

大成内需增长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	大成内需增长混合	
基金主代码	090015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 14 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	176,452,446.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成内需增长混合 A	大成内需增长混合 H
下属分级基金的交易代码:	090015	960018
报告期末下属分级基金的份额总额	175,745,552.95 份	706,893.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于受益于内需增长的行业中的优质上市公司，力争充分分享中国经济增长以及经济结构转型带来的投资收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析，实施大类资产配置；分析以内需增长为重要推动力的中国经济转型进程中的政策导向与经济结构调整的特点，研究国内消费需求以及与之紧密关联的投资需求的增长规律，结合经济周期与产业变迁路径的分析，实施行业配置；以相关的投资主题和内需增长受益行业为线索，通过公司基本面的考量，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。</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	80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

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
	大成内需增长混合 A	大成内需增长混合 H	大成内需增长混合 A	大成内需增长混合 H	大成内需增长混合 A
本期已实现收益	49,037,520.45	348,436.34	-26,481,748.65	-68,707.94	124,337,425.84
本期利润	99,773,394.36	511,577.55	-101,173,710.77	287,222.39	166,150,733.40
加权平均基金份额本期利润	0.4756	0.5157	-0.3673	0.6371	0.6710
本期基金份额净值增长率	21.85%	21.79%	-15.86%	11.84%	73.25%
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	1.1852	1.1856	0.9122	0.9130	0.9936
期末基金资产净值	477,263,818.85	1,920,060.95	602,031,248.57	123,645.98	654,008,275.09
期末基金份额净值	2.716	2.716	2.229	2.230	2.649

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

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

3、本基金 H 类基金份额于 2016 年 3 月 3 日初次确认申购。

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

大成内需增长混合 A

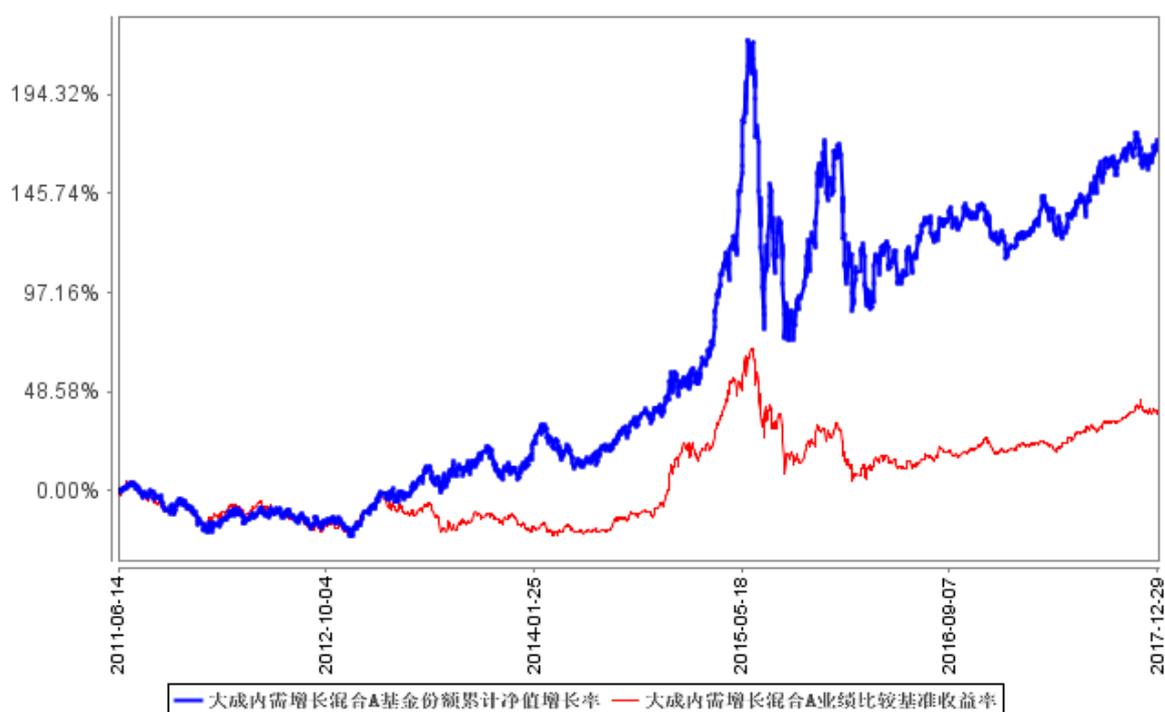
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.86%	0.94%	3.97%	0.64%	-0.11%	0.30%

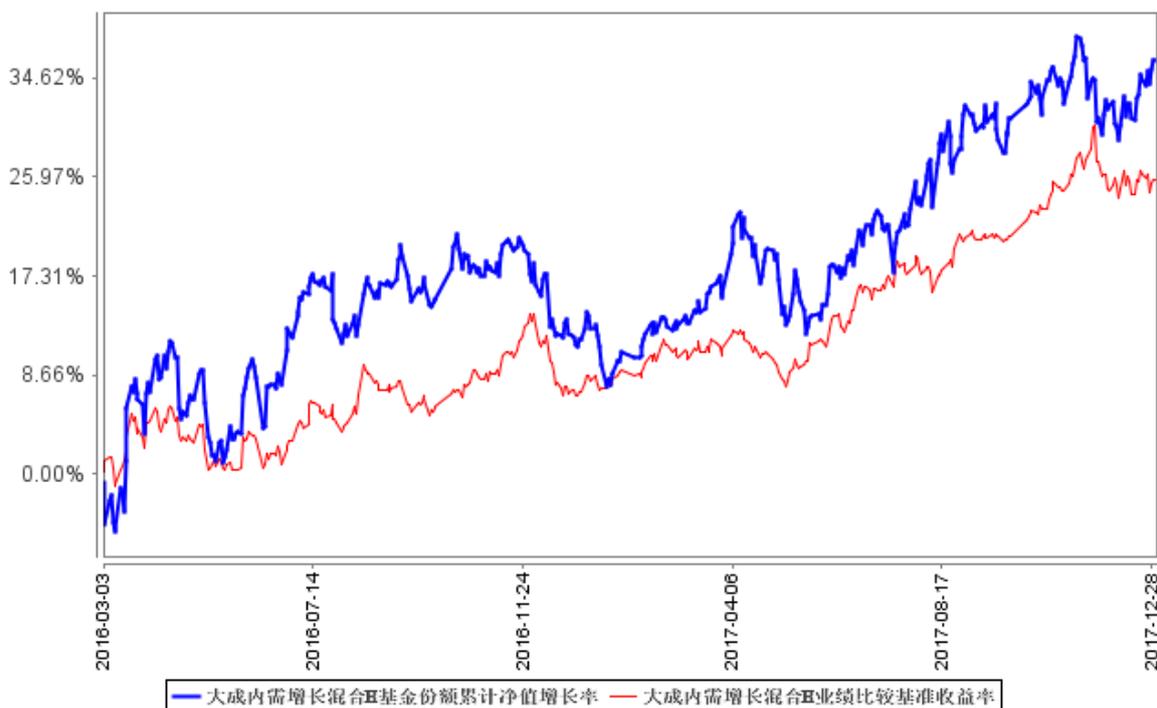
过去六个月	11.82%	1.02%	7.96%	0.56%	3.86%	0.46%
过去一年	21.85%	0.96%	17.23%	0.51%	4.62%	0.45%
过去三年	77.63%	2.05%	15.30%	1.35%	62.33%	0.70%
过去五年	203.80%	1.82%	54.69%	1.24%	149.11%	0.58%
自基金合同生效起至今	171.60%	1.68%	39.25%	1.19%	132.35%	0.49%

大成内需增长混合 H

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	3.86%	0.94%	3.97%	0.64%	-0.11%	0.30%
过去六个月	11.82%	1.01%	7.96%	0.56%	3.86%	0.45%
过去一年	21.79%	0.96%	17.23%	0.51%	4.56%	0.45%
自基金合同生效起至今	36.21%	1.11%	25.65%	0.61%	10.56%	0.50%

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

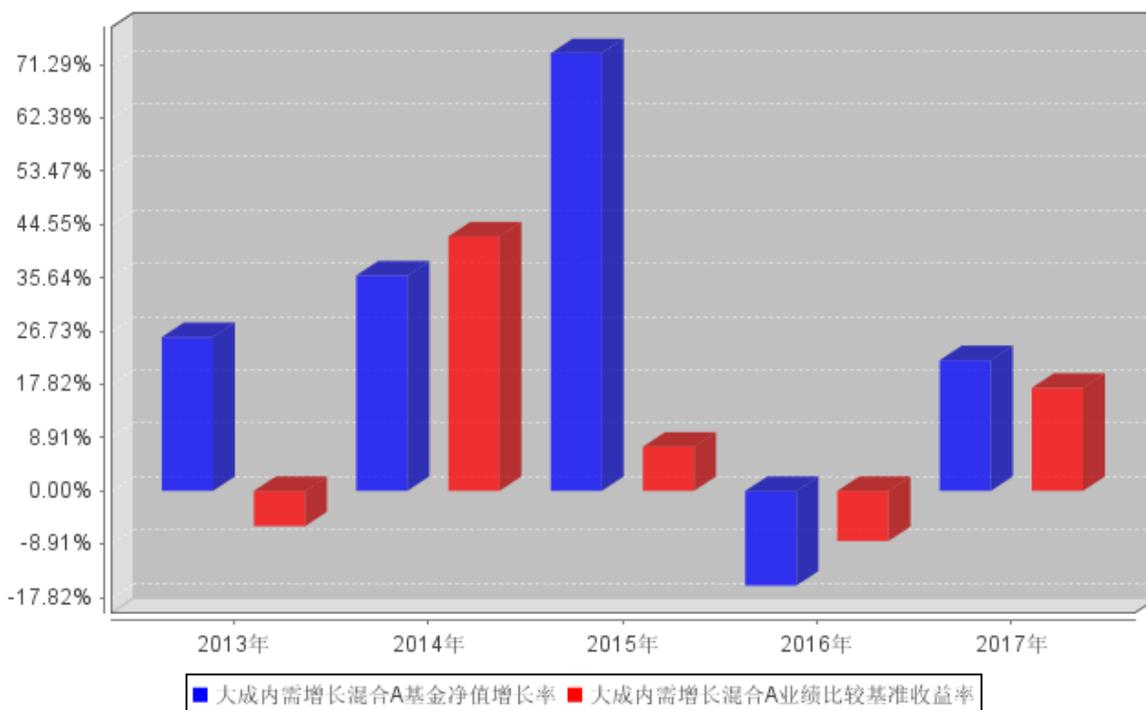


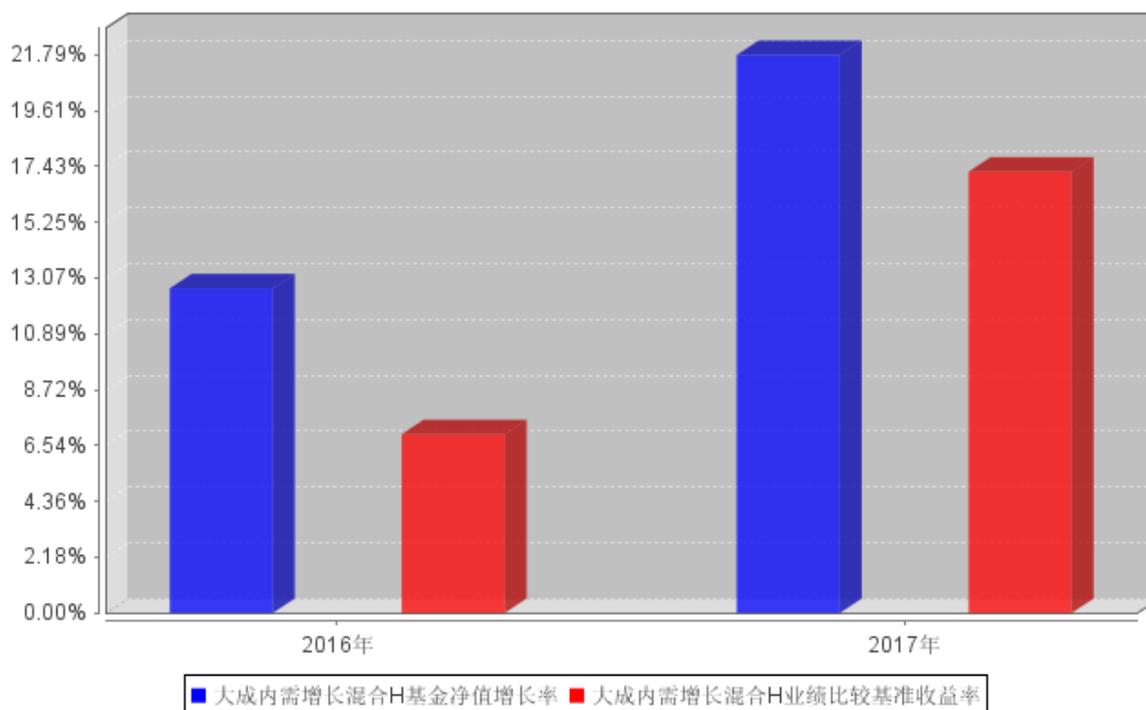


注：1、本基金H类基金份额于2016年3月3日初次确认申购。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告日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。

3.2.3 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





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

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
李本刚先生	本基金基金经理，股票投资部总监	2012年9月4日	-	16年	管理学硕士。2001年至2010年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。2010年8月加入大成基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012年9月4日至2015年7月1日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理，2015年7月2日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2014年4月16日至2015年7月2日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理，2015年7月3日起至2015年10月21日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理。2014年5月14日至2015年5月25日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年9月18日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月13日起任大成景明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。2017 年 12 月 20 日起担任大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部总监。具有基金从业资格。国籍：中国
李博先生	本基金基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	7 年	工学硕士，2009 年 9 月至 2010 年 8 月就职于韩国 SK Telecom 首尔总部；2010 年 8 月至 2011 年 5 月就职于国信证券任研究员；2011 年 5 月起加入大成基金管理有限公司，历任大成基金电子行业、互联网传媒行业分析师、基金经理助理，2014 年 10 月 28 日至 2015 年 4 月 20 日担任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理助理及大成内需增长股票型证券投资基金基金经理助理。2015 年 4 月 21 日起担任大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 4 日起担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

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

回顾 2017 年，市场方向仍然维持从创业板高估值中小股票向主板龙头白马转移，投资选股方向从创新成长转向受益于经济复苏转变。2017 开年以来，制造业、基建、地产投资及出口均有明显向好趋势，一季度 GDP 增长录得 6.9%，实现近年新高，叠加微观层面企业利润明显改善，盈利

取代流动性成为推动市场走强的核心驱动因素，周期股、一带一路主题在 1-2 月份均有较好表现。二季度，随着市场对于经济复苏的充分预期，叠加政策利率抬升、金融监管持续走强等因素，流动性取代盈利成为市场核心变量，追求确定性成为优先选择，以家电和白酒龙头为代表的一线蓝筹成为上涨主力，并在后期由一线蓝筹向估值盈利匹配的二线蓝筹扩散。三季度后，在需求层面大体维持稳定（地产投资小幅下滑、制造业小幅回升、基建稳定，出口回升），金融去杠杆后流动性边际宽松的环境下，叠加去产能及环保约束，供需缺口扩大导致 PPI 环比重回正增长，围绕盈利增长的周期成为市场的最大主线。4 季度维持了 A 股市场的剧烈的风格分化，在周期性恢复的经济背景下，大小企业的基本面分化，加上金融去杠杆导致的流动性紧缩，17 年 A 股市场的一九分化现象显著。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成内需增长混合 A 基金份额净值为 2.716 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.85%；截至本报告期末大成内需增长混合 H 基金份额净值为 2.716 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.79%；同期业绩比较基准收益率为 17.23%。

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 2018 年，我们认为 2018 年主线索将有变化，名义 GDP 扩张期结束，企业利润整体增速会低于 2017 年。去杠杆继续，但不会是定价逻辑的关键问题。地产销售、地产投资的贡献率都将大概率下降；实体经济已度过转折点，制造业投资将继续修复人口周期迭代驱动“高端制造”和“美好生活”的两大产业链。这也将是我们 18 年重点关注的投资方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、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历，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成内需增长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：大成内需增长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	27,676,802.59	87,342,857.28
结算备付金	2,134,454.65	3,692,803.13
存出保证金	180,680.82	299,003.62
交易性金融资产	431,684,497.46	513,426,972.92
其中：股票投资	431,684,497.46	513,426,972.92
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	20,273,292.57	-
应收利息	10,417.33	15,597.02
应收股利	-	-
应收申购款	573,570.50	318,090.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	482,533,715.92	605,095,324.24
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2017 年 12 月 31 日	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	-	-
应付赎回款	1,206,930.80	291,538.64
应付管理人报酬	596,155.78	765,119.25
应付托管费	99,359.28	127,519.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,165,603.98	1,595,371.06
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	281,786.28	160,880.89
负债合计	3,349,836.12	2,940,429.69
所有者权益:		
实收基金	176,452,446.15	270,166,648.05
未分配利润	302,731,433.65	331,988,246.50
所有者权益合计	479,183,879.80	602,154,894.55
负债和所有者权益总计	482,533,715.92	605,095,324.24

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，大成内需增长基金 A 类基金份额净值 2.716 元，大成内需增长基金 H 类基金份额净值 2.716 元，基金份额总额 176,452,446.15 份，其中大成内需增长基金 A 类基金份额 175,745,552.95 份，大成内需增长基金 H 类基金份额 706,893.20 份。

7.2 利润表

会计主体：大成内需增长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	117,309,668.13	-82,172,380.28
1.利息收入	757,998.12	916,688.59
其中：存款利息收入	675,119.08	916,688.59
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	82,879.04	-
其他利息收入	-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）	65,334,135.73	-9,159,029.93
其中：股票投资收益	61,572,166.42	-10,922,764.53
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	3,761,969.31	1,763,734.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	50,899,015.12	-74,336,031.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	318,519.16	405,992.85
减：二、费用	17,024,696.22	18,714,108.10
1. 管理人报酬	7,695,837.25	9,157,444.71
2. 托管费	1,282,639.64	1,526,240.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,631,899.95	7,637,702.86
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	414,319.38	392,719.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	100,284,971.91	-100,886,488.38
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	100,284,971.91	-100,886,488.38

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成内需增长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）	270,166,648.05	331,988,246.50	602,154,894.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	100,284,971.91	100,284,971.91
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	-93,714,201.90	-129,541,784.76	-223,255,986.66

列)			
其中：1. 基金申购款	77,980,138.05	117,225,742.43	195,205,880.48
2. 基金赎回款	-171,694,339.95	-246,767,527.19	-418,461,867.14
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）	176,452,446.15	302,731,433.65	479,183,879.80
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）	246,913,889.85	407,094,385.24	654,008,275.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-100,886,488.38	-100,886,488.38
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）	23,252,758.20	25,780,349.64	49,033,107.84
其中：1. 基金申购款	181,238,273.53	218,338,285.27	399,576,558.80
2. 基金赎回款	-157,985,515.33	-192,557,935.63	-350,543,450.96
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）	270,166,648.05	331,988,246.50	602,154,894.55

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> </u> 罗登攀	<u> </u> 周立新	<u> </u> 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[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取

得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

(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、基金香港代理人
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

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	353,729,512.54	7.05%	536,148,454.24	10.50%

7.4.4.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.4.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.4.1.4 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。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年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	322,350.82	7.05%	-	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	488,593.26	10.50%	-	0.00%

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	7,695,837.25
其中：支付销售机构的客户维护费	3,025,573.55	3,207,699.28

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 1.50% 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 X 1.50% / 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	1,282,639.64	1,526,240.81

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 X 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

注：本基金本报告期内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

注：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。

7.4.4.4.2 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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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
中国银行	27,676,802.59	632,850.16	87,342,857.28	868,365.17

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

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

7.4.5.1.1 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
600903	贵州燃气	2017 年 12 月 28 日	重大事项	16.86	2018 年 1 月 2 日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
601619	嘉泽新能	2017 年 10 月 31 日	重大事项	7.90	-	-	6,617	8,337.42	52,274.30	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
300659	中孚信息	2017 年 11 月 14 日	重大事项	40.21	-	-	776	9,971.60	31,202.96	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 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	431,684,497.46	89.46
	其中：股票	431,684,497.46	89.46
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	29,811,257.24	6.18
8	其他各项资产	21,037,961.22	4.36
9	合计	482,533,715.92	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	23,946,617.40	5.00
C	制造业	310,349,472.20	64.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	626,646.29	0.13
E	建筑业	38,332,121.02	8.00
F	批发和零售业	4,659,416.33	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	390,079.46	0.08
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	501,521.83	0.10
J	金融业	16,238,444.36	3.39
K	房地产业	18,887,000.00	3.94
L	租赁和商务服务业	2,264,177.20	0.47
M	科学研究和技术服务业	360,448.17	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	118,222.84	0.02

0	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	87,393.69	0.02
R	文化、体育和娱乐业	14,922,936.67	3.11
S	综合	-	0.00
	合计	431,684,497.46	90.09

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：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	600477	杭萧钢构	3,577,579	38,172,767.93	7.97
2	603008	喜临门	2,046,690	37,843,298.10	7.90
3	600196	复星医药	656,400	29,209,800.00	6.10
4	000651	格力电器	532,300	23,261,510.00	4.85
5	600872	中炬高新	814,184	20,159,195.84	4.21
6	601766	中国中车	1,600,000	19,376,000.00	4.04
7	000402	金融街	1,700,000	18,887,000.00	3.94
8	002430	杭氧股份	1,283,328	17,928,092.16	3.74
9	002536	西泵股份	1,135,150	16,471,026.50	3.44
10	000786	北新建材	699,913	15,748,042.50	3.29

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	603008	喜临门	61,878,239.99	10.28
2	000786	北新建材	55,992,885.93	9.30
3	002244	滨江集团	51,897,485.61	8.62
4	002430	杭氧股份	51,891,027.41	8.62
5	002573	清新环境	50,203,545.40	8.34
6	600497	驰宏锌锗	49,030,652.68	8.14
7	600985	雷鸣科化	45,495,369.56	7.56

8	000402	金融街	42,472,319.15	7.05
9	000651	格力电器	41,594,487.00	6.91
10	000858	五粮液	41,338,952.38	6.87
11	002536	西泵股份	39,307,663.70	6.53
12	601601	中国太保	37,476,556.55	6.22
13	601766	中国中车	37,047,757.00	6.15
14	600872	中炬高新	36,669,395.70	6.09
15	600340	华夏幸福	35,539,217.02	5.90
16	600581	八一钢铁	34,469,047.73	5.72
17	000933	神火股份	34,002,486.90	5.65
18	000910	大亚圣象	33,269,426.81	5.53
19	300144	宋城演艺	33,269,269.23	5.53
20	002497	雅化集团	31,998,677.76	5.31
21	600516	方大炭素	31,715,194.75	5.27
22	603993	洛阳钼业	30,924,673.70	5.14
23	600198	大唐电信	30,557,352.93	5.07
24	000597	东北制药	30,542,001.12	5.07
25	600500	中化国际	29,305,909.41	4.87
26	600310	桂东电力	29,001,151.79	4.82
27	600110	诺德股份	28,107,122.79	4.67
28	002640	跨境通	27,829,105.31	4.62
29	600029	南方航空	27,641,488.00	4.59
30	300395	菲利华	27,534,381.62	4.57
31	600585	海螺水泥	25,930,101.36	4.31
32	603377	东方时尚	23,613,945.38	3.92
33	603040	新坐标	23,317,551.55	3.87
34	000903	云内动力	22,934,021.73	3.81
35	300059	东方财富	22,592,311.64	3.75
36	601669	中国电建	22,314,863.00	3.71
37	600282	南钢股份	22,161,151.00	3.68
38	600596	新安股份	21,787,435.79	3.62
39	601636	旗滨集团	21,104,676.49	3.50
40	000968	蓝焰控股	20,584,153.13	3.42
41	300124	汇川技术	20,497,791.32	3.40
42	000671	阳光城	20,438,082.00	3.39
43	002222	福晶科技	20,430,861.00	3.39

44	002496	辉丰股份	20,321,855.78	3.37
45	600196	复星医药	20,112,474.00	3.34
46	601899	紫金矿业	19,907,919.00	3.31
47	601336	新华保险	19,616,547.09	3.26
48	600970	中材国际	19,489,632.57	3.24
49	002509	天广中茂	19,467,064.90	3.23
50	300401	花园生物	19,428,226.09	3.23
51	300203	聚光科技	18,974,531.12	3.15
52	300709	精研科技	18,837,390.73	3.13
53	300056	三维丝	18,724,135.00	3.11
54	603816	顾家家居	18,255,564.12	3.03
55	600219	南山铝业	17,486,448.00	2.90
56	002223	鱼跃医疗	16,932,785.37	2.81
57	000065	北方国际	16,808,732.58	2.79
58	603869	北部湾旅	16,794,838.30	2.79
59	300033	同花顺	16,288,184.02	2.70
60	300349	金卡智能	15,934,926.01	2.65
61	000630	铜陵有色	15,889,773.51	2.64
62	600298	安琪酵母	15,808,883.06	2.63
63	002146	荣盛发展	15,679,227.00	2.60
64	600176	中国巨石	15,303,488.68	2.54
65	002365	永安药业	15,191,917.45	2.52
66	000018	神州长城	15,170,561.05	2.52
67	601611	中国核建	15,139,308.00	2.51
68	002775	文科园林	15,053,698.32	2.50
69	300035	中科电气	14,944,851.00	2.48
70	600409	三友化工	14,844,095.00	2.47
71	600801	华新水泥	14,696,321.12	2.44
72	002294	信立泰	14,663,452.82	2.44
73	002051	中工国际	14,470,407.31	2.40
74	000636	风华高科	14,437,522.22	2.40
75	600477	杭萧钢构	14,160,485.50	2.35
76	603444	吉比特	13,176,394.00	2.19
77	000776	广发证券	12,671,390.00	2.10
78	002353	杰瑞股份	12,665,334.70	2.10
79	600383	金地集团	12,230,603.33	2.03

80	000425	徐工机械	12,116,442.98	2.01
81	601939	建设银行	12,114,474.00	2.01
82	600782	新钢股份	12,060,476.35	2.00

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	601899	紫金矿业	66,910,189.64	11.11
2	000786	北新建材	51,296,605.64	8.52
3	002244	滨江集团	49,971,461.42	8.30
4	002573	清新环境	47,922,310.20	7.96
5	000630	铜陵有色	45,217,836.26	7.51
6	000858	五粮液	43,988,671.04	7.31
7	601601	中国太保	40,501,826.48	6.73
8	002738	中矿资源	39,512,050.49	6.56
9	002430	杭氧股份	39,478,093.53	6.56
10	002497	雅化集团	39,035,661.35	6.48
11	000933	神火股份	37,691,382.04	6.26
12	600340	华夏幸福	37,375,696.66	6.21
13	002683	宏大爆破	37,294,479.73	6.19
14	002640	跨境通	37,208,418.96	6.18
15	600497	驰宏锌锗	36,543,467.79	6.07
16	002050	三花智控	34,459,268.68	5.72
17	000910	大亚圣象	34,316,463.90	5.70
18	600581	八一钢铁	32,826,106.37	5.45
19	600198	大唐电信	30,632,948.94	5.09
20	600110	诺德股份	30,583,422.62	5.08
21	600298	安琪酵母	30,078,289.49	5.00
22	600029	南方航空	28,921,590.22	4.80
23	002777	久远银海	28,282,973.60	4.70
24	600500	中化国际	28,227,510.22	4.69
25	600477	杭萧钢构	26,900,784.58	4.47
26	002536	西泵股份	26,598,667.00	4.42
27	600585	海螺水泥	25,903,613.79	4.30
28	603040	新坐标	25,095,788.93	4.17

29	000597	东北制药	24,765,400.12	4.11
30	600310	桂东电力	24,499,527.78	4.07
31	300447	全信股份	24,447,892.64	4.06
32	601169	北京银行	24,323,634.36	4.04
33	300059	东方财富	24,196,827.20	4.02
34	600985	雷鸣科化	23,914,396.77	3.97
35	603008	喜临门	23,826,870.64	3.96
36	300401	花园生物	23,036,218.32	3.83
37	000903	云内动力	23,018,990.29	3.82
38	601669	中国电建	22,564,966.00	3.75
39	300124	汇川技术	22,563,503.91	3.75
40	603377	东方时尚	22,377,301.22	3.72
41	600219	南山铝业	22,375,069.48	3.72
42	603993	洛阳钼业	22,256,520.52	3.70
43	601600	中国铝业	21,692,612.06	3.60
44	000651	格力电器	21,610,261.17	3.59
45	601611	中国核建	21,352,711.40	3.55
46	000402	金融街	21,214,075.00	3.52
47	601766	中国中车	20,927,964.80	3.48
48	600872	中炬高新	20,812,760.84	3.46
49	600596	新安股份	20,710,588.40	3.44
50	002496	辉丰股份	20,518,093.43	3.41
51	002509	天广中茂	20,494,788.10	3.40
52	000671	阳光城	20,380,049.00	3.38
53	002222	福晶科技	20,123,110.25	3.34
54	000411	英特集团	19,799,851.44	3.29
55	600282	南钢股份	19,516,971.80	3.24
56	300072	三聚环保	19,449,482.60	3.23
57	000636	风华高科	19,437,912.56	3.23
58	002365	永安药业	19,338,532.64	3.21
59	600970	中材国际	19,295,457.92	3.20
60	603816	顾家家居	19,279,871.40	3.20
61	300056	三维丝	18,941,519.76	3.15
62	300203	聚光科技	18,934,618.41	3.14
63	000968	蓝焰控股	18,870,347.08	3.13
64	600516	方大炭素	18,394,110.53	3.05
65	300144	宋城演艺	18,033,773.45	2.99
66	000718	苏宁环球	17,416,243.44	2.89

67	300035	中科电气	17,077,527.00	2.84
68	002223	鱼跃医疗	16,667,099.86	2.77
69	601699	潞安环能	16,643,092.00	2.76
70	600015	华夏银行	16,432,473.92	2.73
71	603869	北部湾旅	16,280,897.48	2.70
72	002051	中工国际	16,220,420.39	2.69
73	300033	同花顺	16,210,853.51	2.69
74	600176	中国巨石	16,202,647.92	2.69
75	000065	北方国际	16,160,288.82	2.68
76	600801	华新水泥	16,123,887.35	2.68
77	300349	金卡智能	15,780,377.51	2.62
78	300395	菲利华	15,683,426.80	2.60
79	002146	荣盛发展	15,527,323.52	2.58
80	603444	吉比特	15,201,962.00	2.52
81	000018	神州长城	14,741,684.90	2.45
82	300364	中文在线	14,535,355.43	2.41
83	600409	三友化工	14,321,165.25	2.38
84	002775	文科园林	14,085,695.82	2.34
85	600111	北方稀土	12,672,762.41	2.10
86	000513	丽珠集团	12,561,302.20	2.09
87	002353	杰瑞股份	12,440,918.27	2.07
88	000776	广发证券	12,194,674.00	2.03
89	600782	新钢股份	12,109,558.28	2.01
90	000425	徐工机械	12,066,500.00	2.00

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	2,416,893,446.30
卖出股票收入（成交）总额	2,611,107,103.30

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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

注：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

注：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

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

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**

注：本基金本报告期末无股指期货持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险。

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**

注：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

注：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

注：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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，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	180,680.82
2	应收证券清算款	20,273,292.57
3	应收股利	-

4	应收利息	10,417.33
5	应收申购款	573,570.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,037,961.22

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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

注：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
大成内需增长混合 A	24,838	7,075.67	135,266.65	0.08%	175,610,286.30	99.92%
大成内需增长混合 H	8	88,361.65	706,893.20	100.00%	-	0.00%
合计	24,846	7,101.85	842,159.85	0.48%	175,610,286.30	99.52%

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	大成内需增长混合 A	175,239.14	0.0997%
	大成内需增长混合 H	-	0.0000%
	合计	175,239.14	0.0993%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成内需增长混合 A	0
	大成内需增长混合 H	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成内需增长混合 A	0
	大成内需增长混合 H	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成内需增长混合 A	大成内需增长混合 H
基金合同生效日（2011 年 6 月 14 日）基金份额总额	1,429,930,353.67	-
本报告期期初基金份额总额	270,111,196.69	55,451.36
本报告期基金总申购份额	75,828,636.13	2,151,501.92
减：本报告期基金总赎回份额	170,194,279.87	1,500,060.08
本报告期期末基金份额总额	175,745,552.95	706,893.20

§ 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，由公司总工程师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

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），本会计期间应支付的审计费用为 80,000.00 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	
中信建投		1948,090,706.05	18.88%	864,013.41	18.88%	-
东方证券		1579,572,182.69	11.54%	528,158.46	11.54%	-
长江证券		1544,004,797.94	10.84%	495,739.20	10.83%	-
光大证券		2353,729,512.54	7.05%	322,350.82	7.05%	-
申万宏源		1323,677,289.00	6.45%	294,984.87	6.45%	-
国泰君安		1276,499,355.86	5.51%	251,992.35	5.51%	-

安信证券	2	254,453,176.61	5.07%	231,898.17	5.07%	-
国信证券	1	235,444,714.78	4.69%	214,580.97	4.69%	-
中信证券	2	228,070,936.40	4.54%	207,834.70	4.54%	-
华泰证券	2	195,990,358.89	3.90%	178,619.24	3.90%	-
海通证券	2	193,013,183.86	3.84%	175,889.47	3.84%	-
方正证券	1	171,675,030.60	3.42%	156,465.77	3.42%	-
中航证券	1	161,329,270.18	3.21%	147,024.39	3.21%	-
西南证券	1	147,394,361.15	2.94%	134,315.73	2.94%	-
渤海证券	1	118,350,276.88	2.36%	107,857.89	2.36%	-
中泰证券	1	113,039,441.65	2.25%	103,014.45	2.25%	-
中金公司	2	85,892,166.25	1.71%	78,271.91	1.71%	-
平安证券	1	47,642,184.20	0.95%	43,426.05	0.95%	-
恒泰证券	1	34,769,098.12	0.69%	31,684.26	0.69%	-
广发证券	1	7,973,040.00	0.16%	7,265.84	0.16%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

中投证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	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：

本报告期内本基金新增交易单元：无。

本报告期内本基金退租交易单元：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

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
长江证券	-	0.00%	211,000,000.00	100.00%	-	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