

大成健康产业混合型证券投资基金 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。安永华明会计师事务所（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	大成健康产业混合
基金主代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 24 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	26,604,157.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	<p>本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。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，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。</p> <p>为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。</p>
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股

票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

2、根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”。

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	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	1,053,053.51	-5,329,241.32	769,391.42
本期利润	3,784,077.50	-12,203,163.93	7,832,978.02
加权平均基金份额本期利润	0.1300	-0.3127	0.2051
本期基金份额净值增长率	15.33%	-27.09%	26.81%
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	0.0457	-0.0929	0.1608
期末基金资产净值	27,820,139.33	31,793,957.24	46,762,223.82
期末基金份额净值	1.046	0.907	1.244

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。

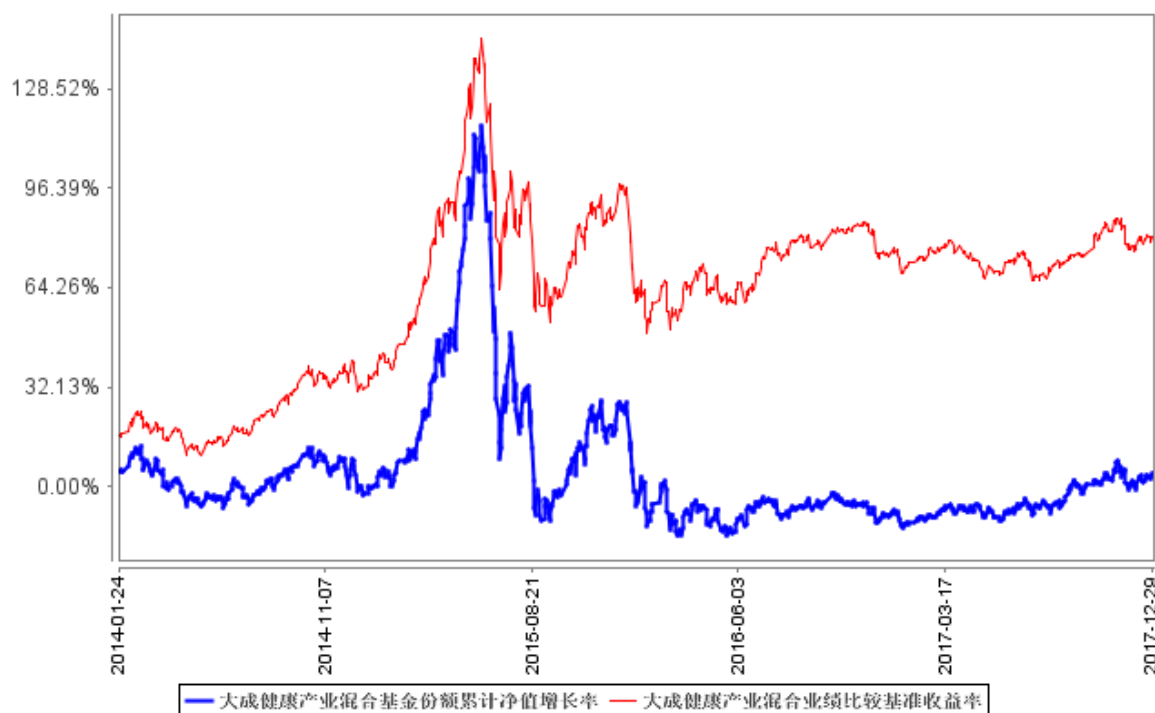
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.87%	1.23%	2.78%	0.81%	1.09%	0.42%
过去六个月	10.69%	1.11%	2.87%	0.68%	7.82%	0.43%
过去一年	15.33%	0.99%	3.02%	0.63%	12.31%	0.36%
过去三年	6.63%	2.19%	36.78%	1.52%	-30.15%	0.67%
自基金合同生效起至今	0.97%	2.01%	56.34%	1.40%	-55.37%	0.61%

3.2.2 自基金合同转型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



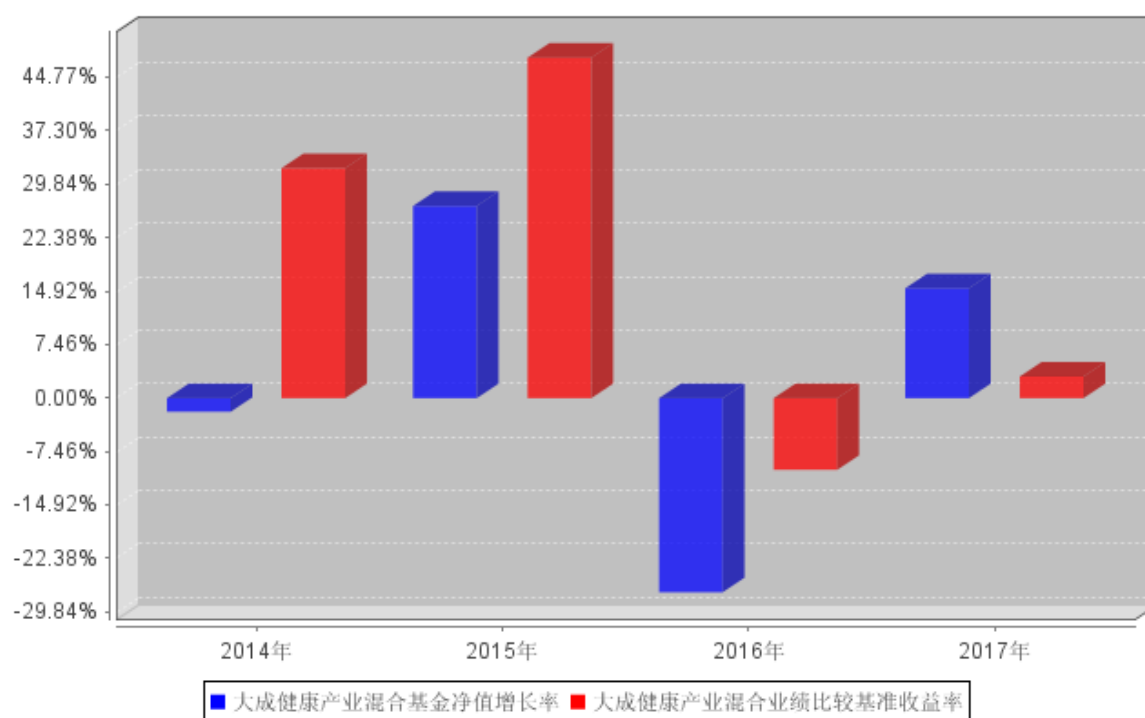
注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日（基金合同生效日）起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3、根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

4、根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”。

3.2.3 自基金转型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

本基金自 2014 年 1 月 24 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§ 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		
杨挺先生	本基金基金经理	2014年6月26日	-	9年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员；2012年8月起任职于大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员。2014年3月18日至2014年6月25日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014年6月26日至2015年7月21日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理。2015年7月8日任大成正向回报灵活配

					置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 12 日起担任大成价值增长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 年以来，上证综指上涨 6.56%，深证成指上涨 8.48%，创业板指下跌 10.67%，申万 28 个一级行业中，共有 10 个行业出现上涨，18 个行业出现下跌，最大行业涨幅为 39.0%（食品饮料），最大行业跌幅为-24.0%（纺织服装）。总体来说，2017 年我们经历了一次强趋势的行情，股价上涨的行业主要集中于大市值集中的白酒、金融、周期类板块，股价下跌的行业主要集中于小市值股票较多的 TMT 等板块。

其次，从经济层面来看 17 年实际 GDP 增速从 16 全年 6.7% 上涨到 17Q3 的 6.9%；名义 GDP 增速从去年最低 7.0%（16 年 1 季度）大幅抬升到 17 年最高 11.8%（17 年 1 季度），截止到 17 年 3 季度，名义 GDP 增速为 11.3%，仍然维持在高位水平。17 年 PPI 增速从 16 年低点-5.3%（2016.01）大幅上涨到 17 年高点 7.8%（2017.02），现在依然维持在 6.9% 的高位水平；同时，PPI 向 CPI 的传导路径不畅，CPI 从去年平均 2.0% 增速到今年前 10 个月平均 1.5% 增速，下跌了 0.5%。

从市场层面来看，今年的行情是前两年行情的继续演绎，15 年下半年和 16 年初的股灾虽然在投资者心中还留有阴影，但是市场人气在经济复苏的环境中逐渐恢复。市场在抛弃了泡沫较多的中小市值股票后，开始在传统蓝筹中寻找业绩确定、估值合理的标的，再加上海外资金开始进入 A 股市场，从某种程度来说更增加了这一趋势。其实从长期来看，注重企业竞争力和业绩的稳定性，跟我们的长期选股思路是比较接近的，因此今年我们的组合也获得了不错的回报，但是仍然有不尽如人意的地方：1、其实家电和白酒的行情今年贯穿始终，而我们对于白酒的行业景气估计过于保守，导致基本没有配置，另外家电我们从 16 年开始就有配置，但是部分公司的涨幅远远超过我们预期，导致我们在今年较早时候就对家电持仓进行了减持，这是今年最大的失误；2、2017 年年初和七月有两波较为明显的周期行情，我们对于周期股的前景比较看好，但是行情来的迅猛且较为短暂，导致我们虽有收获，但是离预期的回报率仍然有差距；3、2017 年 11 月左右市场有

一波调整，我们当时意识到了市场可能面临调整，但是在组合的调整上还是没有做得很好，导致净值有所损失。

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 1.046 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.33%，业绩比较基准收益率为 3.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从固定资产投资增速角度来看，2011 年以来制造业的固定资产投资增速持续回落——制造业的固定资产投资增速从 2011 年 30%以上的高位持续下行到当前仅为 5%左右的低位（今年 10 月的制造业固定资产投资增速 4.1%，已经连续 17 个月在 5%左右徘徊）；制造业工业增加值（同比）持续恶化，也侧面印证了产能在不断出清——制造业工业增加值（同比）从 2013 年高点的 10%大幅下行到 2016 年低点的 6%（不过，得益于朱格拉周期的驱动，制造业工业增加值已经出现了一定回升）；同时，从微观的企业财务数据出发，制造业上市公司的固定资产增速和在建工程增速也已经大幅下行——中游制造行业的固定资产增速从 2010 年 30.8%的高位下降到了 17 年第三季度的 8.8%的低位，而在建工程增速从 2012 年 34.4%的高位大幅下滑，2015 年第四季度以来已经连续 8 个季度负增长。不过在建工程增速从 16 年第四季度开始已经趋势性回升，上市公司的投资存在“在建工程转固定资产”的过程，中游制造行业的投资已经出现改善的迹象。中游制造行业的盈利能力（TTM 的 ROE）和产能利用率（TTM 的固定资产加在建工程周转率）自去年中以来已持续改善 1 年以上，利润表明显修复；而中游制造行业的资产负债表经历了“漫长的自发性修复进程”，杠杆水平从 2010 年开始持续下行，基本已经处于“合意”区间——反映整体杠杆水平的资产负债率已经下降到接近 2008 年的位置；而与企业产能投放密切相关的有息负债率已经大幅下降到了 2004 年的位置。综合来看，中游制造行业已经具备再次加杠杆、扩产能的潜力。

从政策层面来看，19 大报告的核心表述从“需求端刺激”转向“供给侧调整”，意味着“供给侧改革”不仅限于“上游限产能”——我们提炼中央重要文件（18、19 大报告+历年中央经济工作会议报告）中关于经济结构的核心表述，可以看到，政策的核心逻辑逐步从“需求端刺激”转向了“供给侧调整”。15 年下半年开始的“供给侧改革”已经基本完成过剩产能的出清，而 19 大报告的核心表述仍然是“供给侧调整”，意味着供给端调整需要进一步深化；同时，“制造强国”战略的提出，预示着在“上游限产能”基本完成之后，政策的重心将转向“中游调结构”。中游制造行业（产能出清、具备再次加杠杆、扩产能潜力）正好契合“制造强国”战略主线，有

望开启新一轮产能扩张周期。

我们综合 ROE (TTM)、产能利用率以及杠杆率（有息负债率）三大指标，筛选出产能“出清”较为彻底且利润表和资产负债表同时修复的行业，若投资现金流占收入比底部回升，则表明该类行业已经开始“试探性”加杠杆了，这类行业集中在中游制造板块。另外，消费升级属于更长期的周期，这里不在赘述逻辑，因此大消费板块依然会是我们长期重点配置的板块，尤其是过去两年中被市场忽视的医疗板块。

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、制度执行及遵纪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、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托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。本报告期内本基金无收益分配事项。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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：大成健康产业混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	1,815,023.17	5,000,770.43
结算备付金	104,630.71	157,727.69
存出保证金	9,576.14	16,594.76
交易性金融资产	25,832,857.55	26,052,345.30
其中：股票投资	25,802,355.15	26,052,345.30
基金投资	-	-
债券投资	30,502.40	-
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	200,000.00	-
应收证券清算款	270,524.18	934,764.44
应收利息	812.03	1,057.07
应收股利	-	-
应收申购款	9,765.26	947.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	28,243,189.04	32,164,207.30
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	-	157,280.93
应付赎回款	208,045.56	5,925.49
应付管理人报酬	35,150.61	39,814.20
应付托管费	5,858.44	6,635.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	43,986.65	80,571.59
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	130,008.45	80,022.17
负债合计	423,049.71	370,250.06
所有者权益：		
实收基金	26,604,157.95	35,048,729.88
未分配利润	1,215,981.38	-3,254,772.64
所有者权益合计	27,820,139.33	31,793,957.24
负债和所有者权益总计	28,243,189.04	32,164,207.30

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.046 元，基金份额总额 26604157.95 份。

7.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

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
一、收入	4,802,805.86	-10,551,275.32
1. 利息收入	25,528.11	36,661.78
其中：存款利息收入	20,473.88	36,661.78
债券利息收入	59.55	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,994.68	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,035,300.42	-3,744,712.84
其中：股票投资收益	1,819,327.73	-3,887,579.38
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	215,972.69	142,866.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,731,023.99	-6,873,922.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	10,953.34	30,698.35
减：二、费用	1,018,728.36	1,651,888.61
1. 管理人报酬	416,759.83	545,968.60

2. 托管费	69,459.96	90,994.70
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	347,357.99	823,252.09
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	185,150.58	191,673.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,784,077.50	-12,203,163.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,784,077.50	-12,203,163.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

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）	35,048,729.88	-3,254,772.64	31,793,957.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,784,077.50	3,784,077.50
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）	-8,444,571.93	686,676.52	-7,757,895.41
其中：1. 基金申购款	6,603,977.55	-145,004.22	6,458,973.33
2. 基金赎回款	-15,048,549.48	831,680.74	-14,216,868.74
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）	26,604,157.95	1,215,981.38	27,820,139.33
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（基金净值）	37,604,250.04	9,157,973.78	46,762,223.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,203,163.93	-12,203,163.93
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）	-2,555,520.16	-209,582.49	-2,765,102.65
其中：1. 基金申购款	26,795,412.27	-2,204,341.80	24,591,070.47
2. 基金赎回款	-29,350,932.43	1,994,759.31	-27,356,173.12
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）	35,048,729.88	-3,254,772.64	31,793,957.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

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

根据中国证券投资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》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 11 月 27 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本报告期末的基金资产净值及本报告期损益均无影响。

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

7.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳；

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.2.2 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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

注：(1) 根据本基金管理人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) 以下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	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

	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	44,235,194.36	19.24%	50,646,493.89	9.26%

7.4.4.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.4.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.4 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	40,314.78	19.24%	-	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	46,156.56	9.26%	143.34	0.18%

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。

(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	416,759.83
其中：支付销售机构的客户维护费	140,485.72	181,091.33

注：(1) 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费

率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2017 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 35,150.61 元（2016 年 12 月 31 日：人民币 39,814.20 元）。

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	69,459.96	90,994.70

注：(1) 基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2017 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 5,858.44 元（2016 年 12 月 31 日：人民币 6,635.68 元）。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2014 年 1 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	18.8800%	14.3300%

注：基金管理人申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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
中国银行股份有限公司	1,815,023.17	18,640.70	5,000,770.43	32,011.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

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	25,802,355.15	91.36
	其中：股票	25,802,355.15	91.36
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	30,502.40	0.11
	其中：债券	30,502.40	0.11
	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	200,000.00	0.71
	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	1,919,653.88	6.80
		-	0.00
8	其他各项资产	290,677.61	1.03
9	合计	28,243,189.04	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	782,944.00	2.81
C	制造业	21,646,495.15	77.81
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	616,175.00	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	-	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	837,162.00	3.01
J	金融业	-	0.00

K	房地产业	290,075.00	1.04
L	租赁和商务服务业	575,872.00	2.07
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	1,053,632.00	3.79
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	25,802,355.15	92.75

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	000661	长春高新	14,485	2,650,755.00	9.53
2	002614	奥佳华	92,000	1,780,200.00	6.40
3	300633	开立医疗	60,800	1,679,904.00	6.04
4	002294	信立泰	36,100	1,631,359.00	5.86
5	002061	浙江交科	92,455	1,413,636.95	5.08
6	600196	复星医药	28,500	1,268,250.00	4.56
7	600195	中牧股份	64,200	1,265,382.00	4.55
8	601636	旗滨集团	192,500	1,201,200.00	4.32
9	603579	荣泰健康	16,900	1,064,531.00	3.83
10	600763	通策医疗	32,600	1,053,632.00	3.79

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	002223	鱼跃医疗	3,676,882.00	11.56
2	000910	大亚圣象	2,652,175.00	8.34
3	000717	韶钢松山	2,573,689.28	8.09
4	300415	伊之密	2,258,795.68	7.10
5	601636	旗滨集团	2,046,451.00	6.44
6	600332	白云山	2,032,921.35	6.39
7	600141	兴发集团	1,976,625.00	6.22
8	603008	喜临门	1,847,080.00	5.81
9	002614	奥佳华	1,836,480.00	5.78
10	300633	开立医疗	1,527,789.00	4.81
11	603737	三棵树	1,507,168.75	4.74
12	002497	雅化集团	1,480,363.00	4.66
13	600196	复星医药	1,431,980.00	4.50
14	603968	醋化股份	1,403,852.10	4.42
15	002001	新和成	1,390,852.71	4.37
16	000968	蓝焰控股	1,387,739.49	4.36
17	600529	山东药玻	1,353,891.81	4.26
18	002061	浙江交科	1,335,565.35	4.20
19	002643	万润股份	1,304,009.00	4.10
20	600195	中牧股份	1,280,735.39	4.03
21	600518	康美药业	1,248,268.00	3.93
22	000050	深天马A	1,222,278.00	3.84
23	002430	杭氧股份	1,186,391.56	3.73
24	002460	赣锋锂业	1,178,608.00	3.71
25	002466	天齐锂业	1,175,295.00	3.70
26	002294	信立泰	1,148,047.00	3.61
27	300156	神雾环保	1,147,284.00	3.61
28	002157	正邦科技	1,133,614.00	3.57
29	002027	分众传媒	1,119,342.00	3.52
30	600500	中化国际	1,107,974.00	3.48
31	603993	洛阳钼业	1,103,947.00	3.47
32	600477	杭萧钢构	1,095,314.00	3.45
33	603579	荣泰健康	1,088,283.00	3.42
34	601688	华泰证券	1,068,905.00	3.36
35	300463	迈克生物	1,054,995.00	3.32

36	002121	科陆电子	1,054,877.00	3.32
37	002127	南极电商	1,044,123.80	3.28
38	600966	博汇纸业	1,036,725.00	3.26
39	600110	诺德股份	1,033,869.00	3.25
40	603328	依顿电子	1,017,773.66	3.20
41	002002	鸿达兴业	982,744.00	3.09
42	600763	通策医疗	978,331.00	3.08
43	000807	云铝股份	974,819.00	3.07
44	300188	美亚柏科	959,064.00	3.02
45	000529	广弘控股	957,000.00	3.01
46	300180	华峰超纤	920,665.00	2.90
47	600872	中炬高新	904,785.00	2.85
48	603337	杰克股份	903,049.00	2.84
49	002573	清新环境	898,577.00	2.83
50	601318	中国平安	897,582.00	2.82
51	002536	西泵股份	890,116.20	2.80
52	300144	宋城演艺	889,359.00	2.80
53	002281	光迅科技	822,594.00	2.59
54	601100	恒立液压	813,092.00	2.56
55	002539	云图控股	811,738.00	2.55
56	600176	中国巨石	806,570.00	2.54
57	600884	杉杉股份	793,434.00	2.50
58	603799	华友钴业	764,029.00	2.40
59	002202	金风科技	731,512.00	2.30
60	603989	艾华集团	728,393.00	2.29
61	601137	博威合金	716,712.00	2.25
62	300228	富瑞特装	716,456.60	2.25
63	600741	华域汽车	707,487.00	2.23
64	600691	阳煤化工	698,852.12	2.20
65	002307	北新路桥	690,066.00	2.17
66	600585	海螺水泥	683,973.00	2.15
67	000932	*ST 华菱	682,899.00	2.15
68	603108	润达医疗	675,460.42	2.12
69	002126	银轮股份	662,145.00	2.08
70	002185	华天科技	662,126.00	2.08
71	002538	司尔特	647,686.00	2.04

72	601311	骆驼股份	644,953.27	2.03
73	002739	万达电影	642,195.36	2.02
74	601677	明泰铝业	641,507.00	2.02
75	002439	启明星辰	638,080.00	2.01

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	002223	鱼跃医疗	3,782,599.69	11.90
2	300415	伊之密	2,472,210.66	7.78
3	600110	诺德股份	2,382,298.63	7.49
4	002050	三花智控	2,319,500.65	7.30
5	300180	华峰超纤	2,269,385.08	7.14
6	000910	大亚圣象	2,176,226.61	6.84
7	600477	杭萧钢构	2,167,545.14	6.82
8	600998	九州通	2,090,977.45	6.58
9	600056	中国医药	1,955,410.64	6.15
10	600332	白云山	1,953,658.70	6.14
11	603008	喜临门	1,939,321.05	6.10
12	600141	兴发集团	1,935,450.28	6.09
13	000513	丽珠集团	1,834,542.77	5.77
14	002497	雅化集团	1,819,102.00	5.72
15	002126	银轮股份	1,771,807.33	5.57
16	603108	润达医疗	1,626,388.20	5.12
17	002007	华兰生物	1,602,399.08	5.04
18	300463	迈克生物	1,565,075.08	4.92
19	002460	赣锋锂业	1,534,944.00	4.83
20	000717	韶钢松山	1,474,053.95	4.64
21	000529	广弘控股	1,473,384.48	4.63
22	603737	三棵树	1,471,815.68	4.63
23	300156	神雾环保	1,442,922.95	4.54
24	002430	杭氧股份	1,397,873.51	4.40
25	600518	康美药业	1,373,400.98	4.32
26	300447	全信股份	1,356,751.00	4.27
27	600529	山东药玻	1,341,889.19	4.22

28	002422	科伦药业	1,310,319.73	4.12
29	002466	天齐锂业	1,309,698.00	4.12
30	300461	田中精机	1,303,087.45	4.10
31	000968	蓝焰控股	1,249,857.76	3.93
32	000050	深天马 A	1,249,661.00	3.93
33	603968	醋化股份	1,241,663.50	3.91
34	002643	万润股份	1,204,207.00	3.79
35	601688	华泰证券	1,160,308.00	3.65
36	002127	南极电商	1,157,628.00	3.64
37	600966	博汇纸业	1,144,259.00	3.60
38	002157	正邦科技	1,077,135.00	3.39
39	600500	中化国际	1,016,444.80	3.20
40	002121	科陆电子	1,007,838.35	3.17
41	601318	中国平安	984,995.00	3.10
42	600976	健民集团	979,112.24	3.08
43	600872	中炬高新	969,582.00	3.05
44	601636	旗滨集团	953,529.00	3.00
45	002573	清新环境	909,614.00	2.86
46	002536	西泵股份	907,769.00	2.86
47	002202	金风科技	893,688.00	2.81
48	002032	苏泊尔	888,968.54	2.80
49	002281	光迅科技	881,463.30	2.77
50	002690	美亚光电	875,379.61	2.75
51	000807	云铝股份	832,709.00	2.62
52	603799	华友钴业	820,100.00	2.58
53	002002	鸿达兴业	818,038.50	2.57
54	300144	宋城演艺	817,449.00	2.57
55	600498	烽火通信	811,429.96	2.55
56	600884	杉杉股份	775,939.00	2.44
57	600176	中国巨石	759,093.00	2.39
58	002539	云图控股	756,041.00	2.38
59	002307	北新路桥	755,098.00	2.37
60	600969	郴电国际	740,436.71	2.33
61	603989	艾华集团	705,605.32	2.22
62	002674	兴业科技	705,313.47	2.22
63	002185	华天科技	698,251.00	2.20
64	300228	富瑞特装	686,615.00	2.16
65	601677	明泰铝业	685,532.99	2.16

66	002434	万里扬	654,696.00	2.06
67	002439	启明星辰	651,901.00	2.05
68	002001	新和成	649,795.00	2.04
69	601137	博威合金	646,671.00	2.03
70	600511	国药股份	645,704.00	2.03

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	112,576,948.73
卖出股票收入（成交）总额	117,378,788.20

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	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	30,502.40	0.11
8	同业存单	-	0.00
-	-	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	30,502.40	0.11

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	113012	骆驼转债	320	30,502.40	0.11

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投资。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,576.14
2	应收证券清算款	270,524.18
3	应收股利	-
4	应收利息	812.03
5	应收申购款	9,765.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	290,677.61

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113012	骆驼转债	30,502.40	0.11

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
2,266	11,740.58	5,024,120.60	18.88%	21,580,037.35	81.12%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,915.53	0.0373%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年1月24日）基金份额总额	22,376,979.98
本报告期期初基金份额总额	35,048,729.88
本报告期基金总申购份额	6,603,977.55
减:本报告期基金总赎回份额	15,048,549.48
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	26,604,157.95

§ 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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报

告期应支付的审计费用为 3 万元整。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、本报告期内，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	
中信建投	1	60,683,269.61	26.39%	55,306.34	26.39%	-
光大证券	2	44,235,194.36	19.24%	40,314.78	19.24%	-
华鑫证券	1	32,255,628.28	14.03%	29,396.95	14.03%	-
民生证券	1	19,798,840.95	8.61%	18,037.95	8.61%	-
东吴证券	1	18,220,129.85	7.92%	16,604.22	7.92%	-
申银万国	1	15,071,334.54	6.55%	13,735.56	6.55%	-
财富证券	1	14,914,529.34	6.49%	13,594.31	6.49%	-
长江证券	1	12,201,023.37	5.31%	11,121.93	5.31%	-
齐鲁证券	1	4,344,918.61	1.89%	3,960.35	1.89%	-
湘财证券	1	3,160,229.12	1.37%	2,879.43	1.37%	-
华泰证券	2	2,322,032.40	1.01%	2,116.56	1.01%	-
江海证券	1	2,067,087.50	0.90%	1,883.62	0.90%	-

海通证券	2	681,519.00	0.30%	621.02	0.30%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：无。退出交易单元：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

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
中信建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	1,700,000.00	89.47%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	200,000.00	10.53%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	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

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