

# 大成债券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

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

本报告期自 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	大成债券	
基金主代码	090002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 6 月 12 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	202, 471, 099. 97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成债券 A/B	大成债券 C
下属分级基金的交易代码:	090002	092002
报告期末下属分级基金的份额总额	154, 842, 561. 73 份	47, 628, 538. 24 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定增值。
投资策略	通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理, 以实现投资目标。类属资产部分按照修正的均值一方差模型在交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间实行最优配置。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品, 其风险收益水平高于货币市场基金, 但低于混合型基金和股票型基金。

### 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	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业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 1 期间 数据 和 指标	2017 年		2016 年		2015 年	
	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券 C
本期 已 实现 收益	7,820,040.44	1,985,654.13	18,130,674.81	10,442,515.10	77,973,903.60	50,588,483.86
本期 利 润	3,859,257.09	965,364.72	2,757,345.68	4,106,333.43	41,567,267.67	17,243,992.77
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0148	0.0137	0.0063	0.0161	0.1137	0.0850
本 期 基 金 份 额	1.83%	1.54%	0.62%	0.31%	11.65%	11.26%

净值增长率						
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	0.0244	0.0313	0.0621	0.0605	0.2339	0.2294
期末基金资产净值	158,624,529.12	49,451,496.84	446,357,444.66	109,186,760.07	463,662,718.43	288,135,665.26
期末基金份额净值	1.0244	1.0383	1.0621	1.0772	1.2666	1.2810

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、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

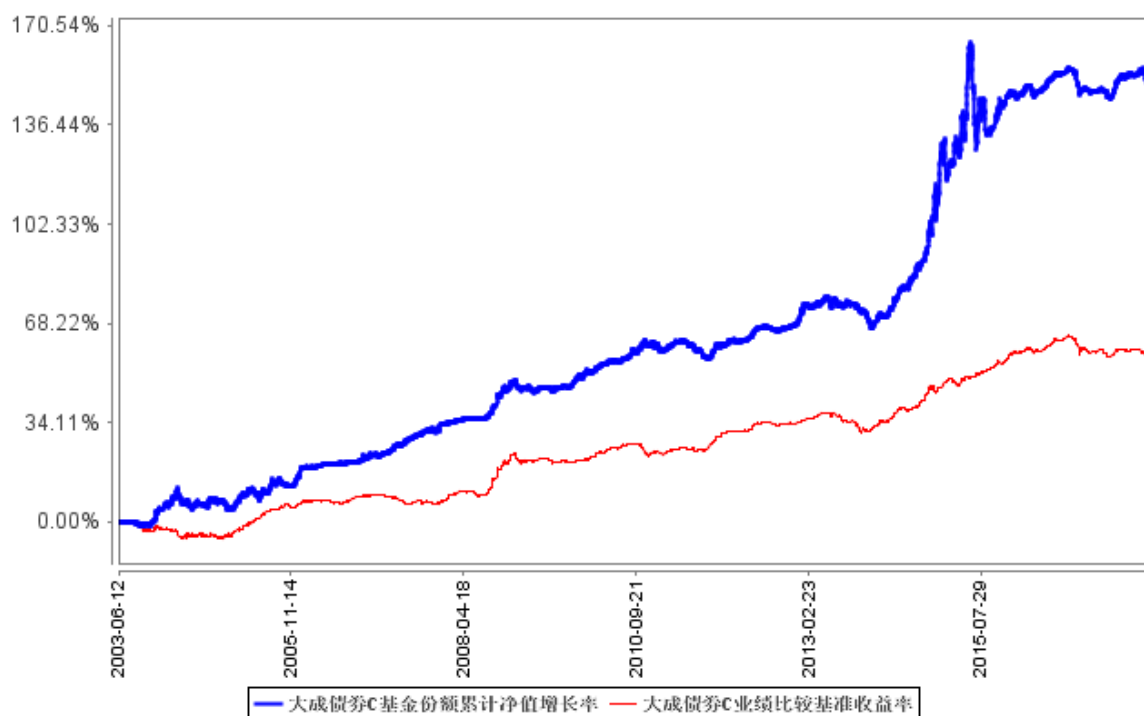
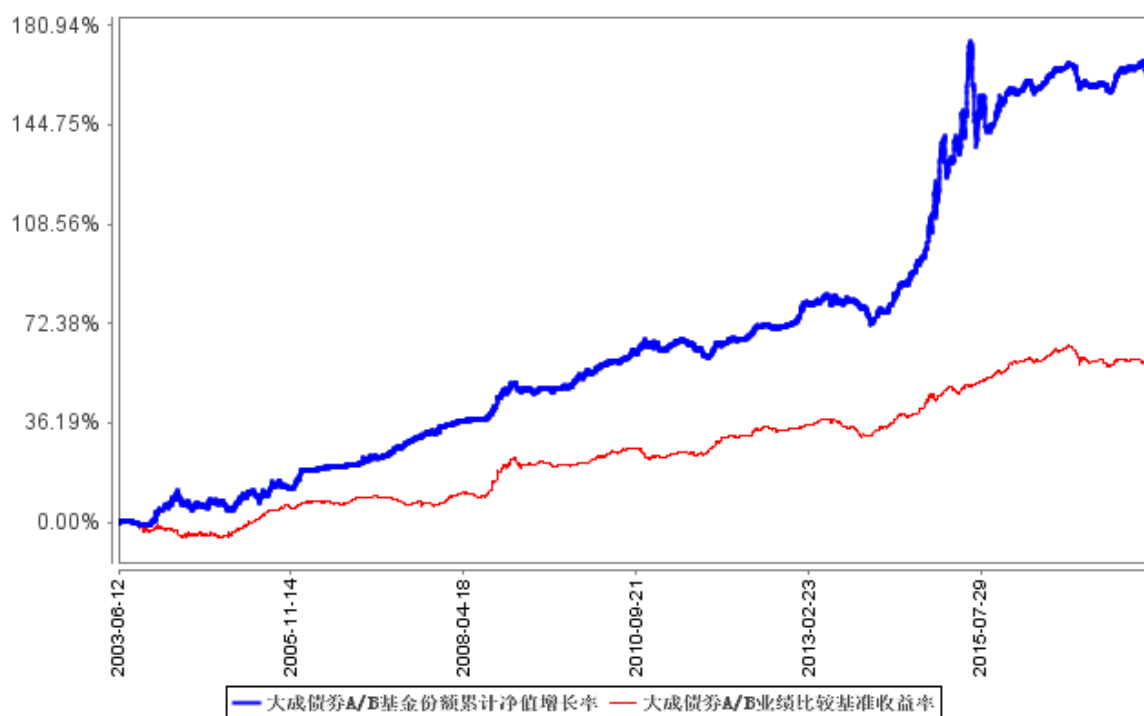
大成债券 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.37%	0.15%	-0.87%	0.09%	0.50%	0.06%
过去六个月	0.68%	0.14%	-0.55%	0.07%	1.23%	0.07%
过去一年	1.83%	0.12%	-1.19%	0.09%	3.02%	0.03%
过去三年	14.41%	0.51%	8.12%	0.11%	6.29%	0.40%
过去五年	52.30%	0.47%	17.74%	0.12%	34.56%	0.35%
自基金合同生效起至今	164.51%	0.32%	58.15%	0.16%	106.36%	0.16%

大成债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.43%	0.15%	-0.87%	0.09%	0.44%	0.06%
过去六个月	0.52%	0.14%	-0.55%	0.07%	1.07%	0.07%
过去一年	1.54%	0.12%	-1.19%	0.09%	2.73%	0.03%
过去三年	13.32%	0.51%	8.12%	0.11%	5.20%	0.40%
过去五年	49.79%	0.47%	17.74%	0.12%	32.05%	0.35%
自基金合同生效起至今	152.55%	0.32%	58.15%	0.16%	94.40%	0.16%

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

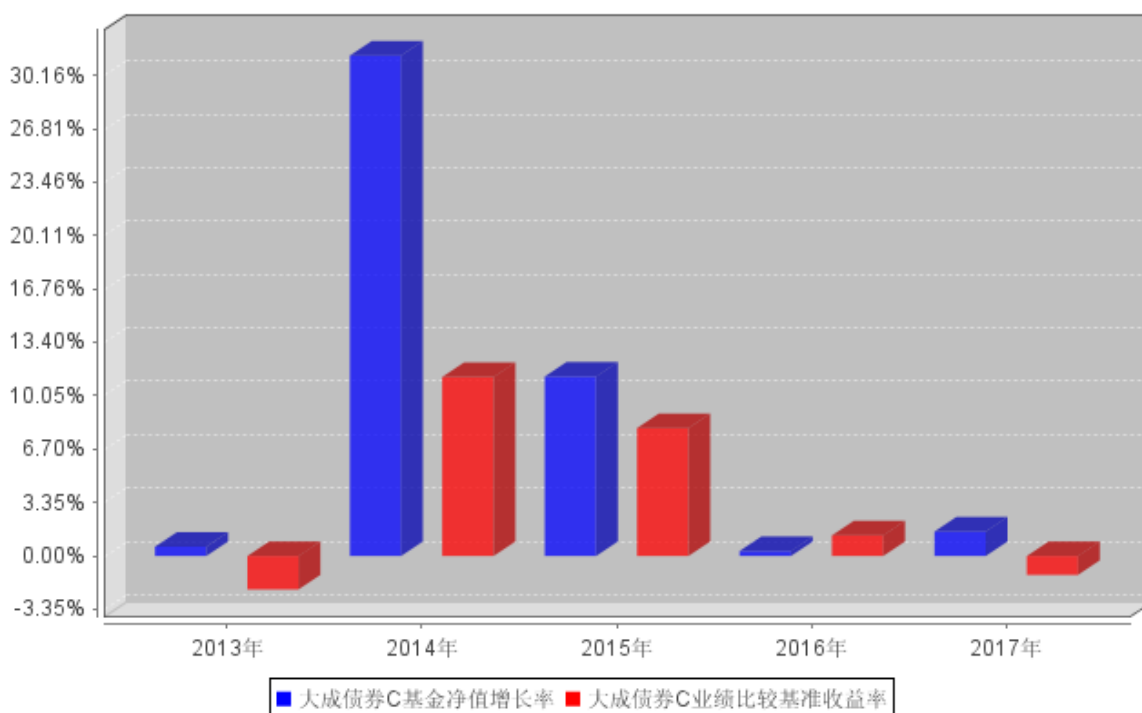
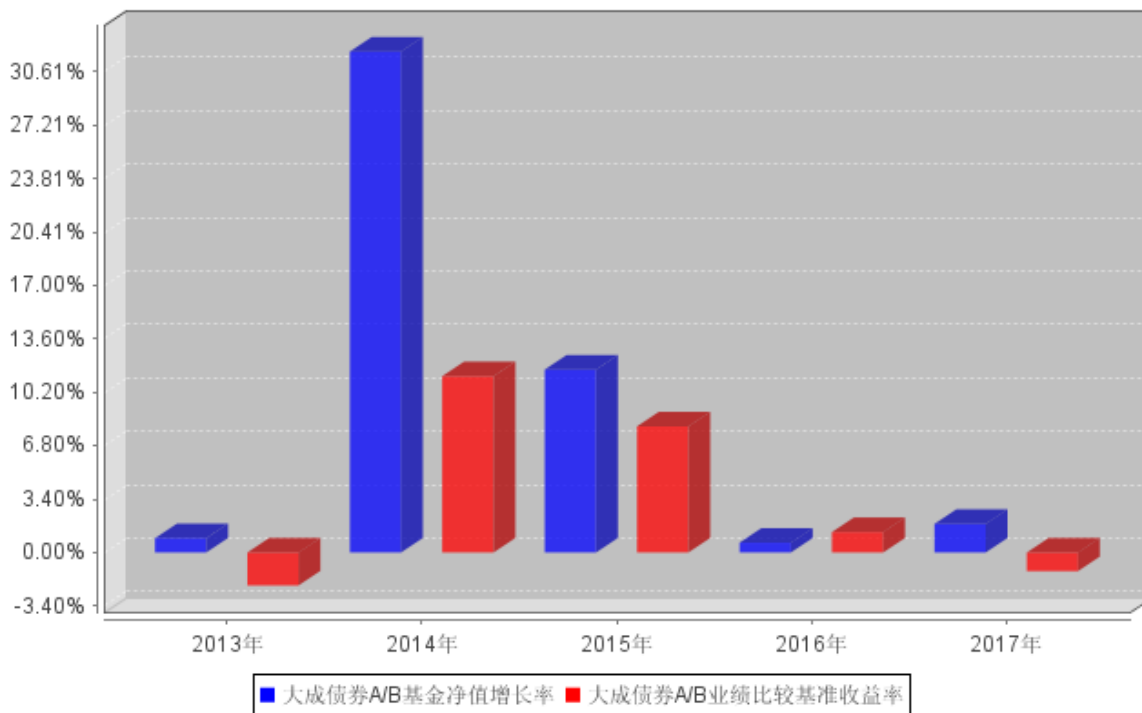


注：1. 本基金于 2006 年 4 月 24 日起推出持续性收费模式，将前端收费模式定义为 A 类收费模式，后端收费模式定义为 B 类收费模式，二者对应的基金份额简称“大成债券 A/B”；将持续性收费模式定义为 C 类收费模式，对应的基金份额简称“大成债券 C”。

2. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资

比例已达到基金合同第十二条之（六）投资组合中规定的各项比例：本基金投资于债券类投资工具的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

大成债券 A/B					
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	0.5610	6,383,808.23	16,464,179.45	22,847,987.68	
2016	2.1050	23,576,519.20	52,621,724.30	76,198,243.50	
2015	1.0980	36,267,753.46	9,634,458.17	45,902,211.63	
合计	3.7640	66,228,080.89	78,720,361.92	144,948,442.81	

单位：人民币元

大成债券 C					
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	0.5460	3,061,942.79	1,977,475.26	5,039,418.05	
2016	2.0650	58,681,251.69	5,273,276.54	63,954,528.23	
2015	0.8720	22,624,475.79	5,097,259.61	27,721,735.40	
合计	3.4830	84,367,670.27	12,348,011.41	96,715,681.68	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 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		
王立女士	本基金基金经理，固定收益总部总监	2009 年 5 月 23 日	-	15 年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾任大成货币市场基金基金经理助理。2007 年 1 月 12 日至 2014 年 12 月 23 日担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009 年 5 月 23 日起任大成债券投资基金基金经理。2012 年 11 月 20 日至 2014 年 4 月 4 日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013 年 2

					<p>月 1 日至 2015 年 5 月 25 日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 23 日至 2015 年 5 月 25 日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 11 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年 2 月 3 日起任大成慧成货币市场基金基金经理。现任固定收益总部总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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，通过多个部门的协作互控，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

2017 年经济延续了 2016 年 4 季度以来较好的复苏势头，1 季度的 GDP 同比增速达到了 6.9%，市场普遍预期经济增速前高后低，但实际上经济韧性普遍强于预期，至四季度经济增速仍然维持在 6.8%，全年增速 6.9%；外需的回暖和地产产业链的强于预期支撑了经济的回暖。物价方面，食品价格的拖累导致今年 CPI 一直维持在 1%-2% 的较低水平，去产能和环保限产使得今年的 PPI 维持在 5% 以上，工业品价格走出通缩状态同样有利于经济的企稳回升。

货币政策总体中性偏紧，从价格上来看，三次上调政策利率，也引导了 R007 等回购利率的大幅上行；从总量上来看，今年 MLF 仅新增 1 万亿，远小于 2016 年 2.8 万亿的增量。2017 年债市最大的新变量是严监管格局的确立，二季度银监开始“三三四”检查，监管政策开始成为银行市场收益率的重要因素，十九大报告和中央经济工作会议中强调防范化解重大风险，更使得金融风险防范成为了重中之重，在此背景下，银行的同业、理财业务结束了过去几年高速增长的状态，

开始转向收缩。

全年来看，中债综合财富（总值）指数全年仅上涨 0.24%；中债金融债券总财富（总值）指数全年下跌 0.69%。具体来看，2017 年初信贷社融的放量、货币政策的收紧和资金面的紧张导致了收益率上行了约 30-40bp；二季度开始的严监管主导了收益率第二波快速上行，特别是同业、委外的收缩压力，导致信用利差迅速扩大，5 年期 AA+中票和国开债之间的利差由 65bp 迅速拉大至 109bp；6 月份到三季度，市场短期企稳，信用利差收窄；进入四季度之后，在经济强于预期、通胀预期又起、以及市场交易结构等因素的综合作用下，市场出现了年内最大的一波下跌。全年 10 年国开上行 104bp，信用利差小幅扩大。

2017 年权益市场分化明显，白马、蓝筹股上涨幅度较大，而创业板指下跌明显。全年来看，上证指数全年上涨 6.56%，上证 50 上涨 25.08%，而创业板指数下跌 10.67%。上证转债指数仅上涨 0.62%。

本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。2017 年本基金主动管理组合大类资产配置，由于债市调整，基金阶段性遭遇赎回压力，我们对组合进行了减仓变现的操作。我们高度重视信用风险，在保持基础仓位的信用债投资比例基础上，严控信用风险，精选信用个券，重点持有中高信用等级信用债。在控制久期的基础上，利率债择采取波段操作的思路尽可能增强收益。权益方面，2017 年，低仓位参与了可转债投资，期间将部分优质可转债转股，持有正股获取绝对收益后减持。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成债券 A/B 基金份额净值为 1.0244 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.83%；截至本报告期末大成债券 C 基金份额净值为 1.0383 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.54%；同期业绩比较基准收益率为-1.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国实际 GDP 每年 6.5%左右增长的背景下，未来 5 年证券市场始终存在好的投资机会。大消费、大制造和大金融中部分细分领域经过 17 年的上涨目前估值已经在合理水平，但是还有很多行业和公司仍然处于行业景气的底部，比如自主品牌的整车股和汽车零部件、证券公司、电子元器件、纺织服装等。这些行业的市场空间足够大，但行业内的公司是否能在未来几年实现稳健增长关键在于管理层是否有相应开拓市场的能力，在研究过程中，我们看到了一些积极的信号，企业核心竞争力的形成是一个长期的过程，我们保持密切跟踪，以期为持有人取得较好的收益。

#### 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、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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验，估值委员会成员中包括三名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理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。本报告期内大成债券 A/B 已分配利润 22,847,987.68 元、大成债券 C 已分配利润 5,039,418.05 元（A/B 类每十份基金份额分红 0.561 元，C 类每十份基金份额分红 0.546 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

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

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

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

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。



## § 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：大成债券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	375,050.21	2,348,527.26
结算备付金	4,008,076.02	7,453,888.14
存出保证金	27,781.58	12,557.03
交易性金融资产	254,699,378.26	484,090,982.40
其中：股票投资	12,260,719.41	-
基金投资	-	-
债券投资	242,438,658.85	484,090,982.40
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	-	72,700,270.00
应收证券清算款	361,646.60	-
应收利息	4,613,847.28	12,663,657.69
应收股利	-	-
应收申购款	37,673.53	48,549.05
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	264,123,453.48	579,318,431.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>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	-	-
卖出回购金融资产款	51,299,784.40	18,750,853.10
应付证券清算款	110,604.41	-
应付赎回款	350,310.83	604,064.68
应付管理人报酬	137,760.62	361,002.60
应付托管费	39,360.16	103,143.58
应付销售服务费	13,225.22	39,402.38
应付交易费用	47,319.22	34,130.32
应交税费	3,533,017.68	3,533,017.68

应付利息	75,522.51	8,249.95
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	440,522.47	340,362.55
负债合计	56,047,427.52	23,774,226.84
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	202,471,099.97	521,633,460.98
未分配利润	5,604,925.99	33,910,743.75
所有者权益合计	208,076,025.96	555,544,204.73
负债和所有者权益总计	264,123,453.48	579,318,431.57

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，大成债券 A/B 类基金份额净值 1.0244 元，大成债券 C 类基金份额净值 1.0383 元；基金份额总额 202,471,099.97 份，其中大成债券 A/B 类基金份额 154,842,561.73 份，大成债券 C 类基金份额 47,628,538.24 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成债券投资基金

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
<b>一、收入</b>	11,591,487.67	19,613,161.79
1.利息收入	22,915,781.44	49,664,858.13
其中：存款利息收入	60,571.74	194,811.79
债券利息收入	22,813,328.31	48,987,025.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	41,881.39	483,021.20
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-6,579,616.33	-8,566,135.90
其中：股票投资收益	-30,732.53	-5,193,862.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,688,298.82	-3,377,748.61
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	139,415.02	5,475.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,981,072.76	-21,709,510.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	236,395.32	223,950.36
<b>减：二、费用</b>	<b>6,766,865.86</b>	<b>12,749,482.68</b>
1. 管理人报酬	2,393,888.76	5,286,532.05
2. 托管费	683,968.15	1,510,437.61
3. 销售服务费	220,506.90	848,206.91
4. 交易费用	132,623.08	59,082.60
5. 利息支出	2,916,195.12	4,601,889.20
其中：卖出回购金融资产支出	2,916,195.12	4,601,889.20
6. 其他费用	419,683.85	443,334.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>4,824,621.81</b>	<b>6,863,679.11</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>4,824,621.81</b>	<b>6,863,679.11</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成债券投资基金

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）	521,633,460.98	33,910,743.75	555,544,204.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,824,621.81	4,824,621.81
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）	-319,162,361.01	-5,243,033.84	-324,405,394.85
其中：1. 基金申购款	219,643,186.60	7,736,688.98	227,379,875.58
2. 基金赎回款	-538,805,547.61	-12,979,722.82	-551,785,270.43
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）	-	-27,887,405.73	-27,887,405.73
五、期末所有者权益（基	202,471,099.97	5,604,925.99	208,076,025.96

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
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	590,996,204.24	160,802,179.45	751,798,383.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,863,679.11	6,863,679.11
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）	-69,362,743.26	6,397,656.92	-62,965,086.34
其中：1. 基金申购款	933,188,388.92	97,647,850.40	1,030,836,239.32
2. 基金赎回款	-1,002,551,132.18	-91,250,193.48	-1,093,801,325.66
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）	-	-140,152,771.73	-140,152,771.73
五、期末所有者权益（基金净值）	521,633,460.98	33,910,743.75	555,544,204.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

    
 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 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和其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.2 税项

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

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

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

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

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

## 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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：1. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“大成基金”）董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2% 股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。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

注：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股票交易。

###### 7.4.4.1.2 权证交易

注：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	-	0.00%	-	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	-	0.00%	62.26	2.24%

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,393,888.76	5,286,532.05
其中：支付销售机构的客户维护费	323,584.92	404,046.80

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 0.70% 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 × 0.70% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 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	683,968.15	1,510,437.61

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 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成债券 A/B	大成债券 C	合计
中国农业银行	-	65,270.67	65,270.67
大成基金	-	17,249.55	17,249.55
光大证券	-	158.82	158.82



合计	-	82,679.04	82,679.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成债券 A/B	大成债券 C	合计
大成基金	-	565,326.29	565,326.29
中国农业银行	-	43,795.65	43,795.65
光大证券	-	1,514.43	1,514.43
合计	-	610,636.37	610,636.37

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日持续性销售服务费收费模式下的 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	20,856,249.95	-	-	330,000,000.00	140,023.91

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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**

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

**7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	375,050.21	16,097.79	2,348,527.26	54,963.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.5 期末（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**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金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 10,399,784.40 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1680367	16 兴泰小微债 01	2018年1月2日	98.67	100,000	9,867,000.00
1380236	13 郑公住投债	2018年1月2日	60.59	20,000	1,211,800.00
合计				120,000	11,078,800.00

#### **7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,900,000.00 元, 于 2018 年 1 月 4 日前先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,260,719.41	4.64
	其中：股票	12,260,719.41	4.64
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	242,438,658.85	91.79
	其中：债券	242,438,658.85	91.79
	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	4,383,126.23	1.66
8	其他各项资产	5,040,948.99	1.91
9	合计	264,123,453.48	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	2,533,401.71	1.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	505,818.10	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	3,381,000.00	1.62
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	5,840,499.60	2.81
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00

M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	12,260,719.41	5.89

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	601336	新华保险	83,198	5,840,499.60	2.81
2	600004	白云机场	230,000	3,381,000.00	1.62
3	600031	三一重工	151,313	1,372,408.91	0.66
4	601238	广汽集团	47,080	1,160,992.80	0.56
5	600755	厦门国贸	50,081	505,818.10	0.24

### 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	601336	新华保险	22,298,691.43	4.01
2	600755	厦门国贸	12,856,955.99	2.31
3	002241	歌尔股份	7,104,074.68	1.28
4	601238	广汽集团	6,667,141.26	1.20
5	600004	白云机场	6,048,943.72	1.09
6	600031	三一重工	5,246,296.48	0.94
7	002510	天汽模	3,638,862.70	0.66

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	601336	新华保险	16,676,213.56	3.00
2	600755	厦门国贸	11,463,614.96	2.06
3	002241	歌尔股份	7,751,433.16	1.40
4	601238	广汽集团	5,097,329.21	0.92
5	600004	白云机场	3,927,109.90	0.71
6	002510	天汽模	3,891,659.70	0.70
7	600031	三一重工	3,845,981.90	0.69

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	63,860,966.26
卖出股票收入（成交）总额	52,653,342.39

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	45,774,800.00	22.00
	其中：政策性金融债	45,774,800.00	22.00
4	企业债券	182,265,501.00	87.60
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	14,398,357.85	6.92
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	242,438,658.85	116.51

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170410	17 农发 10	400,000	39,788,000.00	19.12
2	1080101	10 邵阳城投债	200,000	20,070,000.00	9.65
3	124702	PR 衡水投	200,000	16,338,000.00	7.85
4	1480543	14 南安债	200,000	15,870,000.00	7.63
5	1480247	14 沪永业债	200,000	15,324,000.00	7.36

### 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

注：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

注：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

注：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国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1** 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。

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

#### 8.11.3 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	27,781.58
2	应收证券清算款	361,646.60
3	应收股利	-
4	应收利息	4,613,847.28
5	应收申购款	37,673.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,040,948.99

#### 8.11.4 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	110034	九州转债	1,967,580.00	0.95
2	128015	久其转债	1,907,400.00	0.92
3	123001	蓝标转债	1,496,835.00	0.72
4	132006	16 皖新 EB	975,024.00	0.47
5	128012	辉丰转债	925,120.00	0.44
6	128010	顺昌转债	468,040.00	0.22
7	113012	骆驼转债	369,841.60	0.18
8	127004	模塑转债	172,384.59	0.08

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

#### 8.11.6 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

份额级别	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
大成债券 A/B	15,018	10,310.46	31,719,146.35	20.48%	123,123,415.38	79.52%
大成债券 C	3,637	13,095.56	3,852,864.63	8.09%	43,775,673.61	91.91%
合计	18,655	10,853.45	35,572,010.98	17.57%	166,899,088.99	82.43%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	大成债券 A/B	234,341.13	0.1513%
	大成债券 C	-	0.0000%
	合计	234,341.13	0.1157%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	大成债券 A/B	0
	大成债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成债券 A/B	0
	大成债券 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成债券 A/B	大成债券 C
基金合同生效日（2003 年 6 月 12 日）基金份额总额	2,152,776,735.13	-
本报告期期初基金份额总额	420,275,097.13	101,358,363.85
本报告期基金总申购份额	45,124,617.50	174,518,569.10
减：本报告期基金总赎回份额	310,557,152.90	228,248,394.71
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	154,842,561.73	47,628,538.24

## § 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、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 6 万元。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内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	
申银万国	1	41,010,249.53	77.89%	37,045.21	77.74%	-
招商证券	2	11,643,092.86	22.11%	10,609.71	22.26%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	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: 西藏东财、天风证券、瑞银证券。

本报告期内退租交易单元: 长城证券、南京证券。

### 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

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
申银万国	156,540,914.01	63.72%	6,136,400,000.00	98.50%	-	0.00%
招商证券	89,119,067.16	36.28%	93,400,000.00	1.50%	-	0.00%

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171219	202,399,136.44	11,289,114.68	183,688,251.12	30,000,000.00	14.82%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

### 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