

大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF) 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成中小盘混合(LOF)
场内简称	大成小盘
基金主代码	160918
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月10日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	181,127,944.10份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014年4月30日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管业务部

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	64,227,746.85	-114,736,456.76	275,611,059.00
本期利润	85,096,720.40	-165,740,751.72	271,476,646.48
加权平均基金份额本期利润	0.4051	-0.4874	1.0215
本期基金份额净值增长率	24.65%	-24.48%	117.84%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.9967	0.7055	1.1172
期末基金资产净值	361,651,325.12	454,777,883.29	617,332,828.67
期末基金份额净值	1.997	1.706	2.259

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

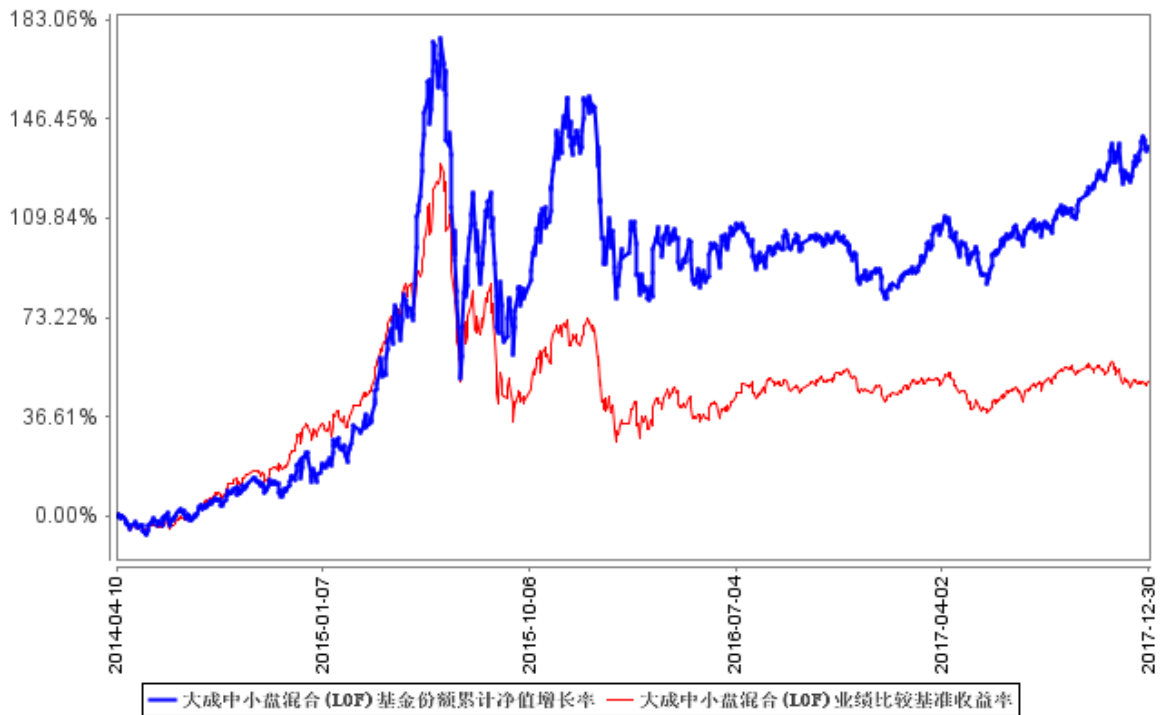
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

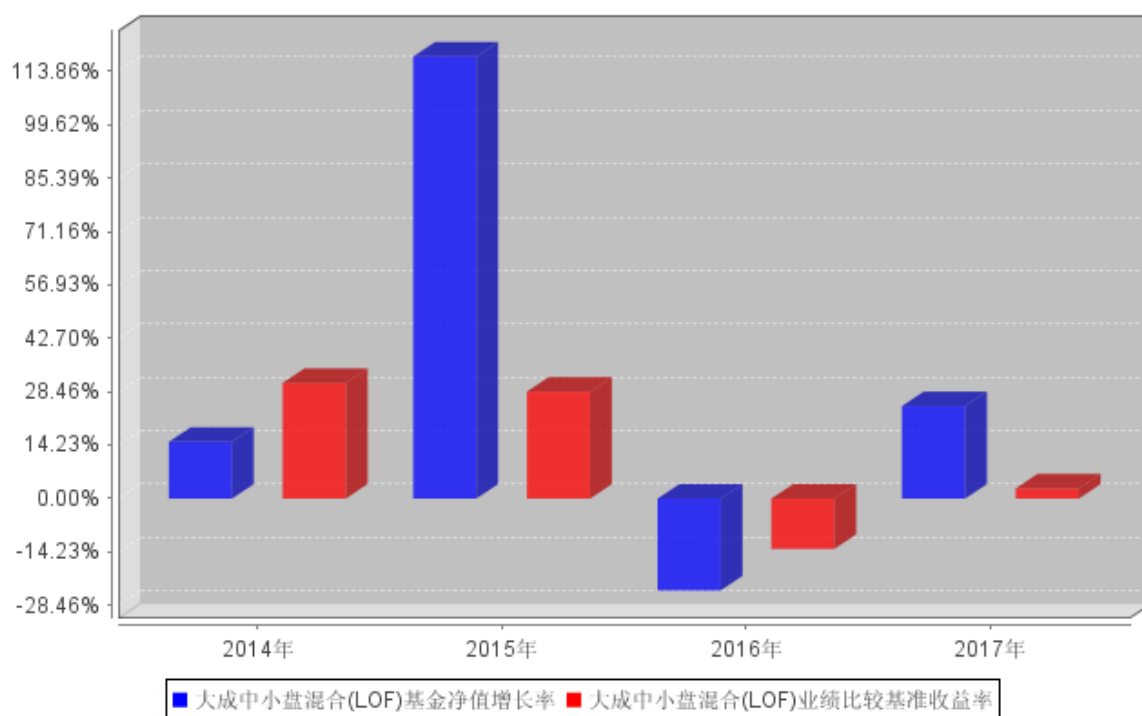
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	9.11%	1.05%	-2.70%	0.71%	11.81%	0.34%
过去六个月	15.95%	0.92%	2.37%	0.70%	13.58%	0.22%
过去一年	24.65%	0.94%	2.73%	0.67%	21.92%	0.27%
过去三年	105.06%	2.13%	14.32%	1.58%	90.74%	0.55%
自基金合同生效起至今	136.07%	1.98%	49.57%	1.47%	86.50%	0.51%

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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日 2014 年 4 月 10 日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2017	1.3000	21,677,588.33	1,563,809.27	23,241,397.60	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	1.3000	21,677,588.33	1,563,809.27	23,241,397.60	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由三家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理,还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展,公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样,构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2017年12月31日,本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金,5只QDII基金及76只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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

					金(LOF)基金经理。2015年4月7日至2016年8月19日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日至2016年8月19日任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2016年3月22日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

工具，对旗下所有投资组合间连续 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 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的情形；主动投资组合间债券交易存在 14 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本年度全 A 指数上涨 4.93%，但是家电、食品饮料、保险三个核心资产分别上涨 45%、55%和 84%，是超额收益最显著的几个板块。过去 A 股是一个封闭市场，投资的思路是寻找和其他国家有差距和追赶空间的产业，典型的比如半导体、互联网等领域。随着港股通、伦股通和 A 股纳入 MSCI，A 股将被纳入到全球资产配置和比较的框架中来思考，有比较优势的领域将得到全球资金的超配。把美日英法德和中概股的指标指数成分股做 GICS 行业分类，家电、白酒和金融确实是 A 股上市公司能有比较优势的行业。

本年度进一步完善了整个投资体系，总结如下：以对优质公司的深度基本面研究为基础，以交易为辅助，组合投资，通过控制个股的风险收益比实现控制整个组合的风险收益比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.997 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.65%，业绩比较基准收益率为 2.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们依然相信自己的不断迭代的投资体系，此外：1) 各个细分行业的优质企业依然是研究和布局的重点，放弃对边缘企业的研究和跟踪是合适的；2) 具备长期成长空间的新能源汽车、5G带来的各个细分领域的机会是值得深度研究和跟踪的；3) 18年是改革开放40周年，关注有可能的政策红利。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

(一) 根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

(二) 全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

(三) 日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

(四) 加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

(五) 以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与

基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 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、专户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、风险管理部和专户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。

4.8 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。本报告期内本基金已分配利润 23,241,397.60 元（每十份基金份额分红 1.300 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	107,166,792.54	48,339,074.98
结算备付金	3,730,851.72	5,956,066.67
存出保证金	307,759.86	551,448.26
交易性金融资产	268,001,468.07	403,536,900.45
其中：股票投资	268,001,468.07	403,536,900.45
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	19,228.41	13,467.67
应收股利	-	-
应收申购款	42,424.97	14,808.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	379,268,525.57	458,411,766.27
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	14,202,777.97	-
应付赎回款	218,624.38	262,242.63
应付管理人报酬	447,520.89	593,788.94
应付托管费	74,586.82	98,964.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,063,625.97	2,168,422.31
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	610,064.42	510,464.29
负债合计	17,617,200.45	3,633,882.98
所有者权益：		
实收基金	181,127,944.10	266,650,574.23
未分配利润	180,523,381.02	188,127,309.06
所有者权益合计	361,651,325.12	454,777,883.29
负债和所有者权益总计	379,268,525.57	458,411,766.27

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.997 元，基金份额总额 181,127,944.10 份。

7.2 利润表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	104,035,714.32	-128,659,560.01
1. 利息收入	814,535.40	1,139,836.73
其中：存款利息收入	814,535.40	1,139,836.73
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）	81,996,694.46	-80,143,457.73
其中：股票投资收益	80,376,591.10	-81,666,773.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,620,103.36	1,523,316.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	20,868,973.55	-51,004,294.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	355,510.91	1,348,355.95
减：二、费用	18,938,993.92	37,081,191.71
1. 管理人报酬	5,799,158.86	9,143,071.97
2. 托管费	966,526.51	1,523,845.39

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,733,448.82	25,967,809.19
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	439,859.73	446,465.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	85,096,720.40	-165,740,751.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	85,096,720.40	-165,740,751.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	266,650,574.23	188,127,309.06	454,777,883.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	85,096,720.40	85,096,720.40
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）	-85,522,630.13	-69,459,250.84	-154,981,880.97
其中：1. 基金申购款	15,029,050.95	13,298,449.73	28,327,500.68
2. 基金赎回款	-100,551,681.08	-82,757,700.57	-183,309,381.65
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）	-	-23,241,397.60	-23,241,397.60
五、期末所有者权益（基金净值）	181,127,944.10	180,523,381.02	361,651,325.12
项目	上年度可比期间 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	273,326,407.00	344,006,421.67	617,332,828.67

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-165,740,751.72	-165,740,751.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,675,832.77	9,861,639.11	3,185,806.34
其中: 1. 基金申购款	232,698,966.80	194,235,607.06	426,934,573.86
2. 基金赎回款	-239,374,799.57	-184,373,967.95	-423,748,767.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	266,650,574.23	188,127,309.06	454,777,883.29

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:

_____ 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

7.4 报表附注

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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年11月27日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

除上述事项外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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

司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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”)	基金管理人的合营企业

资本”)

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”)董事会及股东大会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。大成基金原股东广东证券股份有限公司自 2016 年 4 月 25 日起不再为本基金关联方。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
光大证券	350,166,377.24	4.52%	2,300,426,286.83	13.28%

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	319,104.92	4.52%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	2,096,403.19	13.28%	4,119.36	0.19%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,799,158.86	9,143,071.97
其中：支付销售机构的客户维护费	794,710.89	1,215,119.66

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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	966,526.51	1,523,845.39

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	107,166,792.54	760,952.01	48,339,074.98	967,046.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

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
300109	新开源	2017年3月27日	临时停牌	42.49	2018年1月12日	48.88	230,009	10,573,099.00	9,773,082.41	-
300156	神雾环保	2017年7月17日	临时停牌	23.67	2018年1月17日	21.74	150,686	3,985,317.35	3,566,737.62	-
300730	科创信息	2017年12月25日	临时停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	临时停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	268,001,468.07	70.66
	其中：股票	268,001,468.07	70.66
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	110,897,644.26	29.24
	-	-	0.00
8	其他各项资产	369,413.24	0.10
9	合计	379,268,525.57	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	11,369,889.00	3.14
C	制造业	205,972,624.18	56.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	18,024,683.00	4.98
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
J	金融业	24,863,020.00	6.87

K	房地产业	7,670,715.00	2.12
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	268,001,468.07	74.10

8.2.2 报告期末按行业分类的港股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	000858	五粮液	392,700	31,368,876.00	8.67
2	000001	平安银行	1,869,400	24,863,020.00	6.87
3	002179	中航光电	483,400	19,036,292.00	5.26
4	601877	正泰电器	578,036	15,115,641.40	4.18
5	300274	阳光电源	803,357	15,079,010.89	4.17
6	000786	北新建材	668,640	15,044,400.00	4.16
7	600884	杉杉股份	759,710	14,723,179.80	4.07
8	000910	大亚圣象	622,793	14,261,959.70	3.94
9	600522	中天科技	968,700	13,503,678.00	3.73
10	601899	紫金矿业	2,477,100	11,369,889.00	3.14
11	000065	北方国际	593,300	10,798,060.00	2.99

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	000858	五粮液	96,384,412.23	21.19
2	600884	杉杉股份	96,047,592.92	21.12
3	601688	华泰证券	68,535,200.00	15.07
4	002635	安洁科技	64,859,816.29	14.26
5	002555	三七互娱	62,186,791.25	13.67
6	000568	泸州老窖	57,402,138.89	12.62
7	600507	方大特钢	56,575,437.39	12.44
8	600498	烽火通信	52,565,379.29	11.56
9	002179	中航光电	51,265,905.79	11.27
10	600219	南山铝业	48,181,988.00	10.59
11	000910	大亚圣象	47,398,466.11	10.42
12	600703	三安光电	47,148,062.75	10.37
13	601899	紫金矿业	47,052,130.78	10.35
14	600885	宏发股份	45,617,568.27	10.03
15	600872	中炬高新	44,468,626.80	9.78
16	600549	厦门钨业	44,333,096.46	9.75
17	000063	中兴通讯	43,014,422.25	9.46
18	000786	北新建材	41,655,165.60	9.16
19	601012	隆基股份	41,653,961.33	9.16
20	000776	广发证券	40,696,915.28	8.95
21	600477	杭萧钢构	38,596,604.14	8.49
22	300274	阳光电源	38,055,685.40	8.37
23	002466	天齐锂业	37,452,246.38	8.24
24	300156	神雾环保	35,524,860.74	7.81
25	000001	平安银行	31,965,280.00	7.03
26	600809	山西汾酒	31,693,889.40	6.97
27	600522	中天科技	31,092,440.62	6.84
28	600487	亨通光电	30,227,158.60	6.65
29	000968	蓝焰控股	30,114,027.95	6.62
30	603040	新坐标	29,715,505.00	6.53
31	600029	南方航空	29,714,172.94	6.53
32	601318	中国平安	29,669,769.00	6.52

33	600563	法拉电子	29,609,005.68	6.51
34	300078	思创医惠	29,509,522.08	6.49
35	002050	三花智控	28,771,357.85	6.33
36	300373	扬杰科技	27,514,566.88	6.05
37	600525	长园集团	27,397,827.45	6.02
38	600690	青岛海尔	27,343,096.00	6.01
39	002127	南极电商	27,168,021.39	5.97
40	002126	银轮股份	26,450,992.61	5.82
41	600036	招商银行	26,338,733.81	5.79
42	000333	美的集团	26,171,275.52	5.75
43	002564	天沃科技	26,167,242.64	5.75
44	002434	万里扬	25,850,994.88	5.68
45	002463	沪电股份	25,164,797.38	5.53
46	300342	天银机电	25,028,221.52	5.50
47	603757	大元泵业	24,285,183.56	5.34
48	002061	浙江交科	23,254,667.75	5.11
49	300296	利亚德	23,096,472.40	5.08
50	002624	完美世界	22,944,635.80	5.05
51	000928	中钢国际	22,906,713.99	5.04
52	600570	恒生电子	22,796,907.00	5.01
53	300679	电连技术	22,263,569.83	4.90
54	002456	欧菲科技	22,236,776.01	4.89
55	002019	亿帆医药	21,858,400.18	4.81
56	002294	信立泰	21,785,030.46	4.79
57	600116	三峡水利	21,403,813.87	4.71
58	000065	北方国际	21,263,797.95	4.68
59	603337	杰克股份	21,256,112.73	4.67
60	000651	格力电器	21,085,904.84	4.64
61	002668	奥马电器	21,070,769.44	4.63
62	603008	喜临门	21,066,237.64	4.63
63	600438	通威股份	20,711,502.44	4.55
64	603186	华正新材	20,063,354.20	4.41
65	601166	兴业银行	19,745,182.80	4.34
66	603515	欧普照明	19,667,671.78	4.32
67	300628	亿联网络	19,653,051.67	4.32
68	000969	安泰科技	19,167,013.47	4.21

69	300166	东方国信	18,934,793.75	4.16
70	600873	梅花生物	18,829,641.14	4.14
71	300136	信维通信	18,676,105.36	4.11
72	000069	华侨城A	18,402,698.68	4.05
73	300180	华峰超纤	18,387,891.00	4.04
74	300418	昆仑万维	18,386,099.95	4.04
75	000100	TCL 集团	18,350,598.00	4.04
76	000860	顺鑫农业	18,152,832.00	3.99
77	002080	中材科技	17,383,858.60	3.82
78	603727	博迈科	17,128,465.50	3.77
79	000661	长春高新	17,022,469.44	3.74
80	002831	裕同科技	16,997,684.88	3.74
81	300100	双林股份	16,203,843.67	3.56
82	002043	兔 宝 宝	15,761,786.98	3.47
83	600271	航天信息	15,748,728.38	3.46
84	002643	万润股份	15,637,486.03	3.44
85	002640	跨境通	15,558,718.22	3.42
86	600258	首旅酒店	15,413,631.60	3.39
87	002027	分众传媒	15,170,114.20	3.34
88	000967	盈峰环境	15,165,424.77	3.33
89	002247	帝龙文化	14,977,134.38	3.29
90	002008	大族激光	14,919,126.72	3.28
91	002529	海源机械	14,917,101.84	3.28
92	000002	万 科A	14,820,422.85	3.26
93	002242	九阳股份	14,801,028.00	3.25
94	600966	博汇纸业	14,705,338.80	3.23
95	002202	金风科技	14,621,424.22	3.22
96	000848	承德露露	14,599,237.95	3.21
97	601211	国泰君安	14,583,519.00	3.21
98	601222	林洋能源	14,344,686.66	3.15
99	603517	绝味食品	14,167,779.68	3.12
100	603737	三棵树	14,084,425.94	3.10
101	300383	光环新网	14,001,891.00	3.08
102	002511	中顺洁柔	13,924,783.10	3.06
103	601877	正泰电器	13,923,447.54	3.06
104	000822	山东海化	13,825,815.00	3.04

105	000401	冀东水泥	13,561,802.13	2.98
106	002108	沧州明珠	13,475,000.80	2.96
107	603328	依顿电子	13,464,237.02	2.96
108	002271	东方雨虹	13,233,112.76	2.91
109	601168	西部矿业	13,186,782.52	2.90
110	300159	新研股份	12,790,623.20	2.81
111	002341	新纶科技	12,611,151.40	2.77
112	300446	乐凯新材	12,476,587.94	2.74
113	000581	威孚高科	12,325,257.01	2.71
114	000997	新大陆	12,239,117.20	2.69
115	601601	中国太保	12,230,515.00	2.69
116	002387	黑牛食品	12,092,485.00	2.66
117	002245	澳洋顺昌	11,783,672.00	2.59
118	002517	恺英网络	11,539,880.20	2.54
119	600141	兴发集团	11,260,600.00	2.48
120	002707	众信旅游	11,233,711.68	2.47
121	002714	牧原股份	11,184,479.05	2.46
122	603078	江化微	11,177,443.16	2.46
123	300426	唐德影视	11,158,977.46	2.45
124	600497	驰宏锌锗	11,150,754.00	2.45
125	002422	科伦药业	11,135,491.44	2.45
126	603938	三孚股份	11,114,849.44	2.44
127	300385	雪浪环境	11,057,108.56	2.43
128	603358	华达科技	10,936,830.10	2.40
129	600562	国睿科技	10,925,118.19	2.40
130	300623	捷捷微电	10,906,124.59	2.39
131	603369	今世缘	10,763,221.00	2.37
132	600266	北京城建	10,760,273.00	2.37
133	000553	沙隆达A	10,746,274.22	2.36
134	300109	新开源	10,573,099.00	2.32
135	002812	创新股份	10,480,056.60	2.30
136	603228	景旺电子	10,477,694.01	2.30
137	300145	中金环境	10,196,498.59	2.24
138	300072	三聚环保	10,137,525.84	2.23
139	601636	旗滨集团	9,834,865.00	2.16
140	603609	禾丰牧业	9,116,314.00	2.00

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002635	安洁科技	98,666,066.81	21.70
2	600884	杉杉股份	89,521,829.51	19.68
3	000858	五粮液	78,157,525.73	17.19
4	601688	华泰证券	70,323,609.45	15.46
5	002555	三七互娱	61,967,893.75	13.63
6	600507	方大特钢	59,928,742.37	13.18
7	000568	泸州老窖	59,701,578.82	13.13
8	600498	烽火通信	52,725,561.08	11.59
9	600703	三安光电	49,007,410.85	10.78
10	600219	南山铝业	47,998,566.35	10.55
11	300078	思创医惠	46,024,503.41	10.12
12	002050	三花智控	45,887,884.00	10.09
13	600686	金龙汽车	45,075,496.18	9.91
14	600885	宏发股份	44,307,263.70	9.74
15	000065	北方国际	43,309,175.22	9.52
16	000063	中兴通讯	42,842,559.55	9.42
17	600549	厦门钨业	42,429,662.90	9.33
18	000776	广发证券	41,536,057.46	9.13
19	600872	中炬高新	40,926,684.42	9.00
20	601012	隆基股份	40,145,872.06	8.83
21	600477	杭萧钢构	38,660,824.14	8.50
22	002466	天齐锂业	38,635,183.81	8.50
23	300156	神雾环保	37,386,990.69	8.22
24	000910	大亚圣象	35,620,210.03	7.83
25	601899	紫金矿业	35,473,241.01	7.80
26	600809	山西汾酒	33,425,186.74	7.35
27	000786	北新建材	32,878,034.61	7.23
28	300461	田中精机	32,704,485.39	7.19
29	002179	中航光电	32,181,576.97	7.08
30	601318	中国平安	31,243,170.84	6.87
31	600029	南方航空	30,998,222.27	6.82
32	000968	蓝焰控股	30,540,790.76	6.72

33	002101	广东鸿图	29,736,550.31	6.54
34	600487	亨通光电	29,716,146.73	6.53
35	600563	法拉电子	29,133,462.12	6.41
36	300373	扬杰科技	29,042,504.12	6.39
37	002127	南极电商	28,971,456.19	6.37
38	002777	久远银海	28,775,049.88	6.33
39	600690	青岛海尔	28,307,713.39	6.22
40	603757	大元泵业	27,934,366.14	6.14
41	002126	银轮股份	27,773,353.53	6.11
42	002463	沪电股份	27,525,310.43	6.05
43	600036	招商银行	27,002,366.20	5.94
44	603040	新坐标	26,842,424.48	5.90
45	600525	长园集团	26,775,094.77	5.89
46	002061	浙江交科	26,764,824.69	5.89
47	300274	阳光电源	26,629,236.02	5.86
48	002434	万里扬	25,703,737.47	5.65
49	000333	美的集团	25,595,315.23	5.63
50	002564	天沃科技	25,528,728.81	5.61
51	300296	利亚德	24,969,857.22	5.49
52	300342	天银机电	24,820,052.42	5.46
53	600570	恒生电子	24,532,116.00	5.39
54	000928	中钢国际	24,365,553.61	5.36
55	603337	杰克股份	23,637,760.88	5.20
56	300679	电连技术	22,502,864.32	4.95
57	002624	完美世界	22,459,327.24	4.94
58	002456	欧菲科技	22,046,571.65	4.85
59	300098	高新兴	21,956,270.94	4.83
60	300447	全信股份	21,871,037.60	4.81
61	603008	喜临门	21,366,802.73	4.70
62	600438	通威股份	21,355,818.00	4.70
63	603186	华正新材	21,324,927.49	4.69
64	000651	格力电器	21,098,634.76	4.64
65	002019	亿帆医药	20,886,244.00	4.59
66	600116	三峡水利	20,469,029.97	4.50
67	000661	长春高新	20,424,522.78	4.49
68	002668	奥马电器	20,091,569.95	4.42
69	601166	兴业银行	19,949,556.05	4.39
70	603515	欧普照明	19,816,497.01	4.36

71	300628	亿联网络	19,772,262.00	4.35
72	000100	TCL 集团	19,589,393.00	4.31
73	300236	上海新阳	18,974,214.18	4.17
74	002294	信立泰	18,961,178.12	4.17
75	600873	梅花生物	18,840,393.82	4.14
76	300213	佳讯飞鸿	18,814,432.00	4.14
77	000969	安泰科技	18,582,362.00	4.09
78	300166	东方国信	18,400,894.83	4.05
79	603727	博迈科	18,319,669.32	4.03
80	600522	中天科技	18,309,366.08	4.03
81	601799	星宇股份	18,155,170.00	3.99
82	600195	中牧股份	18,123,733.74	3.99
83	300180	华峰超纤	18,080,804.14	3.98
84	000069	华侨城 A	18,012,845.05	3.96
85	300418	昆仑万维	17,971,339.00	3.95
86	300136	信维通信	17,850,889.87	3.93
87	000860	顺鑫农业	17,692,716.19	3.89
88	002831	裕同科技	17,637,500.64	3.88
89	002027	分众传媒	17,555,872.85	3.86
90	300100	双林股份	16,763,259.07	3.69
91	002669	康达新材	16,452,379.90	3.62
92	002043	兔 宝 宝	15,799,032.39	3.47
93	002247	帝龙文化	15,573,015.64	3.42
94	601211	国泰君安	15,380,807.91	3.38
95	002643	万润股份	15,218,230.58	3.35
96	600966	博汇纸业	15,137,792.00	3.33
97	000967	盈峰环境	15,041,375.64	3.31
98	002008	大族激光	15,027,249.06	3.30
99	600476	湘邮科技	14,879,895.40	3.27
100	002202	金风科技	14,846,995.46	3.26
101	300310	宜通世纪	14,785,027.96	3.25
102	603737	三棵树	14,719,822.94	3.24
103	000848	承德露露	14,591,913.25	3.21
104	002242	九阳股份	14,535,427.80	3.20
105	000002	万 科 A	14,499,293.33	3.19
106	002640	跨境通	14,457,310.93	3.18
107	002511	中顺洁柔	14,455,328.78	3.18
108	000822	山东海化	14,203,389.00	3.12

109	002529	海源机械	14,123,794.11	3.11
110	002271	东方雨虹	14,051,574.03	3.09
111	600258	首旅酒店	14,022,002.80	3.08
112	300383	光环新网	13,909,583.41	3.06
113	603328	依顿电子	13,873,906.20	3.05
114	603517	绝味食品	13,725,764.55	3.02
115	601222	林洋能源	13,603,973.00	2.99
116	000401	冀东水泥	13,151,524.29	2.89
117	002108	沧州明珠	12,961,751.40	2.85
118	300159	新研股份	12,773,664.00	2.81
119	601168	西部矿业	12,742,871.00	2.80
120	000581	威孚高科	12,368,762.36	2.72
121	603938	三孚股份	12,134,963.06	2.67
122	000997	新大陆	12,055,788.96	2.65
123	002387	黑牛食品	12,007,554.32	2.64
124	601601	中国太保	11,828,016.58	2.60
125	300446	乐凯新材	11,545,824.13	2.54
126	002714	牧原股份	11,531,638.02	2.54
127	300623	捷捷微电	11,483,922.85	2.53
128	600141	兴发集团	11,454,382.00	2.52
129	002341	新纶科技	11,344,548.28	2.49
130	002422	科伦药业	11,320,616.02	2.49
131	603358	华达科技	11,300,016.90	2.48
132	300426	唐德影视	11,289,801.00	2.48
133	002707	众信旅游	11,189,786.02	2.46
134	600562	国睿科技	11,178,402.96	2.46
135	002245	澳洋顺昌	11,004,115.00	2.42
136	002517	恺英网络	10,886,477.48	2.39
137	000553	沙隆达A	10,750,409.25	2.36
138	600266	北京城建	10,656,359.00	2.34
139	603369	今世缘	10,629,599.12	2.34
140	603078	江化微	10,623,353.02	2.34
141	600497	驰宏锌锗	10,569,961.00	2.32
142	601636	旗滨集团	10,559,193.59	2.32
143	002812	创新股份	10,544,687.00	2.32
144	002281	光迅科技	10,538,356.90	2.32
145	300145	中金环境	10,218,162.80	2.25
146	603228	景旺电子	10,185,227.44	2.24

147	300385	雪浪环境	10,010,103.31	2.20
148	002080	中材科技	9,956,205.00	2.19
149	000933	神火股份	9,447,829.35	2.08
150	601800	中国交建	9,432,090.94	2.07
151	603609	禾丰牧业	9,422,087.13	2.07
152	002273	水晶光电	9,308,680.08	2.05
153	600406	国电南瑞	9,239,981.00	2.03
154	300070	碧水源	9,146,181.30	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,755,513,172.03
卖出股票收入（成交）总额	3,992,294,169.06

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	307,759.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,228.41
5	应收申购款	42,424.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	369,413.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
16,928	10,699.90	34,200,321.07	18.88%	146,927,623.03	81.12%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	云南国际信托有限公司一筇 岚集合资金信托计划	2,624,239.00	2.62%
2	联想投资有限公司	2,131,200.00	2.12%
3	徐惠清	1,300,600.00	1.30%
4	中国石油天然气集团公司企 业年金计划—中国工商银行 股份有限公	1,211,853.00	1.21%
5	上海协通（集团）有限公司	1,032,300.00	1.03%
6	金宗义	1,000,020.00	1.00%
7	黄城	1,000,000.00	1.00%
8	欧阳艳芬	1,000,000.00	1.00%
9	曹素清	642,800.00	0.64%
10	马元璐	546,701.00	0.54%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	57,940.77	0.0320%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月10日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	266,650,574.23
本报告期基金总申购份额	15,029,050.95
减:本报告期基金总赎回份额	100,551,681.08
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	181,127,944.10

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

2、基金管理人于2017年2月18日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

3、基金管理人于2017年8月12日发布了《大成基金管理有限公司督察长任职公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十七次会议审议通过，赵冰女士自2017年8月11日担任公司督察长，总经理罗登攀不再代为履行督察长职务。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2017年8月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，

该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。本年度支付的审计费用为6万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内公司收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改行政监管措施的决定》，责令公司在三个月内对货币基金单一持有人持有比例过高的情况进行整改，并对相关责任人采取行政监管措施。截止目前，公司已经制定并落实相关整改措施，并向深圳证监局提交整改报告。

2、报告期内本基金托管人的托管业务部门及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	
国泰君安		1895,097,590.55	11.56%	815,729.69	11.56%	-
渤海证券		1746,494,308.68	9.64%	680,289.23	9.64%	-
海通证券		2687,991,147.54	8.89%	626,967.96	8.89%	-
华泰证券		2577,225,780.15	7.46%	526,029.90	7.46%	-
中信建投证券		1560,214,118.81	7.24%	510,532.69	7.24%	-
方正证券		1483,729,009.69	6.25%	440,821.08	6.25%	-
广发证券		1472,473,596.18	6.10%	430,564.13	6.10%	-
银河证券		1407,635,102.63	5.27%	371,478.70	5.27%	-
光大证券		2350,166,377.24	4.52%	319,104.92	4.52%	-
东方证券		1240,072,537.31	3.10%	218,772.36	3.10%	-
中信证券		2234,731,598.35	3.03%	213,915.39	3.03%	-
长江证券		1223,502,612.59	2.89%	203,678.56	2.89%	-

中金公司	2	192,492,815.82	2.49%	175,425.15	2.49%	-
万联证券	1	188,380,353.94	2.43%	171,662.37	2.43%	-
恒泰证券	1	180,613,126.29	2.33%	164,596.99	2.33%	-
国信证券	1	142,313,864.96	1.84%	129,690.14	1.84%	-
安信证券	2	138,526,652.38	1.79%	126,234.98	1.79%	-
华宝证券	1	134,378,937.38	1.74%	122,458.54	1.74%	-
西南证券	1	128,210,101.67	1.66%	116,843.36	1.66%	-
中投证券	3	114,385,680.46	1.48%	104,238.84	1.48%	-
招商证券	2	99,229,416.28	1.28%	90,428.19	1.28%	-
国海证券	1	90,959,445.74	1.18%	82,892.25	1.18%	-
平安证券	1	89,189,847.36	1.15%	81,278.42	1.15%	-
华鑫证券	1	87,516,242.03	1.13%	79,758.35	1.13%	-
华林证券	1	85,796,174.27	1.11%	78,187.65	1.11%	-
东吴证券	1	80,556,490.29	1.04%	73,411.06	1.04%	-
长城证券	1	37,033,149.65	0.48%	33,748.62	0.48%	-
江海证券	1	23,881,666.37	0.31%	21,762.10	0.31%	-
申银万国	1	23,865,827.27	0.31%	21,749.59	0.31%	-
齐鲁证券	1	18,089,001.17	0.23%	16,484.12	0.23%	-
中航证券	1	6,232,931.82	0.08%	5,679.43	0.08%	-
中银国际	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%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

本报告期内增加交易单元：无。

本报告期内退租交易单元：渤海证券、中投证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日