499.39	2.29
234	601607	上海医药	14,100,672.37	2.28
235	002077	大港股份	14,080,990.04	2.28
236	603899	晨光文具	13,994,564.80	2.27
237	002318	久立特材	13,974,322.41	2.26
238	600801	华新水泥	13,848,412.23	2.24
239	300322	硕贝德	13,779,277.50	2.23
240	002303	美盈森	13,425,424.60	2.17
241	300325	德威新材	13,311,201.21	2.16
242	000513	丽珠集团	13,278,773.40	2.15
243	600690	青岛海尔	13,225,058.00	2.14
244	600315	上海家化	13,170,140.83	2.13
245	300121	阳谷华泰	13,067,680.39	2.12
246	300021	大禹节水	13,052,066.75	2.11
247	300331	苏大维格	12,663,863.43	2.05
248	002127	南极电商	12,654,503.48	2.05
249	300306	远方光电	12,605,712.00	2.04
250	300359	全通教育	12,446,347.76	2.02
251	000851	高鸿股份	12,417,075.06	2.01

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

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,679,442,931.34
卖出股票收入（成交）总额	8,641,306,079.34

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。

**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** 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	551,448.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,467.67
5	应收申购款	14,808.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	579,724.17

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002635	安洁科技	25,760,490.00	5.66	重大事项停牌
2	300098	高新兴	19,316,504.00	4.25	重大事项停牌
3	300213	佳讯飞鸿	19,146,712.00	4.21	重大事项停牌

**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
20,975	12,712.78	82,293,613.13	30.86%	184,356,961.10	69.14%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 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	中经信投资有限公司	5,167,100.00	4.29%
2	联想投资有限公司	2,131,200.00	1.77%
3	徐惠清	1,300,600.00	1.08%
4	中国石油天然气集团公司企 业年金计划—中国工商银行 股份有限公	1,211,853.00	1.01%
5	黄城	1,143,000.00	0.95%
6	上海协通（集团）有限公司	1,032,300.00	0.86%
7	金宗义	1,000,020.00	0.83%
8	欧阳艳芬	1,000,000.00	0.83%
9	曹素清	642,800.00	0.53%
10	林景周	568,584.00	0.47%

## 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	62,014.41	0.0233%

## 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

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	0~10
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4月10日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	273,326,407.00

本报告期基金总申购份额	232,698,966.80
减:本报告期基金总赎回份额	239,374,799.57
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	266,650,574.23

## § 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。本年度支付的审计费用为 6 万元整。

### 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

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	2,431,618,419.97	14.04%	2,215,976.92	14.03%	-
光大证券	2	2,300,426,286.83	13.28%	2,096,403.19	13.28%	-
长江证券	1	1,606,711,186.47	9.28%	1,464,179.64	9.27%	-
安信证券	2	1,498,569,626.65	8.65%	1,367,928.77	8.66%	-
东方证券	1	881,253,471.75	5.09%	803,596.38	5.09%	-
华泰证券	2	877,971,278.53	5.07%	800,109.93	5.07%	-
万联证券	1	867,007,636.70	5.01%	790,115.72	5.00%	-
广发证券	1	638,297,078.36	3.69%	581,668.48	3.68%	-
方正证券	1	616,123,992.20	3.56%	561,473.11	3.56%	-
渤海证券	2	594,063,786.25	3.43%	541,373.90	3.43%	-
国信证券	1	568,395,402.90	3.28%	517,981.53	3.28%	-
国泰君安	1	550,196,679.77	3.18%	501,412.65	3.18%	-
中投证券	3	515,156,715.69	2.97%	469,462.82	2.97%	-
招商证券	2	475,299,548.97	2.74%	433,149.83	2.74%	-
恒泰证券	1	472,431,611.47	2.73%	430,536.96	2.73%	-
海通证券	2	425,729,603.04	2.46%	390,907.14	2.48%	-
西南证券	1	403,211,870.06	2.33%	367,449.60	2.33%	-
东吴证券	1	386,056,463.07	2.23%	351,822.76	2.23%	-
华林证券	1	350,180,100.89	2.02%	319,122.87	2.02%	-
湘财证券	1	302,412,798.32	1.75%	275,588.22	1.75%	-
中信证券	2	188,265,707.75	1.09%	171,565.89	1.09%	-
中金公司	2	150,897,987.04	0.87%	137,514.89	0.87%	-
长城证券	1	108,465,051.67	0.63%	98,848.45	0.63%	-
江海证券	1	71,169,178.43	0.41%	64,854.60	0.41%	-
银河证券	1	26,172,243.73	0.15%	23,849.69	0.15%	-
平安证券	1	14,309,813.58	0.08%	13,040.64	0.08%	-

齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投证 券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	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%	-

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。

本报告期内增加交易单元：恒泰证券、方正证券、中信建投、平安证券。

本报告期内退租交易单元：中泰证券。

**§ 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