

# 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 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	148,919,838.60 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

### 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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦

## 2.5 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	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	14,925,133.68	696,093.18	14,360,385.22
本期利润	22,404,806.74	12,895,884.41	2,012,178.93
加权平均基金份额本期利润	0.1328	0.2419	0.0415
本期基金份额净值增长率	9.03%	18.15%	2.35%
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	0.4740	0.4264	0.4397
期末基金资产净值	260,221,752.56	240,760,344.44	49,342,400.60
期末基金份额净值	1.747	1.645	1.440

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。

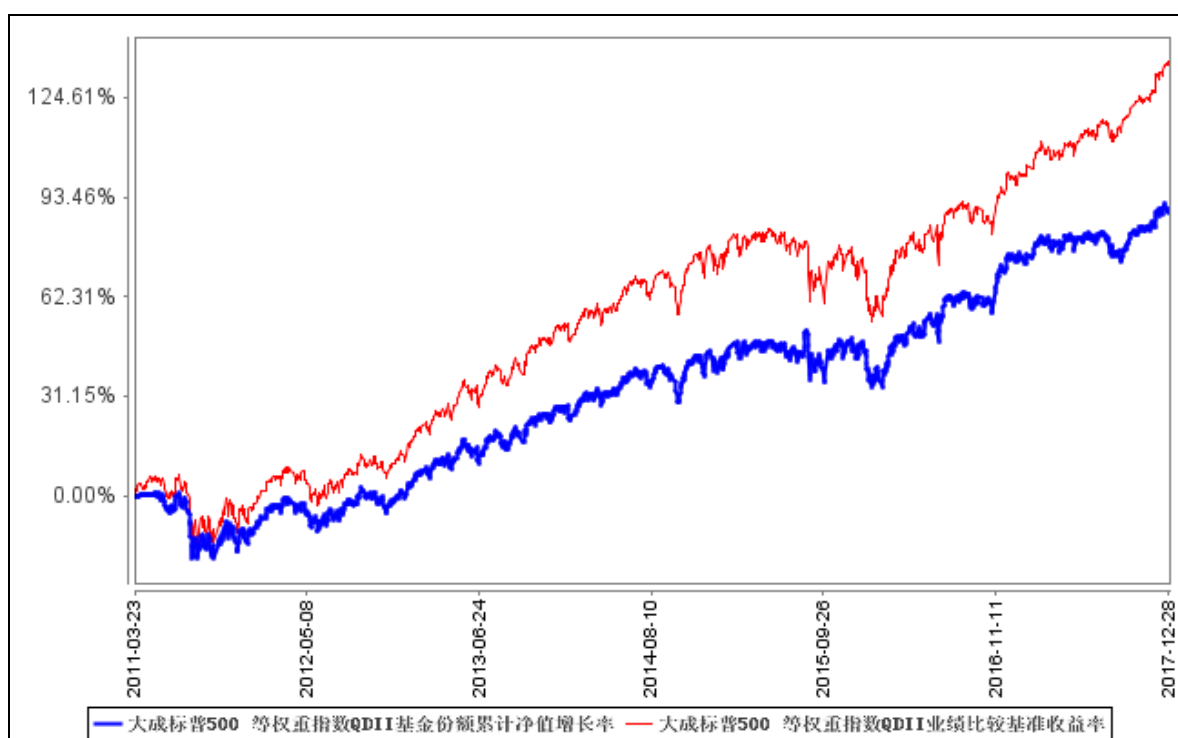
### 3.2 基金净值表现

#### 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	3.86%	0.44%	6.22%	0.38%	-2.36%	0.06%
过去六个月	4.86%	0.48%	10.04%	0.42%	-5.18%	0.06%
过去一年	9.03%	0.49%	18.90%	0.46%	-9.87%	0.03%
过去三	31.85%	0.81%	33.49%	0.85%	-1.64%	-0.04%

年						
过去五年	87.79%	0.77%	108.10%	0.81%	-20.31%	-0.04%
自基金合同生效起至今	88.73%	0.94%	134.69%	0.99%	-45.96%	-0.05%

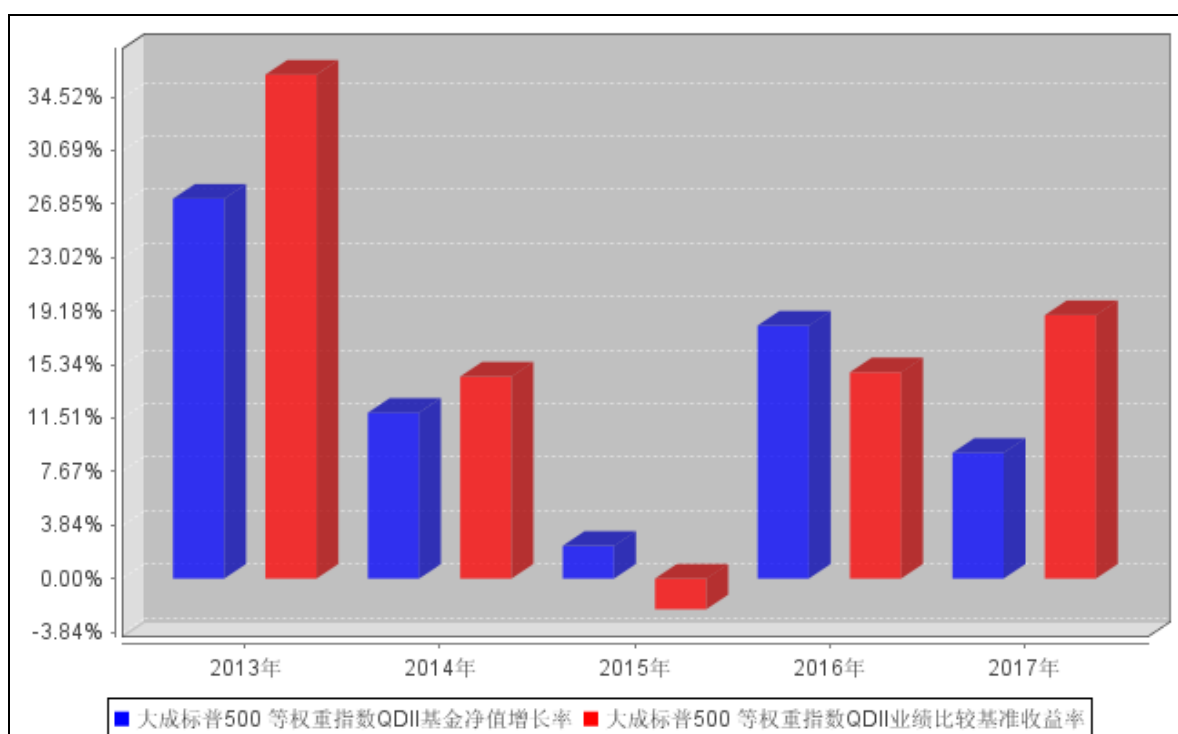
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、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，建仓期结束时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。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

### 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

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	0.4290	4,440,150.43	2,775,948.34	7,216,098.77	
2016	0.4400	719,098.30	794,654.18	1,513,752.48	
2015	0.1870	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	
合计	1.0560	5,896,204.49	4,181,325.08	10,077,529.57	

## § 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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	14 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员；2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起担任大成标普 500 等权重指数型证券投资



					<p>资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起担任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起担任大成恒生综合中小型股指数基金 (QDII-LOF) 基金经理。2016 年 12 月 29 日起担任大成海外中国机会混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 8 月 10 日起担任大成恒生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，国际宏观经济以较快速度增长，美国宏观经济也保持了快速增长的势头。

从经济周期来看，美国仍然处于本轮经济增长的中后期进程中，持续的技术创新导致其国际经济竞争力保持高位，同时经济复苏也导致了国内需求强盛。

首先，个人消费增长保持旺盛，这是美国经济增长的基石，不断增长的个人收入及保持高位的消费者信心指数保障了个人消费的持续增长。年内劳动力市场非常旺盛，失业率在 12 月份已经降至 4.1%，创出了金融海啸以来的最低值。同时，繁荣的劳动力市场又促使美国个人消费增长保

持旺盛，这使得美国经济处于良性循环过程中。

其次，房地产市场保持繁荣，虽然美国房价已超金融危机前高点，但我们认为美国房地产市场还有较大上涨空间。美国自有住房率当前在 64%，仍处于 30 年的低位。因此，房地产市场总体仍有上行空间，这也为美国经济增长奠定了基础。

美国 ISM 指数也在年内保持高位，并创出了金融危机之后的新高，这表明近期美国制造业的复苏正在持续展开。

由于上述因素的推动，美国 2017 年的实际 GDP 同比增速为 2.5%，保持在稳健增长的水平上。

由于宏观经济表现较好，美联储在年内启动了缩表进程，并在年内加息三次，而缩表与加息行为没有对宏观经济及股票市场产生较大的负面影响。

由于宏观经济的较佳表现，本基金的标的指数在年内创出了新高。但是，美元指数及美元汇率表现疲弱，这也一定程度的抵消了本基金的涨幅。

#### 4.5.2 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 1.747 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.03%，业绩比较基准收益率为 18.90%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，美国仍然处于本轮经济增长的中后期进程中，预计美国宏观经济还会保持快速增长的势头。

2017 年末，影响深远的美国大规模税改法案得以通过，并于 2018 年 1 月开始实施。减税是特朗普作出的诸多竞选承诺之一，该法案的通过及实施能有效巩固他的执政基础。2018 年开始实施的减税政策，首先将直接增加上市公司净利润，降低美股的估值水平；其次，个人可支配收入的提高会促进消费的增长；再次，企业税收的降低有望增强企业投资意愿。因此，减税有望提高 2018 年经济增长速度，利好美国经济。

美国良好的宏观经济前景及企业所得税率的降低将会继续促使企业盈利快速增长，预期 2018 年企业盈利增速在年化 15%左右。同时，当前标普 500 指数的预期市盈率为 18 倍左右，基本位于正常的市盈率区间，因此，企业盈利的增加有望推动美股指数的增长。

2018 年美联储预计还会继续采取加息及缩表的行动。但是，由于美股是基本面市场，资金面的变动不会对宏观经济及股票市场产生较大的负面影响。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，

力争将跟踪误差控制在较低的水平。

#### 4.7 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数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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 7,216,098.77 元（每十份基金份额分红 0.429 元），符合基金合同规定的分红比例。

#### 4.10 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”）在大成标普 500 等权重指数证券投资基金（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：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	19,639,900.00	46,759,665.83
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	242,240,870.71	196,683,439.44
其中：股票投资	242,240,870.71	196,683,439.44
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	1,873.38	3,906.74
应收股利	296,914.38	216,849.79
应收申购款	2,189,484.60	6,588,685.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	314,640.55	-
资产总计	264,683,683.62	250,252,547.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>



<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	6,430,627.86
应付赎回款	3,971,308.85	2,741,103.50
应付管理人报酬	216,369.14	152,261.85
应付托管费	54,092.28	38,065.47
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	220,160.79	130,144.24
负债合计	4,461,931.06	9,492,202.92
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	148,919,838.60	146,373,605.04
未分配利润	111,301,913.96	94,386,739.40
所有者权益合计	260,221,752.56	240,760,344.44
负债和所有者权益总计	264,683,683.62	250,252,547.36

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.747 元，基金份额总额 148919838.6 份。

## 7.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017	2016 年 1 月 1 日至 2016 年

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
<b>一、收入</b>	26,653,479.76	14,454,542.91
1. 利息收入	62,964.49	27,610.82
其中：存款利息收入	62,964.49	27,610.82
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）	20,066,910.44	2,432,297.03
其中：股票投资收益	13,919,772.43	617,262.35
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	6,147,138.01	1,815,034.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,479,673.06	12,199,791.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,337,570.42	-289,068.89
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	381,502.19	83,912.72
<b>减：二、费用</b>	4,248,673.02	1,558,658.50
1. 管理人报酬	2,818,757.01	792,175.38
2. 托管费	704,689.24	198,043.92
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	89,147.00	46,183.84
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	636,079.77	522,255.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	22,404,806.74	12,895,884.41

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	22,404,806.74	12,895,884.41

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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）	146,373,605.04	94,386,739.40	240,760,344.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	22,404,806.74	22,404,806.74
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）	2,546,233.56	1,726,466.59	4,272,700.15
其中：1. 基金申购款	196,670,215.20	131,158,801.42	327,829,016.62
2. 基金赎回款	-194,123,981.64	-129,432,334.83	-323,556,316.47
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）	-	-7,216,098.77	-7,216,098.77
五、期末所有者权益（基金净值）	148,919,838.60	111,301,913.96	260,221,752.56

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）	34,272,035.33	15,070,365.27	49,342,400.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,895,884.41	12,895,884.41
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）	112,101,569.71	67,934,242.20	180,035,811.91
其中：1. 基金申购款	153,135,670.72	89,970,669.81	243,106,340.53
2. 基金赎回款	-41,034,101.01	-22,036,427.61	-63,070,528.62
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）	-	-1,513,752.48	-1,513,752.48
五、期末所有者权益（基金净值）	146,373,605.04	94,386,739.40	240,760,344.44

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
周立新

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
崔伟

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

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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 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
中国银行(香港)股份有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
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”)	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

注：本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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	2,818,757.01	792,175.38
其中：支付销售机构的客户维护费	1,098,116.50	289,621.15

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 1.00% 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 1.00% / 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	704,689.24	198,043.92

的托管费		
------	--	--

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：本报告期及上年度可比期间内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

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
	中银香港	10,132,607.72	-	6,978,643.09
中国银行	9,507,292.28	62,964.49	39,781,022.74	26,988.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 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：本报告期及上年度可比期间内本基金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

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**

注：于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### **7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：于本报告期末，本基金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**

注：无。



## § 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	242,240,870.71	91.52
	其中：普通股	242,240,870.71	91.52
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
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	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	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
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	19,639,900.00	7.42
8	其他各项资产	2,802,912.91	1.06
9	合计	264,683,683.62	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	242,240,870.71	93.09
合计	242,240,870.71	93.09

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

## 8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
消费者非必需品	39,079,437.09	15.02
工业	33,648,264.82	12.93
信息技术	32,325,881.15	12.42
金融	32,245,981.82	12.39
医疗保健	29,568,441.08	11.36
消费者常用品	16,568,858.50	6.37
能源	16,418,473.78	6.31
房地产	15,829,113.36	6.08
公用事业	12,632,207.41	4.85
基础材料	12,363,972.15	4.75
电信服务	1,560,239.55	0.60
合计	242,240,870.71	93.09

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英)	公司名称(中)	证券代码	所在证	所属国	数量	公允价值	占基
----	---------	---------	------	-----	-----	----	------	----

	文)	文)		券市场	家(地 区)	(股)		金资 产净 值比 列 (%)
1	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交 易所	美国	438	612,635.35	0.24
2	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克默 伦股份有限公 司	FCX UN	纽约交 易所	美国	4,936	611,513.30	0.23
3	Akamai Technologie s Inc	阿卡迈技术公 司	AKAM UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,307	555,454.57	0.21
4	FMC Technologie s Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交 易所	美国	2,702	552,790.84	0.21
5	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交 易所	美国	1,571	550,626.84	0.21
6	CenturyLink Inc	世纪电信公司	CTL UN	纽约交 易所	美国	5,037	548,984.93	0.21
7	Coty Inc.	科蒂集团	COTY UN	纽约交 易所	美国	4,156	540,135.53	0.21
8	Marathon Oil Corp	Marathon 石油 公司	MRO UN	纽约交 易所	美国	4,877	539,513.28	0.21
9	Arconic Inc	Arconic 公司	ARNC UN	纽约交 易所	美国	3,020	537,731.99	0.21
10	Helmerich &	赫尔默里奇&	HP UN	纽约交	美国	1,273	537,677.89	0.21

	Payne Inc	佩恩公司		易所			
--	-----------	------	--	----	--	--	--

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。

#### 8.4.1 积极投资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益投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

### 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Advanced Micro Devices	AMD UQ	864,566.44	0.36
2	Incyte Corp	INCY UQ	859,861.62	0.36
3	DISH Network Corp A	DISH UQ	812,926.79	0.34
4	Regency Centers Corp	REG UN	694,956.48	0.29
5	Range Resources Corp	RRC UN	679,356.15	0.28
6	Gartner Inc	IT UN	661,727.64	0.27
7	IHS Markit Ltd	INFO UQ	655,050.25	0.27
8	Alexandria Real Estate Eqty	ARE UN	650,855.70	0.27
9	Everest Re Group Ltd	RE UN	647,930.91	0.27
10	Synopsys Inc	SNPS UQ	636,340.55	0.26

11	Baker Hughes Inc	BHGE UN	623,127.07	0.26
12	Cboe Global Markets, Inc	CBOE UQ	619,316.27	0.26
13	Raymond James Financial Inc	RJF UN	618,243.19	0.26
14	IDEXX Laboratories Inc	IDXX UQ	615,517.26	0.26
15	Signet Jewelers Ltd	SIG UN	599,498.29	0.25
16	Envision Healthcare Corp	EVHC UN	596,083.59	0.25
17	Duke Realty Corp	DRE UN	587,469.41	0.24
18	Chesapeake Energy Corp	CHK UN	585,657.10	0.24
19	ResMed Inc	RMD UN	576,109.33	0.24
20	Mattel Inc	MAT UQ	565,926.74	0.24

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。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	Whole Foods Market Inc	WFM UQ	862,116.87	0.36
2	ALTABA INC	AABA UQ	776,334.16	0.32
3	Mead Johnson Nutrition Co	MJN UN	738,682.96	0.31
4	DowDuPont Inc.	DWDP UN	715,757.98	0.30

5	Staples Inc	SPLS UQ	699,495.23	0.29
6	Mallinckrodt plc	MNK UN	660,112.46	0.27
7	Dun & Bradstreet Corp	DNB UN	639,862.16	0.27
8	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UQ	637,882.80	0.26
9	Southwestern Energy Co	SWN UN	637,451.77	0.26
10	AutoNation Inc	AN UN	622,351.90	0.26
11	Murphy Oil Corp	MUR UN	621,382.85	0.26
12	Harman Intl Industries Inc	HAR UN	611,951.16	0.25
13	Nvidia Corp	NVDA UQ	610,054.94	0.25
14	Teradata Corp	TDC UN	607,433.53	0.25
15	NRG Energy	NRG UN	596,447.18	0.25
16	Transocean Ltd	RIG UN	573,018.49	0.24
17	Micron Technology Inc	MU UQ	571,354.73	0.24
18	Enbridge Inc	ENB UN	568,591.21	0.24
19	Ryder System Inc	R UN	551,276.08	0.23
20	Activision Blizzard Inc	ATVI UQ	546,339.26	0.23

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。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	156,728,123.09
卖出收入（成交）总额	132,571,116.16

**8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

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五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**8.8 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。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细**

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

注：本基金本报告期末未持有基金。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1** 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。

**8.11.2** 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。

**8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	296,914.38
4	应收利息	1,873.38
5	应收申购款	2,189,484.60
6	其他应收款	314,640.55
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,802,912.91
---	----	--------------

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

##### 8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 8.11.6 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

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
40,186	3,705.76	2,695,886.90	1.81%	146,223,951.70	98.19%

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	178,008.58	0.1197%

### 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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	146,373,605.04
本报告期基金总申购份额	196,670,215.20
减:本报告期基金总赎回份额	194,123,981.64
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	148,919,838.60

## § 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

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），

本年度支付的审计费用为 5 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、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	
摩根士丹利		289,446,498.53	100.00%	86,132.18	100.00%	-

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，本公司制定了租用境内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、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- （一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- （二）资历雄厚，信誉良好；
- （三）财务状况良好，经营行为规范；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；
- （五）证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面

地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；

（六）具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

（七）具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

（八）能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

（九）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。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括：长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、湘财证券、银河证券、招商证券、申银万国、中银国际、东莞证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券、天源证券、广发证券、西南证券、华福证券、齐鲁证券、民生证券、万联证券、东海证券、万和证券、华鑫证券、东吴证券、国海证券、华林证券、英大证券、民族证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无新增的境内交易单元，退租境内交易单元：渤海证券、中投证券；无新增或退租境外交易单元。

### 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

注：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

注：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