

大成动态量化配置策略混合型证券投资基金  
2017 年半年度报告  
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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国农业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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
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.....	53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金
基金简称	大成动态量化配置混合
基金主代码	003147
交易代码	003147
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	258,898,993.62 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道	北京市西城区复兴门内大街 28

	7088 号招商银行大厦 32 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

### §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	-1,703,545.03
本期利润	3,482,088.50
加权平均基金份额本期利润	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.14%
本期基金份额净值增长率	0.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-6,200,042.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0239
期末基金资产净值	252,698,951.55
期末基金份额净值	0.9761
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-2.39%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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	5.00%	0.62%	3.10%	0.34%	1.90%	0.28%
过去三个月	-2.40%	0.71%	3.15%	0.32%	-5.55%	0.39%
过去六个月	0.45%	0.60%	5.24%	0.30%	-4.79%	0.30%
自基金合同生效起至今	-2.39%	0.52%	5.36%	0.33%	-7.75%	0.19%



### 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		
黎新平先生	本基金基金经理，数量与指数投资部总监	2016年9月20日	-	9年	经济学博士。2008年7月至2015年6月历任Aristeia capital 量化投资部资深策略师、投资经理。2015年7月加入大成基金管理有限公司，现任数量与指数投资部总监。自2016年9月20日起担任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。自2017年3月18日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合

同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 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

二季度，随着金融去杠杆及金融监管的进一步加强，市场呈现较为明显的分化格局。从 3 月 31 日到 6 月 30 日，上证 50 上涨 8.66%，沪深 300 上涨 6.69%，中证 500 下跌 3.73%，创业板下跌 3.99%，以上证 50 为代表的大盘权重股成为稳定市场的主要力量，并与中小市值及创业板股票形成明显的分化。从行业看，家电、食品饮料、非银金融及银行表现了较大的涨幅，而国防军工、农林牧渔、机械等行业指数则下跌幅度超过 10%。因子表现上，二季度也主要集中于大盘、低市盈率及业绩质量等因子上，小市值及成长类因子在二季度有着较大的回撤。随着 6 月份减持新规、IPO 放缓、金融去杠杆边际放缓、A 股纳入 MSCI 等一系列政策面或事件性的利好所驱动，市场分化的格局在 6 月份季末得到一定的缓和。中小盘及成长类股票在 6 月份表现了一定的反弹，但其反弹持续的程度和幅度还需进一步交易活跃度和市场信心的支撑。

大成动态量化在报告期主要以估值、盈利、质量等基本面因子作为主要的选股因子，并注意

控制高估值、小市值等风险因子的暴露。但由于股票组合在行业和大小市值分布上维持了较为均衡的配置，在 4、5 月份市场极端分化的格局中也受到一定的回撤影响。

#### 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 0.9761 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.45%，业绩比较基准收益率为 5.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从六月份的市场表现看，前期市场大小盘极端分化的格局已经有明显的缓和及调整。然而中小盘及创业板的交易活跃程度尚未形成充分的支撑，资金仍然更愿意进入基本面扎实、人气热度较足的龙头股票。因而，市场分化格局的修正调整能否延续还需进一步观察，但基本面和低估值仍然会是后市操作一个重要的考量因素。同时，流动性方面，六月份整体比预期宽松，但考虑到七月份的资金回笼及金融去杠杆的延续，反可能出现流动性相对预期偏紧的状态，市场波动有可能增大。因而在选股策略上，仍然会继续偏向估值、质量、盈利、流动性等相关因子，注意在中等市值的股票中寻找估值和基本面得以支撑的绩优股，并控制小市值及高估值的暴露。

#### 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**

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

#### **4.8 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成动态量化配置策略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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	13,413,516.70	13,282,789.55
结算备付金		5,562,683.37	21,149,633.45
存出保证金		4,695,025.58	2,700,504.54
交易性金融资产	6.4.3.2	199,984,257.67	253,888,348.53
其中：股票投资		180,950,061.27	179,070,568.53
基金投资		-	-
债券投资		19,034,196.40	74,817,780.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	28,800,000.00	72,000,000.00
应收证券清算款		1,474,146.30	-
应收利息	6.4.3.5	113,061.75	575,747.14
应收股利		-	-
应收申购款		711.91	31,064.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		254,043,403.28	363,628,087.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		559,409.21	4,207.68
应付管理人报酬		247,069.93	374,921.43
应付托管费		51,472.91	78,108.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	305,872.89	413,027.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	180,626.79	85,010.43
负债合计		1,344,451.73	955,275.95
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	258,898,993.62	373,233,229.95
未分配利润	6.4.3.10	-6,200,042.07	-10,560,417.93
所有者权益合计		252,698,951.55	362,672,812.02
负债和所有者权益总计		254,043,403.28	363,628,087.97

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9761 元，基金份额总额 258,898,993.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,867,310.82
1.利息收入		1,536,503.84
其中：存款利息收入	6.4.3.11	79,740.94
债券利息收入		889,235.31
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		567,527.59
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-50,082.59
其中：股票投资收益	6.4.3.12	849,614.10
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.3.13	-2,710,773.70
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-58,360.00
股利收益	6.4.3.16	1,869,437.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	5,185,633.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	195,256.04
<b>减：二、费用</b>		3,385,222.32
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,828,190.69
2. 托管费	6.4.6.2.2	380,873.09
3. 销售服务费		-



4. 交易费用	6.4.3.18	982,152.58
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.3.19	194,005.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,482,088.50</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,482,088.50</b>

注：本基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，截止报告期末本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成动态量化配置策略混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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)	373,233,229.95	-10,560,417.93	362,672,812.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,482,088.50	3,482,088.50
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)	-114,334,236.33	878,287.36	-113,455,948.97
其中：1.基金申购款	2,336,364.22	-64,068.30	2,272,295.92
2.基金赎回款	-116,670,600.55	942,355.66	-115,728,244.89
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)	258,898,993.62	-6,200,042.07	252,698,951.55

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 重要会计政策和会计估计

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[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) 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。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	13,413,516.70

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	13,413,516.70

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	181,615,262.40	180,950,061.27	-665,201.13
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	306,047.50	286,196.40
	银行间市场	19,725,840.00	18,748,000.00
	合计	20,031,887.50	19,034,196.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	201,647,149.90	199,984,257.67	-1,662,892.23

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-21,721,620.00	-	-	
股指期货	-21,721,620.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-21,721,620.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	28,800,000.00	—
合计	28,800,000.00	—

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,142.24
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	234.45
应收债券利息	87,614.47
应收买入返售证券利息	23,019.38
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	51.21
合计	113,061.75

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	305,647.89
银行间市场应付交易费用	225.00
合计	305,872.89

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,108.30
预提费用	178,518.49
预提审计费	-
预提信息披露费	-
合计	180,626.79

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	373,233,229.95	373,233,229.95
本期申购	2,336,364.22	2,336,364.22
本期赎回(以“-”号填列)	-116,670,600.55	-116,670,600.55
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	258,898,993.62	258,898,993.62

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,993,965.46	-6,566,452.47	-10,560,417.93
本期利润	-1,703,545.03	5,185,633.53	3,482,088.50
本期基金份额交易产生的变动数	389,639.86	488,647.50	878,287.36
其中：基金申购款	-19,674.87	-44,393.43	-64,068.30
基金赎回款	409,314.73	533,040.93	942,355.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,307,870.63	-892,171.44	-6,200,042.07

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	63,431.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,672.60
其他	1,637.12
合计	79,740.94

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	326,535,821.17
减：卖出股票成本总额	325,686,207.07
买卖股票差价收入	849,614.10

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	70,352,449.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	72,197,097.94
减：应收利息总额	866,125.72
买卖债券差价收入	-2,710,773.70

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-58,360.00

**6.4.3.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,869,437.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,869,437.01

**6.4.3.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,163,093.53
——股票投资	4,741,579.19
——债券投资	421,514.34
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	22,540.00
合计	5,185,633.53

**6.4.3.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	190,391.60
转换费收入	4,864.44
合计	195,256.04

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.3.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	981,927.58
银行间市场交易费用	225.00
合计	982,152.58

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
其他	100.00
银行划款手续费	7,887.47
中债登债券托管帐户维护费	7,500.00
合计	194,005.96

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业



注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	124,888,583.69	19.35%

##### 6.4.6.1.2 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。

##### 6.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
光大证券	87,000,000.00	11.56%

##### 6.4.6.1.4 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。

##### 6.4.6.1.5 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	113,812.60	19.35%	42,601.94	13.94%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，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。

**6.4.6.2 关联方报酬****6.4.6.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,828,190.69
其中：支付销售机构的客户维护费	702,575.32

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 1.2% 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 × 1.20% / 当年天数。

**6.4.6.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	380,873.09

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。

**6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.6.4.2 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**

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	13,413,516.70	63,431.22

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。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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	-

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。

#### 6.4.8.2 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
601088	中国神华	2017年6月5日	临时停牌	22.29	-	-	75,200	1,300,871.83	1,676,208.00	-
601069	西部黄金	2017年4月18日	临时停牌	26.26	-	-	63,400	1,382,935.75	1,664,884.00	-
000034	神州数码	2017年3月21日	临时停牌	24.45	2017年7月18日	22.01	67,800	1,606,316.08	1,657,710.00	-
000153	丰原药业	2017年1月16日	临时停牌	12.52	2017年7月12日	11.27	106,300	1,378,113.00	1,330,876.00	-
300085	银之	2017年6	临时	18.50	2017年7	18.88	39,570	716,125.40	732,045.00	-

	杰	月 30	停		月 7					
		日	牌		日					

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 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。

##### 6.4.8.3.2 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。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具、银行存款、国债期货、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.11%。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通

过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,413,516.70	-	-	-	13,413,516.70
结算备付金	5,562,683.37	-	-	-	5,562,683.37
存出保证金	4,695,025.58	-	-	-	4,695,025.58
交易性金融 资产	286,196.40	-	18,748,000.00	180,950,061.27	199,984,257.67
买入返售金 融资产	28,800,000.00	-	-	-	28,800,000.00
应收证券清 算款	-	-	-	1,474,146.30	1,474,146.30

应收利息	-	-	-	113,061.75	113,061.75
应收申购款	-	-	-	711.91	711.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,757,422.05	-	18,748,000.00	182,537,981.23	254,043,403.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	559,409.21	559,409.21
应付管理人报酬	-	-	-	247,069.93	247,069.93
应付托管费	-	-	-	51,472.91	51,472.91
应付交易费用	-	-	-	305,872.89	305,872.89
其他负债	-	-	-	180,626.79	180,626.79
负债总计	-	-	-	1,344,451.73	1,344,451.73
利率敏感度缺口	52,757,422.05	-	18,748,000.00	181,193,529.50	252,698,951.55
上年度末 2016年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,282,789.55	-	-	-	13,282,789.55
结算备付金	21,149,633.45	-	-	-	21,149,633.45
存出保证金	2,700,504.54	-	-	-	2,700,504.54
交易性金融资产	-7,822,780.00	66,995,000.00	179,070,568.53	-	253,888,348.53
买入返售金融资产	72,000,000.00	-	-	-	72,000,000.00
应收利息	-	-	-	575,747.14	575,747.14
应收申购款	-	-	-	31,064.76	31,064.76
资产总计	109,132,927.54	7,822,780.00	66,995,000.00	179,677,380.43	363,628,087.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,207.68	4,207.68
应付管理人报酬	-	-	-	374,921.43	374,921.43
应付托管费	-	-	-	78,108.64	78,108.64
应付交易费用	-	-	-	413,027.77	413,027.77
其他负债	-	-	-	85,010.43	85,010.43
负债总计	-	-	-	955,275.95	955,275.95
利率敏感度缺口	109,132,927.54	7,822,780.00	66,995,000.00	178,722,104.48	362,672,812.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。



**6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	38,410,000.00	1,380,000.00
2. 市场利率上升 25 个基点	-37,530,000.00	-1,350,000.00	

**6.4.9.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.9.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票等权益类资产占基金资产的比例不低于 10%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	180,950,061.27	71.61	179,070,568.53	49.38
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	180,950,061.27	71.61	179,070,568.53	49.38

注：其他包含股指期货投资，于 2017 年 6 月 30 日，持仓数量为 20 手，合约市值为 21,755,400.00 (附注 6.4.3.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货投资与相关的期货暂收款 (结算所得的持仓损益) 之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准 (附注 7.4.1) 以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2017 年 6 月 30 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	17,590,000.00	23,220,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-17,590,000.00	-23,220,000.00	

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间 (含到期) 取得的非保本收益 (合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程

中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## §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	180,950,061.27	71.23
	其中：股票	180,950,061.27	71.23
2	固定收益投资	19,034,196.40	7.49
	其中：债券	19,034,196.40	7.49
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	28,800,000.00	11.34
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,976,200.07	7.47
7	其他各项资产	6,282,945.54	2.47
8	合计	254,043,403.28	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	3,149,881.84	1.25
B	采矿业	11,171,581.00	4.42
C	制造业	99,816,534.36	39.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,675,199.60	2.64
E	建筑业	2,964,269.00	1.17
F	批发和零售业	5,715,864.40	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	12,476,339.00	4.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,206,733.07	4.43
J	金融业	15,246,642.00	6.03
K	房地产业	9,417,465.00	3.73
L	租赁和商务服务业	1,989,552.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	1,120,000.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	180,950,061.27	71.61

### 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所有股票投资明细

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	002648	卫星石化	245,400	4,049,100.00	1.60
2	000036	华联控股	428,100	3,895,710.00	1.54
3	600742	一汽富维	178,600	3,413,046.00	1.35
4	300072	三聚环保	80,800	2,993,640.00	1.18
5	601636	旗滨集团	661,300	2,982,463.00	1.18
6	600133	东湖高新	309,100	2,964,269.00	1.17
7	000625	长安汽车	205,000	2,956,100.00	1.17
8	000726	鲁泰A	242,400	2,874,864.00	1.14
9	000997	新大陆	125,500	2,847,595.00	1.13
10	600309	万华化学	97,000	2,778,080.00	1.10
11	600338	西藏珠峰	72,500	2,754,275.00	1.09
12	000627	天茂集团	340,100	2,748,008.00	1.09
13	603816	顾家家居	46,500	2,733,270.00	1.08
14	300497	富祥股份	50,124	2,646,045.96	1.05
15	002714	牧原股份	96,922	2,638,216.84	1.04
16	002468	申通快递	101,500	2,579,115.00	1.02
17	000517	荣安地产	546,500	2,541,225.00	1.01
18	002174	游族网络	79,953	2,539,307.28	1.00
19	002110	三钢闽光	198,000	2,538,360.00	1.00
20	600688	上海石化	379,500	2,508,495.00	0.99
21	600507	方大特钢	290,300	2,476,259.00	0.98
22	600283	钱江水利	204,380	2,364,676.60	0.94
23	600282	南钢股份	627,600	2,328,396.00	0.92
24	600596	新安股份	272,300	2,300,935.00	0.91
25	002120	韵达股份	42,778	2,207,344.80	0.87
26	600641	万业企业	197,400	2,202,984.00	0.87
27	000717	韶钢松山	443,200	2,158,384.00	0.85
28	002352	顺丰控股	40,000	2,126,400.00	0.84
29	603518	维格娜丝	84,273	2,061,317.58	0.82

30	000698	沈阳化工	309,724	2,022,497.72	0.80
31	600508	上海能源	172,000	2,007,240.00	0.79
32	600415	小商品城	274,800	1,989,552.00	0.79
33	600741	华域汽车	80,700	1,956,168.00	0.77
34	601238	广汽集团	73,600	1,918,016.00	0.76
35	600461	洪城水业	254,700	1,836,387.00	0.73
36	601799	星宇股份	41,300	1,826,286.00	0.72
37	000906	浙商中拓	205,010	1,822,538.90	0.72
38	600303	曙光股份	175,500	1,793,610.00	0.71
39	603788	宁波高发	40,500	1,742,310.00	0.69
40	000900	现代投资	187,800	1,727,760.00	0.68
41	600016	民生银行	208,100	1,710,582.00	0.68
42	600020	中原高速	337,400	1,700,496.00	0.67
43	601088	中国神华	75,200	1,676,208.00	0.66
44	601069	西部黄金	63,400	1,664,884.00	0.66
45	000034	神州数码	67,800	1,657,710.00	0.66
46	600623	华谊集团	145,100	1,638,179.00	0.65
47	601166	兴业银行	96,900	1,633,734.00	0.65
48	601998	中信银行	256,800	1,615,272.00	0.64
49	600029	南方航空	183,500	1,596,450.00	0.63
50	600308	华泰股份	279,600	1,588,128.00	0.63
51	601988	中国银行	425,200	1,573,240.00	0.62
52	600115	东方航空	231,100	1,571,480.00	0.62
53	601328	交通银行	251,400	1,548,624.00	0.61
54	002035	华帝股份	63,200	1,529,440.00	0.61
55	601939	建设银行	247,800	1,523,970.00	0.60
56	600487	亨通光电	54,200	1,520,310.00	0.60
57	600028	中国石化	254,400	1,508,592.00	0.60
58	600694	大商股份	37,900	1,476,963.00	0.58
59	300115	长盈精密	50,400	1,470,672.00	0.58
60	601169	北京银行	159,300	1,460,781.00	0.58
61	000581	威孚高科	56,400	1,460,760.00	0.58
62	600221	海航控股	450,600	1,450,932.00	0.57
63	600926	杭州银行	96,460	1,432,431.00	0.57
64	600023	浙能电力	261,600	1,428,336.00	0.57
65	600060	海信电器	92,900	1,409,293.00	0.56
66	600362	江西铜业	82,600	1,392,636.00	0.55
67	000589	黔轮胎A	248,900	1,381,395.00	0.55
68	000708	大冶特钢	115,200	1,336,320.00	0.53

69	603585	苏利股份	38,700	1,333,215.00	0.53
70	000153	丰原药业	106,300	1,330,876.00	0.53
71	002718	友邦吊顶	22,800	1,328,100.00	0.53
72	600997	开滦股份	217,200	1,324,920.00	0.52
73	002777	久远银海	18,600	1,294,560.00	0.51
74	000521	美菱电器	198,800	1,272,320.00	0.50
75	300226	上海钢联	34,100	1,268,520.00	0.50
76	600689	上海三毛	91,500	1,267,275.00	0.50
77	000541	佛山照明	137,710	1,254,538.10	0.50
78	300196	长海股份	41,800	1,243,550.00	0.49
79	002014	永新股份	93,300	1,176,513.00	0.47
80	002662	京威股份	160,200	1,153,440.00	0.46
81	300133	华策影视	100,000	1,120,000.00	0.44
82	002597	金禾实业	49,900	1,090,814.00	0.43
83	600561	江西长运	114,000	1,057,920.00	0.42
84	600642	申能股份	166,000	1,045,800.00	0.41
85	300457	赢合科技	15,030	1,028,052.00	0.41
86	002203	海亮股份	112,800	918,192.00	0.36
87	600075	新疆天业	97,300	848,456.00	0.34
88	300082	奥克股份	118,700	819,030.00	0.32
89	000567	海德股份	29,700	777,546.00	0.31
90	002154	报喜鸟	208,100	772,051.00	0.31
91	000761	本钢板材	147,400	770,902.00	0.31
92	600306	商业城	54,800	753,500.00	0.30
93	300141	和顺电气	59,700	743,862.00	0.29
94	300085	银之杰	39,570	732,045.00	0.29
95	601633	长城汽车	54,600	725,634.00	0.29
96	300033	同花顺	11,500	715,415.00	0.28
97	002627	宜昌交运	34,000	625,260.00	0.25
98	600751	天海投资	108,900	619,641.00	0.25
99	300377	赢时胜	53,000	603,670.00	0.24
100	600489	中金黄金	54,500	546,635.00	0.22
101	601233	桐昆股份	38,700	536,382.00	0.21
102	002477	雏鹰农牧	115,500	511,665.00	0.20
103	601677	明泰铝业	36,974	504,325.36	0.20
104	600356	恒丰纸业	47,900	476,126.00	0.19
105	300146	汤臣倍健	32,800	450,672.00	0.18
106	002155	湖南黄金	47,000	449,790.00	0.18
107	002716	金贵银业	22,200	426,018.00	0.17

108	300258	精锻科技	25,600	422,656.00	0.17
109	300166	东方国信	30,719	412,556.17	0.16
110	300113	顺网科技	14,600	392,740.00	0.16
111	300288	朗玛信息	14,100	392,685.00	0.16
112	300160	秀强股份	43,700	391,989.00	0.16
113	600612	老凤祥	8,000	391,760.00	0.16
114	601678	滨化股份	55,600	386,420.00	0.15
115	600988	赤峰黄金	26,100	332,775.00	0.13
116	601899	紫金矿业	67,400	231,182.00	0.09
117	600459	贵研铂业	7,400	159,322.00	0.06
118	600531	豫光金铅	19,300	142,048.00	0.06
119	600891	秋林集团	14,800	115,292.00	0.05
120	000587	金洲慈航	6,200	92,380.00	0.04
121	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
122	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
123	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
124	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
125	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
126	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
127	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
128	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
129	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
130	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
131	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
132	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
133	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
134	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
135	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
136	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
137	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
138	603368	柳州医药	90	5,152.50	0.00

#### 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	600133	东湖高新	4,865,534.00	1.34
2	600057	象屿股份	4,119,438.19	1.14



3	000055	方大集团	4,104,964.00	1.13
4	000036	华联控股	3,831,234.54	1.06
5	603518	维格娜丝	3,819,080.31	1.05
6	002648	卫星石化	3,524,951.76	0.97
7	601636	旗滨集团	3,384,728.00	0.93
8	600508	上海能源	3,235,932.33	0.89
9	600641	万业企业	3,164,068.98	0.87
10	600415	小商品城	3,034,093.82	0.84
11	601677	明泰铝业	3,023,271.62	0.83
12	601998	中信银行	3,021,719.00	0.83
13	000625	长安汽车	3,009,982.00	0.83
14	300072	三聚环保	2,901,459.71	0.80
15	600319	亚星化学	2,823,179.00	0.78
16	600742	一汽富维	2,747,562.79	0.76
17	600547	山东黄金	2,731,202.00	0.75
18	300063	天龙集团	2,674,936.37	0.74
19	300497	富祥股份	2,630,541.56	0.73
20	002713	东易日盛	2,592,737.88	0.71

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	600547	山东黄金	4,755,507.72	1.31
2	002372	伟星新材	4,497,897.22	1.24
3	600057	象屿股份	3,621,030.30	1.00
4	600720	祁连山	3,440,660.87	0.95
5	600563	法拉电子	3,405,519.00	0.94
6	000055	方大集团	3,306,183.00	0.91
7	600197	伊力特	3,304,873.32	0.91
8	000921	海信科龙	3,247,732.51	0.90
9	600717	天津港	3,012,638.00	0.83
10	603968	醋化股份	3,007,694.00	0.83
11	600449	宁夏建材	2,921,722.27	0.81
12	600291	西水股份	2,915,519.00	0.80
13	000550	江铃汽车	2,814,833.13	0.78

14	600708	光明地产	2,812,845.35	0.78
15	601998	中信银行	2,735,285.00	0.75
16	000488	晨鸣纸业	2,731,325.04	0.75
17	000587	金洲慈航	2,678,787.00	0.74
18	600319	亚星化学	2,655,588.00	0.73
19	002714	牧原股份	2,644,909.54	0.73
20	002407	多氟多	2,644,688.76	0.73

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	322,824,120.62
卖出股票收入（成交）总额	326,535,821.17

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,748,000.00	7.42
	其中：政策性金融债	18,748,000.00	7.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	286,196.40	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,034,196.40	7.53

#### 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

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	160023	16 附息国债 23	200,000	18,748,000.00	7.42
2	110030	格力转债	2,520	286,196.40	0.11

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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
IF1708	IF1708	-5	-5,455,800.00	-2,640.00	-
IF1709	IF1709	-10	-10,892,400.00	-20,640.00	-
IF1712	IF1712	-5	-5,407,200.00	-10,500.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-33,780.00
股指期货投资本期收益（元）					-58,360.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					22,540.00

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

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

**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**

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

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

**7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。**

**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	4,695,025.58
2	应收证券清算款	1,474,146.30
3	应收股利	-
4	应收利息	113,061.75
5	应收申购款	711.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,282,945.54

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110030	格力转债	286,196.40	0.11

**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
6,127	42,255.43	41,238,507.93	15.93%	217,660,485.69	84.07%

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	1,614,366.76	0.6236%

## 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月20日）基金份额总额	560,560,675.30
本报告期期初基金份额总额	373,233,229.95
本报告期基金总申购份额	2,336,364.22
减：本报告期基金总赎回份额	116,670,600.55
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	258,898,993.62

## §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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，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。代为履行职务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。

#### 二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动：

无。

### 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 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，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 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	
光大证券	2	124,888,583.69	19.35%	113,812.60	19.35%	-

兴业证券	2	103,034,022.17	15.97%	93,893.27	15.97%	-
天风证券	2	75,697,138.01	11.73%	68,982.96	11.73%	-
国泰君安	2	73,026,768.38	11.32%	66,549.97	11.32%	-
西部证券	1	68,037,197.52	10.54%	62,002.87	10.54%	-
国金证券	2	64,793,227.27	10.04%	59,045.63	10.04%	-
中信建投	2	30,411,294.58	4.71%	27,714.38	4.71%	-
东吴证券	1	26,850,822.88	4.16%	24,469.37	4.16%	-
万和证券	1	20,993,046.34	3.25%	19,131.47	3.25%	-
东方证券	1	14,876,655.82	2.31%	13,557.46	2.31%	-
红塔证券	1	12,602,037.10	1.95%	11,483.86	1.95%	-
上海证券	1	11,687,286.87	1.81%	10,650.54	1.81%	-
联讯证券	1	9,896,041.30	1.53%	9,018.34	1.53%	-
中信证券	2	7,275,940.36	1.13%	6,630.36	1.13%	-
中金公司	3	1,250,123.00	0.19%	1,139.42	0.19%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-



世纪证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

本报告期内本基金退租交易单元：长城证券；新增交易单元：西藏东财、天风证券、瑞银证券。

#### 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

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	-	-	87,000,000.00	11.56%	-	-
兴业证券	23,709,625.20	49.15%	356,000,000.00	47.29%	-	-
天风证券	6,131,753.43	12.71%	25,800,000.00	3.43%	-	-

国泰君安	-	-	169,000,000.00	22.45%	-	-
国金证券	18,397,714.45	38.14%	80,000,000.00	10.63%	-	-
红塔证券	-	-	20,000,000.00	2.66%	-	-
中信证券	-	-	15,000,000.00	1.99%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月28日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月27日
3	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月21日
4	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月16日
5	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月14日
6	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
8	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月27日
10	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月24日
11	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月17日
12	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日
13	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日

14	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 6 日
15	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金更新招募说明书 (2017 年 1 期) -摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 5 日
16	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金更新招募说明书 (2017 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 5 日
17	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
18	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
20	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
21	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
22	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
23	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
24	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
25	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
26	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
27	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
29	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
30	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报	2017 年 3 月 29 日

		刊及本公司网站	
31	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
32	大成动态量化配置策略混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
33	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
34	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
35	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
36	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 7 日
37	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
38	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
39	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
40	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
41	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日
42	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
43	大成动态量化配置策略混合基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 21 日
44	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
45	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
46	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
47	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
48	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日

	交易实施费率优惠活动的公告		
49	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
50	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日

### §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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成动态量化配置策略混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成动态量化配置策略混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日