

大成价值增长证券投资基金  
2016 年年度报告摘要  
2016 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。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	大成价值增长混合
基金主代码	090001
前端交易代码	090001
后端交易代码	091001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 11 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	3,477,406,361.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以价值增长类股票为主构造投资组合，在有效分散投资风险的基础上，通过资产配置和投资组合的动态调整，达到超过市场的风险收益比之目标，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略，个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的股票投资重点关注：低 P/B 值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%。

### 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	罗登攀	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
---------------------	---

基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所
------------	---------------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	130,284,033.11	3,471,211,193.05	830,326,713.71
本期利润	13,606,101.78	2,689,504,411.92	1,839,440,773.24
加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.6448	0.1978
本期基金份额净值增长率	2.52%	49.07%	31.42%
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	-0.0015	0.3319	-0.1169
期末基金资产净值	3,472,053,105.45	3,075,530,681.73	7,306,254,492.32
期末基金份额净值	0.9985	1.3319	0.8935

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。

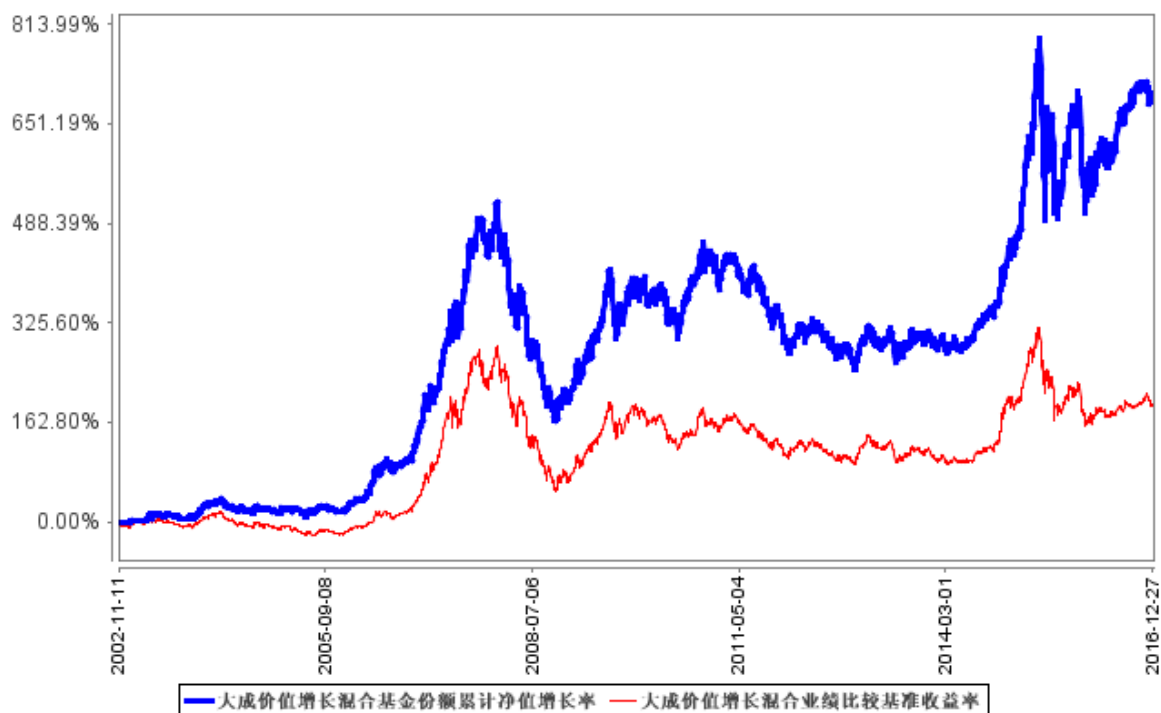
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	0.43%	0.60%	1.12%	0.58%	-0.69%	0.02%
过去六个月	9.75%	0.70%	4.05%	0.61%	5.70%	0.09%
过去一年	2.52%	1.42%	-8.44%	1.12%	10.96%	0.30%
过去三年	100.83%	1.63%	38.29%	1.43%	62.54%	0.20%
过去五年	105.45%	1.45%	39.67%	1.30%	65.78%	0.15%
自基金合同生效起至今	702.19%	1.38%	190.94%	1.43%	511.25%	-0.05%

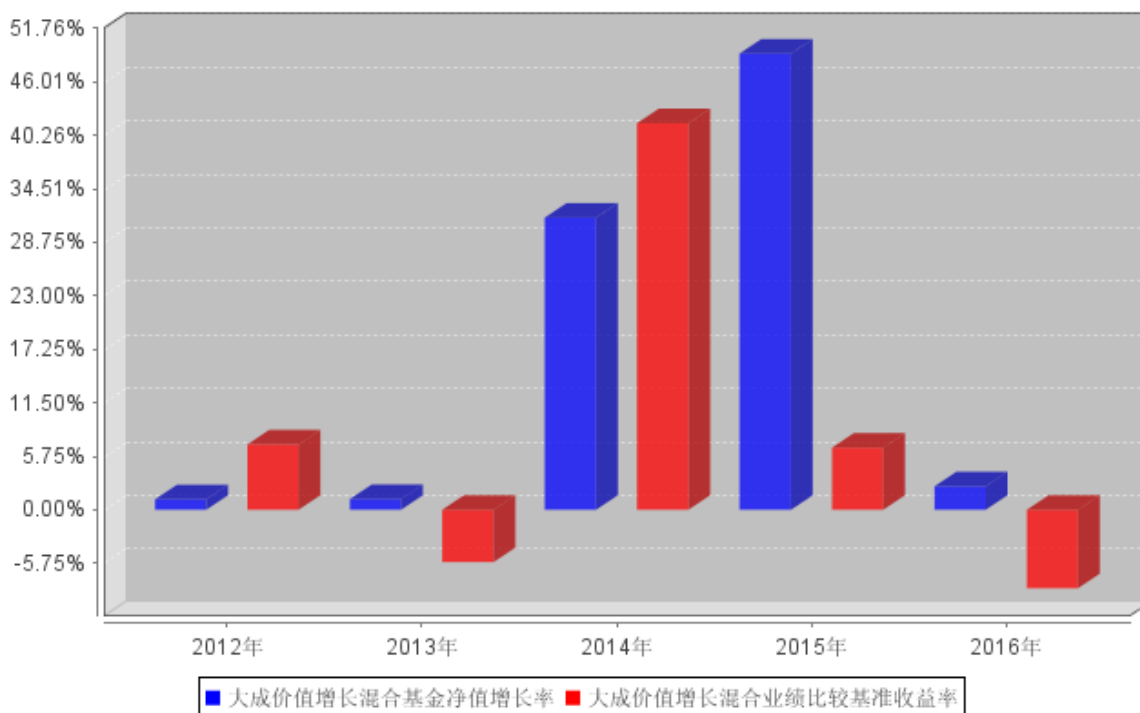
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、按基金合同规定，本基金的初始建仓期为 6 个月。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、本基金业绩比较基准自 2008 年 3 月 1 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%，自 2015 年 9 月 14 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%，本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从 2002 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2008 年 2 月 29 日为原业绩比较基准（中信价值指数×80%+中信国债指数×20%）的走势，2008 年 3 月 1 日至 2015 年 9 月 13 日为业绩比较基准（沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%）的走势，2015 年 9 月 14 日起为变更后的业绩比较基准（沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%）的走势。

### 3.2.3 过去五年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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
2016	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	
合计	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	

## § 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		
石国武先生	本基金基金经理、股票投资部价值组投资总监、大类资产配置部总监	2013 年 4 月 18 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 日起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。2016 年 8 月 20 日起任大成创新成长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。现任股票投资部价值组投资总监。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。

3、自 2017 年 2 月 20 日起，韩创先生增聘为本基金基金经理助理。韩创先生，中山大学经济学硕士研究生。2015 年 6 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员。自 2017 年 2 月 20 日起任大成价值增长证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和



工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 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，沪深 300 表现为-11.28%，中证 500 表现为-17.78%，创业板指表现为-27.71%，A 股市场在年初赢来极为惨淡的开局，新推出的熔断机制加剧了市场的恐慌效应。随着管理层变更和资本市场维稳政策的逐步推出，资本市场缓慢企稳并进入震荡上升走势，市场整体跌幅有所收敛，结构上有业绩支撑的公司股价表现突出，创业板股票表现萎靡。在积极财政政策和稳健的货币政策的作用下，2016 年宏观经济逐步企稳，其中，房地产景气回升和供给侧改革初见成效，对宏观经济保持稳定作用显著。负面因素在于重点城市房地产价格快速上升和金融机构杠杆水平的快速提升给宏观经济的长期稳定积累了一定的潜在风险。随着国庆房地产调控政策出台和央行货币政策向中性的转变，金融体系“防风险”成为重点，债券市场迎来一波超预期的调整。

2016 年，大成价值增长基金继续秉持以风险收益比为核心的多策略平衡投资策略，聚焦于产业和企业层面，寻找未来产业趋势变迁中的受益者和企业竞争中的优胜者，在市场复杂的博弈格局中保持投资定力，业绩表现稳定，和基金经理的预期一致。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 0.9985 元。本报告期内基金份额净值增长率为 2.52%，同期业绩比较基准收益率-8.44%，高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，政策基调由稳增长向防风险转变立场比较坚定，货币环境回归中性稳健，积极财政适度发力以维持经济增长的稳定。我们预计地产投资将小幅下行，全球经济复苏和汇率贬值背景下出口景气有所恢复，由于供给侧改革的加速推进，微观企业经营情况将明显好转，宏观经济即便有所波动也依然能够保持总体稳定。从更长期的视角看，中国经济已经实现从高速增长向中速增长的转变，经济增速快速降低的阶段已经过去，宏观经济逐步进入一个新的稳态区间。伴随宏观经济进入稳态区间，一方面从需求变迁的趋势看产业升级将持续进行，同时从供给角度看大部分产业的优胜劣汰已经或者即将发生，胜者为王，产业结构逐步进入竞合状态，行业优胜者有能力维持市场秩序保持较高回报水平。全球对比来看，中国的服务业的效率和规模存在较大的提升空间，产业层面看，快递、医疗、教育、文化娱乐等行业已经进入持续发展的快速道。随着人均收入的提升，中国消费者基本的数量性需求已经得到满足，消费者对产品和服务品质的需求明显上升，在汽车、家电、服装、食品等行业消费升级的趋势已经并且还将持续的进行，三四五线城市居民在消费升级上表现尤为突出。

从中长期资产配置角度观察，2015 年年中以来资本市场经过多轮调整和长期震荡，市场风险得到充分释放。从上市公司估值水平、盈利能力、分红回报、经营趋势看，权益类资产总体处于合理位置，其中，相当一批优质上市公司的股权价值中长期具备良好风险比。

我们将秉持一贯的投资策略，一方面深入研究公司的长期投资价值，同时跟踪公司经营情况的变化，在合理安全边际下投资我们所青睐的优质公司；同时保持投资的灵活性，对各种可能出现的情景提前做好应对准备。

#### 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，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### **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。本报告期内大成价值增长已分配利润 696,664,498.68（每十份基金份额分红 2.9870 元），符合基金合同规定的分红比例。

#### **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**

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办

法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本基金 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：大成价值增长证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	20,308,059.61	230,887,282.86
结算备付金	11,565,103.78	13,977,632.35
存出保证金	1,708,393.78	4,088,565.03
交易性金融资产	3,496,950,571.45	3,301,686,091.68
其中：股票投资	2,778,414,439.27	2,248,211,540.18
基金投资	-	-
债券投资	718,536,132.18	1,053,474,551.50
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	79,038,275.44	20,135,953.82
应收利息	12,959,515.87	21,811,791.45
应收股利	-	-
应收申购款	25,277,450.63	224,228.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,647,807,370.56	3,592,811,545.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 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	130,000,000.00	498,998,851.50
应付证券清算款	35,875,549.22	-
应付赎回款	1,472,784.96	5,345,639.67
应付管理人报酬	4,526,176.59	3,967,390.01
应付托管费	754,362.76	661,231.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,701,248.30	7,468,794.09

应交税费	-	-
应付利息	91,271.33	558,874.03
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	332,871.95	280,083.04
负债合计	175,754,265.11	517,280,863.98
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,477,406,361.94	2,309,211,183.72
未分配利润	-5,353,256.49	766,319,498.01
所有者权益合计	3,472,053,105.45	3,075,530,681.73
负债和所有者权益总计	3,647,807,370.56	3,592,811,545.71

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9985 元，基金份额总额 3,477,406,361.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	93,184,072.36	2,847,084,255.17
1. 利息收入	18,147,626.22	46,833,406.60
其中：存款利息收入	1,509,844.55	3,838,178.66
债券利息收入	16,421,665.07	42,902,716.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	216,116.60	92,511.34

其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	191,206,602.02	3,577,140,800.49
其中：股票投资收益	170,910,419.54	3,400,805,093.19
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,091,158.51	139,272,191.81
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	21,387,340.99	37,063,515.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-116,677,931.33	-781,706,781.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	507,775.45	4,816,829.21
<b>减：二、费用</b>	<b>79,577,970.58</b>	<b>157,579,843.25</b>
1. 管理人报酬	42,642,786.84	70,931,547.10
2. 托管费	7,107,131.13	11,821,924.48
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	25,456,749.68	48,539,762.84
5. 利息支出	3,769,146.80	25,633,072.00
其中：卖出回购金融资产支出	3,769,146.80	25,633,072.00
6. 其他费用	602,156.13	653,536.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>13,606,101.78</b>	<b>2,689,504,411.92</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>13,606,101.78</b>	<b>2,689,504,411.92</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,309,211,183.72	766,319,498.01	3,075,530,681.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,606,101.78	13,606,101.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,168,195,178.22	-88,614,357.60	1,079,580,820.62
其中：1. 基金申购款	2,005,403,937.80	-113,444,715.93	1,891,959,221.87
2. 基金赎回款	-837,208,759.58	24,830,358.33	-812,378,401.25
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）	-	-696,664,498.68	-696,664,498.68
五、期末所有者权益（基金净值）	3,477,406,361.94	-5,353,256.49	3,472,053,105.45
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）	8,176,803,559.38	-870,549,067.06	7,306,254,492.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,689,504,411.92	2,689,504,411.92
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）	-5,867,592,375.66	-1,052,635,846.85	-6,920,228,222.51
其中：1. 基金申购款	676,429,405.71	97,875,479.35	774,304,885.06
2. 基金赎回款	-6,544,021,781.37	-1,150,511,326.20	-7,694,533,107.57
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）	2,309,211,183.72	766,319,498.01	3,075,530,681.73



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、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
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	4,266,485,277.98	24.95%	5,428,137,599.48	18.11%

##### 7.4.4.1.2 债券交易

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	144,916,316.49	12.84%	-	0.00%

## 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 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	
	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	342,000,000.00	9.58%	-	0.00%

## 7.4.4.1.4 权证交易

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 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	3,888,097.51	24.94%	52,198.64	1.93%
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	4,898,612.10	18.09%	1,685,598.05	22.58%

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	42,642,786.84
其中：支付销售机构的客	6,069,204.46	11,189,138.64

户维护费		
------	--	--

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 × 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,107,131.13	11,821,924.48

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

单位：人民币元

本期						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	420,000,000.00	183,975.34
上年度可比期间						
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	509,700,000.00	1,045,803.84

#### 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。

##### 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 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
中国农业银行	20,308,059.61	1,305,581.96	230,887,282.86	3,617,738.35

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（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

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
000513	丽珠集团	2016年9月19日	-	非公开发行流通受限	50.10	52.77	600,000	30,060,000.00	31,662,000.00	-
601000	唐山港	2016年12月19日	-	非公开发行流通受限	4.16	4.01	2,403,846	9,999,999.36	9,639,422.46	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-

		日	10日							
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，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票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 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	临时停牌	33.74	2017年2月8日	33.50	1,000,067	31,990,557.47	33,742,260.58	-

300537	广信材料	2016 年 10 月 12 日	临时停 牌	48.79	2017 年 1 月 13 日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
--------	------	------------------------	----------	-------	--------------------	-------	-------	----------	-----------	---

注：本基金截至 2016 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 130,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 18 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 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	2,778,414,439.27	76.17
	其中：股票	2,778,414,439.27	76.17
2	固定收益投资	718,536,132.18	19.70
	其中：债券	718,536,132.18	19.70
	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	31,873,163.39	0.87
7	其他各项资产	118,983,635.72	3.26
8	合计	3,647,807,370.56	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	1,971,184,728.17	56.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	217,081.66	0.01
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	354,929,339.30	10.22
G	交通运输、仓储和邮政业	9,648,881.14	0.28
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,255,310.60	1.22
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	64,646,488.80	1.86
L	租赁和商务服务业	182,422,839.33	5.25
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	98,054,037.74	2.82
S	综合	54,933,360.30	1.58
	合计	2,778,414,439.27	80.02

### 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	000625	长安汽车	17,000,078	253,981,165.32	7.32
2	000910	大亚圣象	11,631,182	222,155,576.20	6.40
3	600998	九州通	10,598,190	219,806,460.60	6.33
4	000513	丽珠集团	3,494,046	203,857,737.00	5.87



5	300058	蓝色光标	17,937,349	182,422,839.33	5.25
6	002258	利尔化学	14,371,424	178,636,800.32	5.14
7	000860	顺鑫农业	5,860,513	128,931,286.00	3.71
8	600195	中牧股份	5,129,294	108,997,497.50	3.14
9	300144	宋城演艺	4,408,221	92,308,147.74	2.66
10	002640	跨境通	4,293,813	78,576,777.90	2.26

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	000625	长安汽车	222,164,127.96	7.22
2	000513	丽珠集团	211,296,584.76	6.87
3	600500	中化国际	186,125,029.20	6.05
4	600998	九州通	174,750,942.23	5.68
5	300058	蓝色光标	172,627,088.23	5.61
6	002258	利尔化学	162,836,270.91	5.29
7	000860	顺鑫农业	147,371,637.55	4.79
8	002281	光迅科技	144,819,921.20	4.71
9	002007	华兰生物	139,616,300.65	4.54
10	600683	京投发展	135,781,988.33	4.41
11	000910	大亚圣象	128,963,189.05	4.19
12	600195	中牧股份	119,494,331.24	3.89
13	600211	西藏药业	115,222,933.42	3.75
14	300144	宋城演艺	115,160,266.32	3.74
15	600718	东软集团	108,218,670.28	3.52
16	300224	正海磁材	106,808,444.05	3.47
17	600233	大杨创世	102,190,123.61	3.32
18	002468	艾迪西	100,300,488.82	3.26
19	000881	大连国际	95,986,453.52	3.12
20	600261	阳光照明	95,857,113.38	3.12
21	001979	招商蛇口	95,680,394.53	3.11
22	600373	中文传媒	94,330,213.49	3.07

23	600217	中再资环	91,302,600.14	2.97
24	002120	新海股份	86,834,446.92	2.82
25	002308	威创股份	85,703,987.64	2.79
26	600141	兴发集团	83,474,291.12	2.71
27	600498	烽火通信	83,269,312.07	2.71
28	600038	中直股份	82,804,747.68	2.69
29	600547	山东黄金	82,746,790.09	2.69
30	002597	金禾实业	81,460,748.50	2.65
31	300364	中文在线	80,690,444.88	2.62
32	002640	跨境通	80,372,123.42	2.61
33	600887	伊利股份	79,339,395.29	2.58
34	002009	天奇股份	77,771,320.22	2.53
35	601799	星宇股份	76,199,674.25	2.48
36	002250	联化科技	75,041,312.31	2.44
37	300047	天源迪科	74,866,588.57	2.43
38	002267	陕天然气	74,670,452.11	2.43
39	600458	时代新材	74,458,816.56	2.42
40	600138	中青旅	74,307,496.01	2.42
41	002117	东港股份	73,844,292.35	2.40
42	000895	双汇发展	73,372,311.71	2.39
43	600990	四创电子	70,656,981.35	2.30
44	000802	北京文化	65,544,118.44	2.13
45	002675	东诚药业	65,463,620.45	2.13
46	000403	ST 生化	65,395,983.89	2.13
47	002294	信立泰	64,974,776.18	2.11
48	300090	盛运环保	62,958,018.40	2.05
49	000338	潍柴动力	61,582,119.05	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	002013	中航机电	164,230,155.65	5.34
2	600718	东软集团	163,789,465.02	5.33
3	600420	现代制药	158,365,495.62	5.15

4	600217	中再资环	153,447,345.69	4.99
5	600500	中化国际	141,042,488.83	4.59
6	600233	大杨创世	137,271,556.12	4.46
7	002281	光迅科技	130,970,599.20	4.26
8	002557	洽洽食品	122,085,866.62	3.97
9	000895	双汇发展	121,618,110.22	3.95
10	601799	星宇股份	121,046,267.22	3.94
11	600138	中青旅	120,618,399.56	3.92
12	000910	大亚圣象	115,365,081.48	3.75
13	600683	京投发展	115,281,974.78	3.75
14	002039	黔源电力	114,241,857.18	3.71
15	300059	东方财富	112,213,450.30	3.65
16	002468	艾迪西	105,473,243.18	3.43
17	300090	盛运环保	101,275,553.88	3.29
18	000881	大连国际	97,536,546.21	3.17
19	001979	招商蛇口	97,101,907.54	3.16
20	600373	中文传媒	95,940,179.38	3.12
21	600547	山东黄金	93,869,754.40	3.05
22	600141	兴发集团	92,577,410.60	3.01
23	600038	中直股份	92,349,070.08	3.00
24	002007	华兰生物	90,483,383.23	2.94
25	002597	金禾实业	90,063,830.78	2.93
26	300364	中文在线	86,604,397.51	2.82
27	300047	天源迪科	84,281,808.18	2.74
28	002675	东诚药业	79,737,517.90	2.59
29	300133	华策影视	78,173,932.63	2.54
30	002009	天奇股份	76,695,009.00	2.49
31	000403	ST 生化	76,363,539.22	2.48
32	002267	陕天然气	76,079,129.82	2.47
33	600211	西藏药业	75,793,082.39	2.46
34	000802	北京文化	74,846,081.27	2.43
35	002264	新华都	73,935,093.09	2.40
36	000338	潍柴动力	73,837,022.59	2.40
37	600990	四创电子	72,309,743.62	2.35
38	000078	海王生物	70,149,030.44	2.28
39	002082	栋梁新材	67,592,921.35	2.20
40	002294	信立泰	67,026,790.34	2.18
41	002142	宁波银行	66,241,397.51	2.15

42	600887	伊利股份	64,206,231.52	2.09
43	300394	天孚通信	63,401,616.83	2.06
44	002317	众生药业	63,164,099.13	2.05

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	8,812,107,346.64
卖出股票收入（成交）总额	8,338,816,169.69

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	618,580,262.50	17.82
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	99,955,000.00	2.88
	其中：政策性金融债	99,955,000.00	2.88
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	869.68	0.00
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	718,536,132.18	20.69

### 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	019533	16 国债 05	5,870,000	587,000,000.00	16.91
2	070215	07 国开 15	500,000	50,295,000.00	1.45
3	130216	13 国开 16	500,000	49,660,000.00	1.43
4	010107	21 国债(7)	300,050	31,580,262.50	0.91
5	123001	蓝标转债	8	869.68	0.00

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,708,393.78
2	应收证券清算款	79,038,275.44

3	应收股利	-
4	应收利息	12,959,515.87
5	应收申购款	25,277,450.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,983,635.72

#### 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	123001	蓝标转债	894.68	0.07

#### 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	000513	丽珠集团	31,662,000.00	0.91	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

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
151,437	22,962.73	890,125,334.20	25.60%	2,587,281,027.74	74.40%

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	41,962.22	0.0012%

持有本基金		
-------	--	--

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002年11月11日）基金份额总额	2,604,752,899.89
本报告期期初基金份额总额	2,309,211,183.72
本报告期基金总申购份额	2,005,403,937.80
减:本报告期基金总赎回份额	837,208,759.58
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	3,477,406,361.94

## § 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：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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 15 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	24	266,485,277.98	24.95%	3,888,097.51	24.94%	-
中信建投	22	153,742,566.71	12.59%	1,962,756.86	12.59%	-
中泰证券	11	1,047,816,814.06	6.13%	954,875.73	6.12%	-
招商证券	2	868,124,613.55	5.08%	791,131.39	5.07%	-
中金公司	3	808,967,877.03	4.73%	741,667.12	4.76%	-
申银万国	1	788,099,065.35	4.61%	718,171.97	4.61%	-
联讯证券	1	777,358,489.09	4.55%	708,415.24	4.54%	-
中信证券	2	755,595,094.58	4.42%	688,568.28	4.42%	-
海通证券	1	665,018,595.54	3.89%	606,029.14	3.89%	-



华泰证券	1	653,782,824.69	3.82%	595,816.34	3.82%	-
兴业证券	2	572,034,282.57	3.35%	521,277.61	3.34%	-
国泰君安	2	497,514,549.73	2.91%	453,391.29	2.91%	-
银河证券	4	474,766,134.81	2.78%	432,654.51	2.77%	-
华创证券	1	400,658,846.85	2.34%	365,125.15	2.34%	-
瑞银证券	1	305,896,942.57	1.79%	278,766.43	1.79%	-
平安证券	1	302,395,761.62	1.77%	279,153.43	1.79%	-
安信证券	1	277,808,643.54	1.62%	253,163.92	1.62%	-
万和证券	1	266,716,950.26	1.56%	243,080.02	1.56%	-
国金证券	2	225,203,964.50	1.32%	205,223.27	1.32%	-
民生证券	1	198,357,719.57	1.16%	180,764.95	1.16%	-
广发证券	2	195,274,650.97	1.14%	177,981.32	1.14%	-
上海证券	1	162,105,301.52	0.95%	147,711.68	0.95%	-
中银国际	2	127,326,966.96	0.74%	116,038.14	0.74%	-
北京高华	1	114,082,302.02	0.67%	103,963.97	0.67%	-
东吴证券	1	107,411,743.36	0.63%	97,902.83	0.63%	-
国信证券	1	87,946,326.80	0.51%	80,144.03	0.51%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-

山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：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。

本报告期内增加基金交易单元：爱建证券、东方证券、中原证券、中金公司、广发证券、东吴证券、万和证券。本报告期内本基金退租席位：无。

### 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	144,916,316.49	12.84%	342,000,000.00	9.58%	-	0.00%
中信建投	121,697,166.27	10.78%	250,000,000.00	7.00%	-	0.00%
中泰证券	164,369,926.39	14.56%	150,000,000.00	4.20%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	150,000,000.00	4.20%	-	0.00%
申银万国	91,362,235.21	8.09%	310,000,000.00	8.68%	-	0.00%
联讯证券	15,067,340.20	1.33%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	173,751,693.20	15.39%	400,000,000.00	11.20%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	11,165,249.43	0.99%	150,000,000.00	4.20%	-	0.00%

国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	4,519,303.40	0.40%	500,000,000.00	14.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	24,000,000.00	0.67%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	50,000,000.00	1.40%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	535,000,000.00	14.98%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万和证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	242,924,919.22	21.52%	300,000,000.00	8.40%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	-	0.00%	100,000,000.00	2.80%	-	0.00%
中银国际	158,941,296.77	14.08%	160,000,000.00	4.48%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	100,000,000.00	2.80%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	50,000,000.00	1.40%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
第一创业	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
川财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
爱建证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中原证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申万宏源	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
山西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

## § 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