

大成互联网思维混合型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 24 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。本半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 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成互联网思维混合
基金主代码	001144
交易代码	001144
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 21 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	1,744,605,615.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	捕捉互联网技术与思维向实体经济与金融各领域渗透的过程中各个行业出现的投资机会，为投资者提供分享互联网技术与思维带动经济发展与企业盈利增长的红利，力争通过积极主动投资管理实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	中高风险

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	75,647,945.79
本期利润	195,248,979.08
加权平均基金份额本期利润	0.1064
本期基金份额净值增长率	14.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2410
期末基金资产净值	1,458,623,149.87
期末基金份额净值	0.836

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。

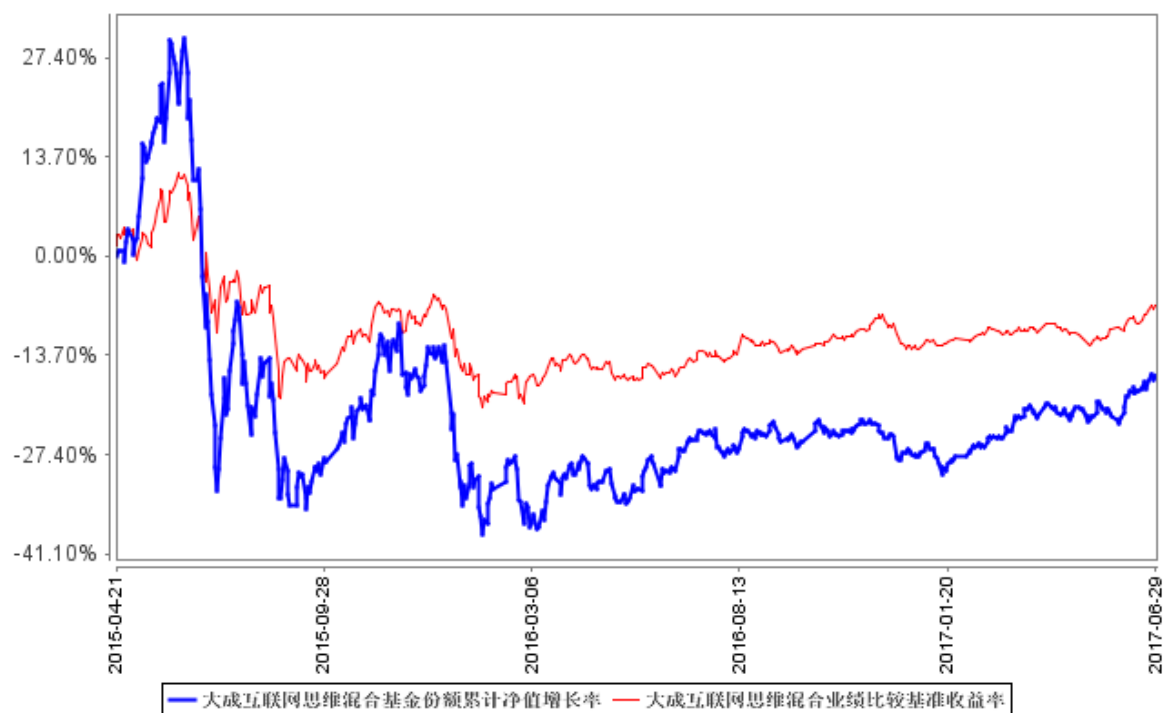
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	7.87%	0.82%	3.41%	0.40%	4.46%	0.42%
过去三个月	7.04%	0.78%	3.75%	0.38%	3.29%	0.40%
过去六个月	14.68%	0.77%	6.43%	0.34%	8.25%	0.43%
过去一年	14.21%	0.80%	9.89%	0.41%	4.32%	0.39%
自基金合同生效起至今	-16.40%	2.22%	-6.87%	1.10%	-9.53%	1.12%

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



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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 6 月 30 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 74 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		
李博先生	本基金基金经理	2015 年 4 月 21 日	-	7 年	工学硕士，2009 年 9 月至 2010 年 8 月就职于韩国 SK Telecom 首尔总部；2010 年 8 月至 2011 年 5 月就职于国信证券任研究员；2011 年 5 月起加入大成基金管理有限公司，历任大成基金电子行业、互联网传媒行业分析师、基金经理助理，2014 年 10 月 28 日至 2015 年 4 月 20 日担任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理助理。2015 年 4 月 21 日起担任大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。

					2016 年 11 月 4 日起担任大成精选增值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
张焯女士	本基金基金经理助理	2015 年 4 月 21 日	-	7 年	经济学硕士。2011 年 9 月加入大成基金管理有限公司。2015 年 4 月 21 日起担任大成互联网思维混合型证券投资基金的基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 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 6 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

回顾上半年，川普政策推动面临多层阻力，美国整体经济表现无亮点，在加息落地以后，美元走弱，人民币汇率相对强势；而欧元区景气度回升明显，后续关注海外流动性变化。从国内经济的基本面来看，产业链过度乐观预期得到修正，大宗价格延续了 3 月份的调整，但需求整体不弱。三四线地产景气度持续性成为重要观察指标。国内政策层面，二季度开始，一行三会步调统一，连续多次发文加强金融监管，影响较大的涉及理财委外、券商资管资金池业务等，曾引发大额委外的赎回，造成市场流动性的部分压力。整体来看，经济总体尚属比较平稳，叠加海外特朗普交易的减弱流动性也基本保持平稳，监管的节奏也存在一定协调性。

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 0.836 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.68%，业绩比较基准收益率为 6.43%。

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 年下半年，在 PMI 数据等仍然向好的情况下由于市场普遍预期地产基建产业链景气度下行，未来经济的走势仍然值得关注。流动性方面，欧元区景气度回升明显，加上近期 ECB 鹰派言论，汇率强势，利率飙升，各国央行态度是否边际变化持续关注；国内政策层面，流动性的松紧适度预期仍然是大方向，监管措施的出台和协调在三季度仍待持续推进。在经济波动减弱的情况下，我们下半年将一如既往的坚持以严选企业基本面和自下而上选股为主。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核

部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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”）在对大成互联网思维证券投资基金（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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成互联网思维混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	76,138,053.62	215,037,966.34
结算备付金	55,338,357.25	41,772,413.01
存出保证金	3,455,613.16	12,655,728.99
交易性金融资产	1,329,958,989.23	1,127,014,803.88
其中：股票投资	1,329,958,989.23	1,127,014,803.88
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	-	-
应收证券清算款	342,400.93	113,750.87
应收利息	17,703.08	46,011.45
应收股利	-	-
应收申购款	12,888.05	56,398.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,465,264,005.32	1,396,697,073.48
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 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	1,411,049.50	-
应付赎回款	2,221,382.26	478,161.00
应付管理人报酬	1,763,051.82	1,798,490.16
应付托管费	293,841.96	299,748.35
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	748,058.74	1,081,846.76

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	203,471.17	210,185.00
负债合计	6,640,855.45	3,868,431.27
所有者权益：		
实收基金	1,744,605,615.13	1,910,933,690.24
未分配利润	-285,982,465.26	-518,105,048.03
所有者权益合计	1,458,623,149.87	1,392,828,642.21
负债和所有者权益总计	1,465,264,005.32	1,396,697,073.48

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.836 元，基金份额总额 1,744,605,615.13 份。

6.2 利润表

会计主体：大成互联网思维混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	210,215,756.51	-246,498,741.64
1.利息收入	1,093,794.08	1,128,679.82
其中：存款利息收入	1,093,794.08	1,128,679.82
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）	89,420,798.84	-226,287,576.85
其中：股票投资收益	74,317,752.40	-230,192,465.96
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	6,393,680.00	-
股利收益	8,709,366.44	3,904,889.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	119,601,033.29	-21,621,546.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	100,130.30	281,701.94
减：二、费用	14,966,777.43	19,413,407.32

1. 管理人报酬	10,499,763.60	11,108,607.72
2. 托管费	1,749,960.65	1,851,434.53
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,500,571.30	6,234,945.18
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	216,481.88	218,419.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	195,248,979.08	-265,912,148.96
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	195,248,979.08	-265,912,148.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成互联网思维混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,910,933,690.24	-518,105,048.03	1,392,828,642.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	195,248,979.08	195,248,979.08
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）	-166,328,075.11	36,873,603.69	-129,454,471.42
其中：1.基金申购款	24,400,129.29	-5,577,645.76	18,822,483.53
2.基金赎回款	-190,728,204.40	42,451,249.45	-148,276,954.95
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）	1,744,605,615.13	-285,982,465.26	1,458,623,149.87
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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)	2,153,015,486.10	-311,680,861.05	1,841,334,625.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-265,912,148.96	-265,912,148.96
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)	-62,875,989.22	17,588,080.26	-45,287,908.96
其中：1.基金申购款	127,921,523.87	-40,332,949.98	87,588,573.89
2.基金赎回款	-190,797,513.09	57,921,030.24	-132,876,482.85
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)	2,090,139,496.88	-560,004,929.75	1,530,134,567.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	121,831,899.92	7.32%	160,971,179.64	3.88%
------	----------------	-------	----------------	-------

6.4.4.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.4.1.4 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.4.1.5 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6月30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	111,032.05	7.32%	7,440.91	0.99%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	146,696.05	3.88%	-	0.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,499,763.60	11,108,607.72
其中：支付销售机构的客户维护费	4,134,573.44	4,301,318.18

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。

6.4.4.2.2 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6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,749,960.65	1,851,434.53

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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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	76,138,053.62	631,473.83	160,811,409.52	1,090,993.45

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.5.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002127	南极电商	2017年6月29日	临时停牌	12.08	2017年7月6日	12.61	2,968,430	35,528,454.35	35,858,634.40	-
300364	中文在线	2017年2月13日	临时停牌	33.42	-	-	599,027	30,126,961.66	20,019,482.34	-
300461	田中精机	2017年5月10日	临时停牌	64.65	-	-	231,895	15,042,293.88	14,992,011.75	-
300104	乐视网	2017年4月17日	临时停牌	28.63	-	-	220,000	6,851,089.31	6,298,600.00	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	临时停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

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。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.5.3.2 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,329,958,989.23	90.77
	其中：股票	1,329,958,989.23	90.77
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	131,476,410.87	8.97
7	其他各项资产	3,828,605.22	0.26
8	合计	1,465,264,005.32	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	29,924,349.00	2.05
C	制造业	760,055,632.02	52.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	37,723,204.68	2.59
F	批发和零售业	60,742,025.03	4.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,124,214.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,561,477.66	6.48
J	金融业	29,095,687.04	1.99
K	房地产业	41,883,249.84	2.87
L	租赁和商务服务业	49,116,760.36	3.37
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	2,508,098.48	0.17

0	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	60,323,533.00	4.14
R	文化、体育和娱乐业	162,900,758.12	11.17
S	综合	-	0.00
	合计	1,329,958,989.23	91.18

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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	300144	宋城演艺	5,395,189	112,597,594.43	7.72
2	300072	三聚环保	2,948,096	109,226,956.80	7.49
3	002050	三花智控	5,397,000	88,079,040.00	6.04
4	002044	美年健康	3,476,816	59,105,872.00	4.05
5	002640	跨境通	2,730,111	58,014,858.75	3.98
6	002236	大华股份	2,193,870	50,042,174.70	3.43
7	002434	万里扬	2,954,518	47,035,926.56	3.22
8	002555	三七互娱	1,797,532	45,962,893.24	3.15
9	000063	中兴通讯	1,777,300	42,193,102.00	2.89
10	000661	长春高新	321,020	41,446,892.20	2.84

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>）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000661	长春高新	36,751,920.99	2.64
2	002127	南极电商	35,528,454.35	2.55
3	600340	华夏幸福	35,176,540.85	2.53
4	300156	神雾环保	33,038,765.86	2.37
5	002050	三花智控	31,369,567.49	2.25

6	000063	中兴通讯	31,016,903.98	2.23
7	603040	新坐标	30,008,348.93	2.15
8	600887	伊利股份	29,158,306.00	2.09
9	000568	泸州老窖	28,807,757.26	2.07
10	002430	杭氧股份	26,705,233.33	1.92
11	300180	华峰超纤	25,678,860.95	1.84
12	002601	龙鳞佰利	22,462,390.61	1.61
13	002415	海康威视	22,168,082.71	1.59
14	300116	坚瑞沃能	21,912,916.47	1.57
15	300059	东方财富	21,782,606.00	1.56
16	000858	五粮液	21,363,765.00	1.53
17	601888	中国国旅	18,275,106.51	1.31
18	300144	宋城演艺	18,140,276.28	1.30
19	603737	三棵树	17,449,654.87	1.25
20	603556	海兴电力	16,081,833.64	1.15

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。

7.4.2 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	300072	三聚环保	66,636,798.93	4.78
2	002281	光迅科技	49,258,568.68	3.54
3	000596	古井贡酒	47,725,412.34	3.43
4	002258	利尔化学	38,453,452.42	2.76
5	002078	太阳纸业	36,103,124.78	2.59
6	300447	全信股份	30,181,623.26	2.17
7	000063	中兴通讯	28,191,183.28	2.02
8	000925	众合科技	26,374,447.63	1.89
9	300017	网宿科技	24,778,654.16	1.78
10	600340	华夏幸福	23,311,867.82	1.67
11	002601	龙鳞佰利	23,308,059.92	1.67
12	600547	山东黄金	21,872,210.35	1.57
13	600028	中国石化	21,215,865.54	1.52
14	002434	万里扬	19,446,410.86	1.40
15	600500	中化国际	19,235,013.27	1.38

16	300116	坚瑞沃能	19,213,905.84	1.38
17	002555	三七互娱	18,528,338.56	1.33
18	002236	大华股份	18,080,426.38	1.30
19	002044	美年健康	17,705,912.80	1.27
20	000565	渝三峡 A	16,243,504.12	1.17

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。

7.4.3 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	838,906,986.19
卖出股票收入（成交）总额	830,401,066.53

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1712	IC1712	13	15,368,080.00	354,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					354,720.00
股指期货投资本期收益（元）					6,393,680.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-519,480.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部平仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券之一美年健康，于 2016 年 7 月 26 日收到中华人民共和国商务部反垄断局（以下简称“商务部反垄断局”）出具的《涉嫌未依法申报经营者集中立案调查通知》。本基金认为，对美年健康的处罚及调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,455,613.16
2	应收证券清算款	342,400.93
3	应收股利	-
4	应收利息	17,703.08
5	应收申购款	12,888.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	3,828,605.22

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
33,313	52,370.11	8,743,660.94	0.50%	1,735,861,954.19	99.50%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,613.25	0.0001%

8.3 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月21日）基金份额总额	3,473,268,132.40
本报告期期初基金份额总额	1,910,933,690.24
本报告期基金总申购份额	24,400,129.29
减：本报告期基金总赎回份额	190,728,204.40
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	1,744,605,615.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

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，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履职的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	227,664,959.08	13.67%	207,480.03	13.67%	-
中信建投	1	226,606,440.97	13.61%	206,507.37	13.61%	-
方正证券	1	196,570,443.99	11.81%	179,143.80	11.81%	-
安信证券	2	152,096,900.46	9.13%	138,626.68	9.14%	-
西南证券	1	142,229,657.59	8.54%	129,617.39	8.54%	-
光大证券	2	121,831,899.92	7.32%	111,032.05	7.32%	-
广发证券	1	115,968,282.93	6.96%	105,684.49	6.96%	-
华林证券	1	100,505,327.77	6.04%	91,594.14	6.04%	-
国泰君安	1	78,631,974.54	4.72%	71,653.00	4.72%	-
国信证券	1	74,468,380.25	4.47%	67,886.26	4.47%	-
中金公司	2	43,596,847.69	2.62%	39,728.43	2.62%	-
东莞证券	1	39,569,110.03	2.38%	36,056.73	2.38%	-
长江证券	1	37,272,510.74	2.24%	33,964.23	2.24%	-
渤海证券	2	35,770,729.57	2.15%	32,599.44	2.15%	-
中航证券	1	25,829,763.13	1.55%	23,538.48	1.55%	-
恒泰证券	1	16,152,721.20	0.97%	14,717.41	0.97%	-
东方证券	1	15,298,051.26	0.92%	13,945.59	0.92%	-
中信证券	2	15,050,453.46	0.90%	13,715.50	0.90%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
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%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	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%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：无。

本报告期内退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

无。

11.2 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

2017 年 8 月 24 日