

大成积极成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。

大成积极成长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由景业证券投资基金转型而来。基金转型经 2006 年 12 月 11 日景业证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会 2006 年 12 月 27 日证监基金字[2006]263 号文核准。自 2007 年 1 月 16 日起，由《景业证券投资基金基金合同》修订而成的《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》生效。自基金合同生效以来本基金运作平稳。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》（以下简称“《运作办法》”）的有关规定，经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 3 日起本基金名称变更为“大成积极成长混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成积极成长混合”；基金类别变更为“混合型”。基金代码保持不变，仍为 519017。上述事项已报中国证监会备案。因上述变更基金名称及基金类别事宜，基金管理人对《基金合同》和《托管协议》的相关条款进行了相应修改。在修改过程中，基金管理人根据《运作办法》和基金运作实际情况，对《基金合同》的部分条款进行了必要的调整。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。

按照基金合同约定，本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形，不需要召开基金份额持有人大会。本基金更名后，《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》、《大成积极成长股票型证券投资基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成积极成长混合型证券投资基金承担和继承。

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	大成积极成长混合
基金主代码	519017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 1 月 16 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	903, 276, 023. 98 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在优化组合投资基础上，主要投资于有良好成长潜力的上市公司，尽可能规避投资风险，谋求基金财产长期增值。
投资策略	本基金主要根据 GDP 增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A 股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数 CPI 增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标以及国家政策的变化，对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量、定性分析，作出资产配置决策。本基金还力争通过财务指标分析、成长型筛选、估值比较、实地调研等深入、科学的基本面分析，挖掘具有良好成长性的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 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，属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	http://www.dcfund.com.cn

址	
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 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	121,848,031.57	18,781,206.42	978,349,900.11
本期利润	190,235,325.15	-163,936,355.92	982,375,624.64
加权平均基金份额本期利润	0.1840	-0.1535	0.9413
本期基金份额净值增长率	18.17%	-9.01%	72.26%
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	0.2232	0.0922	0.7680
期末基金资产净值	1,104,865,117.48	1,225,586,571.85	1,531,759,397.82
期末基金份额净值	1.223	1.092	1.768

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。

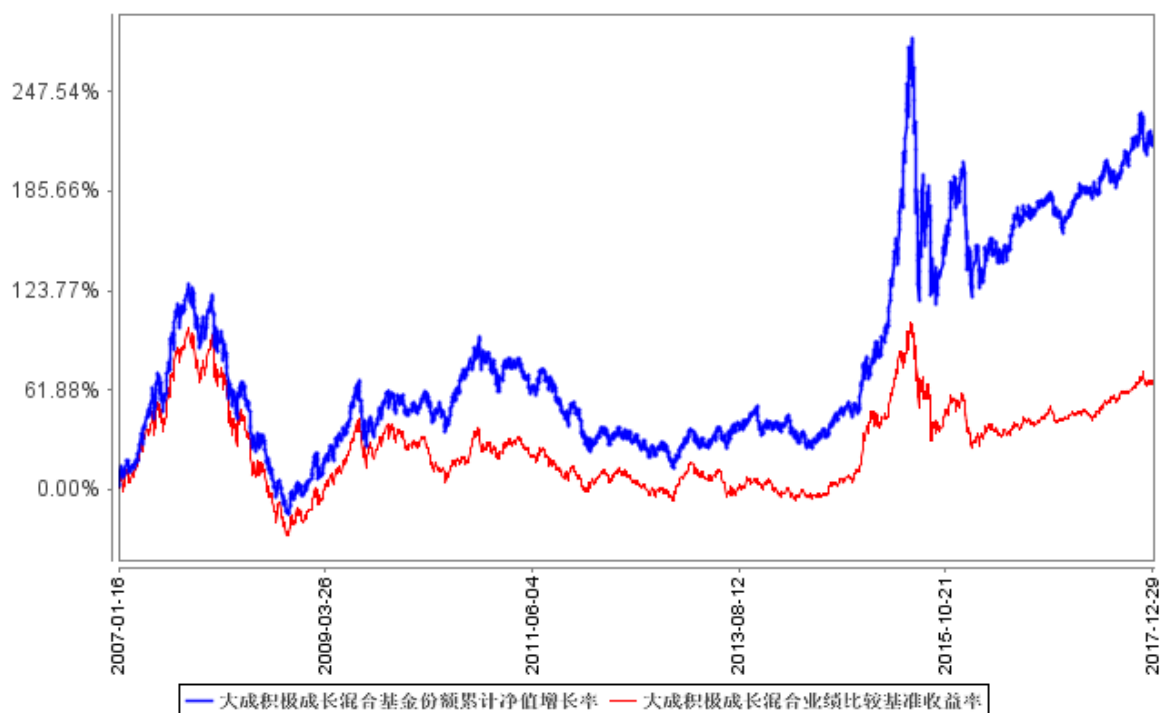
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	3.82%	1.16%	3.97%	0.64%	-0.15%	0.52%
过去六个月	5.25%	0.97%	7.96%	0.56%	-2.71%	0.41%
过去一年	18.17%	0.81%	17.23%	0.51%	0.94%	0.30%
过去三年	85.22%	1.86%	15.30%	1.35%	69.92%	0.51%
过去五年	151.78%	1.62%	54.69%	1.24%	97.09%	0.38%
自基金合同生效起至今	209.84%	1.65%	67.07%	1.45%	142.77%	0.20%

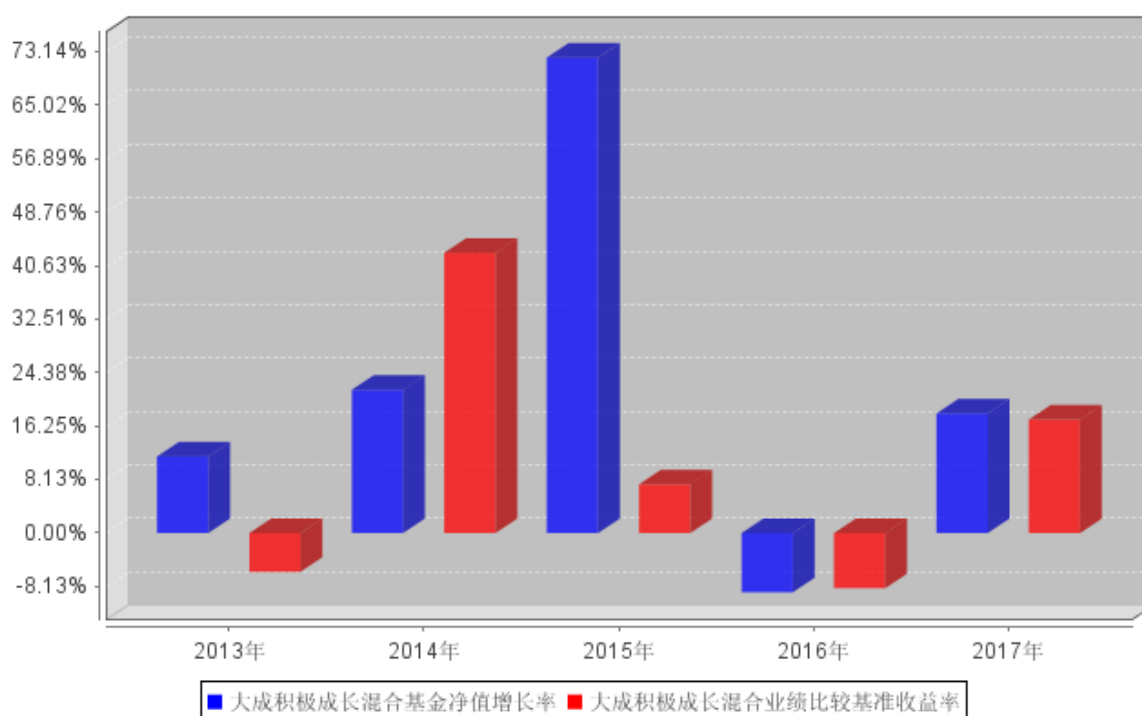
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、按基金合同规定，大成积极成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起 3 个月内为建仓期。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比例。

2、本基金业绩比较基准自 2009 年 2 月 2 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中证综合债券指数×20%，本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从 2007 年 1 月 15 日（基金合同生效暨基金转型日）至 2009 年 2 月 1 日为原业绩比较基准（新华富时 600 成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%）的走势，2009 年 2 月 2 日起为变更后的业绩比较基准的走势。

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	0.5550	33,593,654.34	28,598,171.46	62,191,825.80	
2016	4.6090	244,971,522.59	168,744,409.19	413,715,931.78	
2015	0.3810	30,501,798.38	24,326,867.64	54,828,666.02	
合计	5.5450	309,066,975.31	221,669,448.29	530,736,423.60	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
齐炜中先生	本基金基金经理助理	2017 年 2 月 20 日	-	5 年	英国约克大学金融学硕士研究生。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员、社保基金及机构投资部基金经理助理。自 2017 年 2 月 20 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国
孙蓓琳女士	本基金基金经理	2015 年 7 月 3 日	2017 年 6 月 15 日	13 年	经济学硕士。2004 年 7 月至 2007 年 7 月就职于银华基金管理有限公司，历任宏观研究员、行业研究员。2007 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理、研究部

					副总监、股票投资部混合组投资总监。2012 年 7 月 28 日至 2014 年 1 月 29 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2012 年 12 月 18 日至 2015 年 7 月 2 日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 3 日至 2017 年 6 月 15 日任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理，2015 年 9 月 29 日至 2017 年 6 月 15 日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
王磊先生	本基金基金经理	2017 年 6 月 9 日	-	13 年	经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金

					<p>经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2014 年 12 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 11 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起担任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 9 日起担任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 21 日起担任大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日起担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
张文平先生	本基金基金经理助理，固收研究部（隶属固定收益总部）副总监	2016 年 5 月 23 日	-	6 年	<p>南京大学管理学硕士，注册会计师，证券从业年限 6 年。2009 年 10 月至 2011 年 5 月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部；2011 年起加入大成基金管理有限公司，曾任固定收益部助理研究员，现任固定收益总部研究部副总监。2013 年 11 月 25 日至 2015 年 3 月 5 日担任大成景祥分级债券</p>

				<p>型证券投资基金基金经理助理。2015 年 3 月 7 日至 2016 年 11 月 18 日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 23 日至 2018 年 3 月 16 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 1 日至 2017 年 3 月 18 日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2015 年 7 月 1 日至 2018 年 3 月 16 日任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2018 年 3 月 16 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 5 月 23 日至 2018 年 3 月 12 日任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金和大成优选混合型证券投资基金基金经理助理。2016 年 8 月 6 日至 2018 年 3 月 16 日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 6 日至 2018 年 3 月 16 日任大成景安短融债券型证券投资基</p>
--	--	--	--	---

					金基金经理。2016 年 9 月 6 日至 2018 年 3 月 6 日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 20 日至 2018 年 3 月 16 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资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，我国的宏观经济呈现几个较为明显的特点。首先是国家在部分的强周期行业，如钢铁、化工、煤炭，实施坚决的去产能政策。这个政策收到了较为明显的效果，一是行业集中度大幅上升，生产效率得以提升，二是环保问题得到了有效治理。同时，国家在金融领域实施了坚定的去杠杆政策，促使资金脱虚向实，提升金融体系对于实体经济的支持力度。在国家一系列宏观经济政策的实施下，我国的经济在 2017 年呈现了企稳回升的态势，人民币汇率也保持了稳定。

对应到 A 股市场，在国家宏观经济企稳回升，周期行业盈利大幅增长的情况下，我国的 A 股市场整体呈现了较为明显的涨幅，其中，银行、保险、食品饮料、家电、煤炭、钢铁等传统的低估值品种涨幅较好。但需要关注的是，由于前期涨幅过高且估值还处于高位，以及监管机构对于游资炒作等行为的打击，中小市值的股票整体上承受了较大的压力，2017 年整体表现不佳。全年来看，上证综指全年上涨 6.56%，上证 50 上涨 25.08%，而创业板指数下跌 10.67%。

2017 年全年，本产品增加了部分优质成长股的配置，全年获得了 18.17% 的收益。

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 1.223 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.17%，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

2018 年，我们认为，我国会在基础设施建设、一带一路、科技创新、民生福利等领域加大投入，并拉动经济上行。与此同时，国家的去产能政策以及金融领域的去杠杆政策仍将坚决实施，对于证券市场的强监管政策仍将延续。在这种情况下，我们认为，2018 年行情仍然呈现分化的行情，低估值蓝筹仍将是行情的主流，高估值且确定性不高的中小市值股票仍然存在一定的压力。我们将根据市场的情况，主动积极的做好行业和个股选择，争取获得较好回报。

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。本报告期内已分配利润 62,191,825.80 元（每十份基金份额分红 0.555 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：大成积极成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	108,065,089.33	149,743,546.44
结算备付金	2,119,176.92	2,901,840.63
存出保证金	802,558.99	664,032.79
交易性金融资产	952,865,061.36	994,534,518.62
其中：股票投资	952,865,061.36	994,534,518.62
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	49,970,194.96	49,980,194.97
应收证券清算款	-	-
应收利息	59,968.99	57,333.33
应收股利	-	-
应收申购款	39,229.89	50,117,474.82
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	1,116,805,793.08	1,250,883,454.24
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	5,469,030.50	18,675,726.54
应付赎回款	297,345.17	500,031.42
应付管理人报酬	1,397,994.36	1,527,172.34
应付托管费	232,999.04	254,528.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,057,561.12	952,770.33
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,485,745.41	3,386,653.04
负债合计	11,940,675.60	25,296,882.39
所有者权益：		
实收基金	903,276,023.98	1,122,110,449.31
未分配利润	201,589,093.50	103,476,122.54
所有者权益合计	1,104,865,117.48	1,225,586,571.85
负债和所有者权益总计	1,116,805,793.08	1,250,883,454.24

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.223 元，基金份额总额 903,276,023.98 份。

7.2 利润表

会计主体：大成积极成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	220,803,703.51	-135,208,342.56
1. 利息收入	1,777,263.88	1,795,335.56
其中：存款利息收入	1,292,944.79	1,577,191.19
债券利息收入	-	6,788.80
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	484,319.09	211,355.57
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	150,322,204.42	45,594,315.10
其中：股票投资收益	138,305,683.32	40,229,920.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	162,713.87
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	12,016,521.10	5,201,680.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	68,387,293.58	-182,717,562.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	316,941.63	119,569.12
减：二、费用	30,568,378.36	28,728,013.36
1. 管理人报酬	17,524,776.79	17,195,467.28
2. 托管费	2,920,796.07	2,865,911.26
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	9,658,265.53	8,210,644.32
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	464,539.97	455,990.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	190,235,325.15	-163,936,355.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	190,235,325.15	-163,936,355.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成积极成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）	1,122,110,449.31	103,476,122.54	1,225,586,571.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	190,235,325.15	190,235,325.15
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）	-218,834,425.33	-29,930,528.39	-248,764,953.72
其中：1. 基金申购款	138,230,382.60	12,435,443.84	150,665,826.44
2. 基金赎回款	-357,064,807.93	-42,365,972.23	-399,430,780.16
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）	-	-62,191,825.80	-62,191,825.80
五、期末所有者权益（基金净值）	903,276,023.98	201,589,093.50	1,104,865,117.48
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）	866,358,355.29	665,401,042.53	1,531,759,397.82
二、本期经营活动产生的	-	-163,936,355.92	-163,936,355.92

基金净值变动数（本期利润）			
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）	255,752,094.02	15,727,367.71	271,479,461.73
其中：1. 基金申购款	391,617,411.61	26,008,496.19	417,625,907.80
2. 基金赎回款	-135,865,317.59	-10,281,128.48	-146,146,446.07
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）	-	-413,715,931.78	-413,715,931.78
五、期末所有者权益（基金净值）	1,122,110,449.31	103,476,122.54	1,225,586,571.85

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、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

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	407,549,596.38	6.42%	750,122,598.88	13.86%

7.4.4.1.2 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
光大证券	120,000,000.00	25.26%	-	0.00%

7.4.4.1.3 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。

7.4.4.1.4 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	371,404.13	6.42%	109,112.78	10.32%
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	683,606.90	13.86%	18,278.51	1.93%

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	17,524,776.79	17,195,467.28
其中：支付销售机构的客户维护费	2,957,846.53	2,895,060.21

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 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	2,920,796.07	2,865,911.26

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 0.25%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。

7.4.4.4.2 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
中国农业银行	108,065,089.33	1,234,565.36	149,743,546.44	1,522,415.78

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

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

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
002466	天齐锂业	2017 年 12 月 26 日	2018 年 1 月 3 日	增发流通受限	11.06	53.21	101,333	1,120,742.98	5,391,928.93	-
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
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	-
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	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事项	7.62	-	-	24	268.63	182.88	-

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**

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

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	952,865,061.36	85.32
	其中：股票	952,865,061.36	85.32
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	49,970,194.96	4.47
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	110,184,266.25	9.87
8	其他各项资产	3,786,270.51	0.34
9	合计	1,116,805,793.08	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	3,964.50	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	690,302,975.38	62.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	10,116,528.60	0.92
F	批发和零售业	69,832,088.91	6.32
G	交通运输、仓储和邮政业	18,993.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,888.62	0.00
J	金融业	36,890,224.00	3.34
K	房地产业	29,768,894.33	2.69
L	租赁和商务服务业	93,356,081.83	8.45
M	科学研究和技术服务业	387,648.46	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00

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	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	22,103,306.39	2.00
S	综合	-	0.00
	合计	952,865,061.36	86.24

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：本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	002640	跨境通	3,648,439	69,831,122.46	6.32
2	000858	五粮液	817,722	65,319,633.36	5.91
3	002050	三花智控	3,531,292	64,763,895.28	5.86
4	002027	分众传媒	4,275,174	60,194,449.92	5.45
5	002236	大华股份	2,481,300	57,293,217.00	5.19
6	002294	信立泰	982,200	44,385,618.00	4.02
7	002460	赣锋锂业	568,000	40,754,000.00	3.69
8	002032	苏泊尔	955,988	38,602,795.44	3.49
9	002508	老板电器	788,237	37,914,199.70	3.43
10	600036	招商银行	1,271,200	36,890,224.00	3.34

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	002236	大华股份	64,917,199.23	5.30
2	000100	TCL 集团	62,227,329.00	5.08
3	600029	南方航空	57,912,818.93	4.73
4	300072	三聚环保	54,281,784.92	4.43
5	002027	分众传媒	51,127,987.95	4.17
6	002466	天齐锂业	49,504,698.45	4.04
7	601168	西部矿业	49,307,673.00	4.02

8	601888	中国国旅	49,259,899.07	4.02
9	002241	歌尔股份	49,233,908.31	4.02
10	000858	五粮液	46,493,648.86	3.79
11	002497	雅化集团	43,630,460.00	3.56
12	002126	银轮股份	42,834,805.06	3.50
13	300027	华谊兄弟	42,781,739.10	3.49
14	002460	赣锋锂业	41,996,915.00	3.43
15	002690	美亚光电	41,504,127.20	3.39
16	601117	中国化学	41,138,252.39	3.36
17	002508	老板电器	39,702,331.04	3.24
18	601111	中国国航	38,642,435.29	3.15
19	002294	信立泰	38,039,456.24	3.10
20	600782	新钢股份	35,233,055.00	2.87
21	600547	山东黄金	34,666,355.45	2.83
22	600036	招商银行	34,202,976.09	2.79
23	600050	中国联通	33,393,758.23	2.72
24	002146	荣盛发展	33,260,929.00	2.71
25	600219	南山铝业	32,477,050.22	2.65
26	600068	葛洲坝	31,747,474.27	2.59
27	300116	坚瑞沃能	31,439,385.01	2.57
28	603008	喜临门	31,359,963.02	2.56
29	600873	梅花生物	30,096,896.42	2.46
30	000932	*ST 华菱	28,551,400.49	2.33
31	000063	中兴通讯	27,977,158.00	2.28
32	000402	金融街	27,478,012.66	2.24
33	300144	宋城演艺	27,387,951.85	2.23
34	600104	上汽集团	27,226,956.08	2.22
35	002648	卫星石化	27,206,326.28	2.22
36	600266	北京城建	27,172,634.30	2.22
37	600998	九州通	26,979,442.32	2.20
38	600054	黄山旅游	26,638,875.00	2.17
39	600872	中炬高新	26,377,732.42	2.15

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	300072	三聚环保	108,227,567.50	8.83
2	600887	伊利股份	81,034,286.23	6.61
3	002434	万里扬	67,397,662.79	5.50
4	600029	南方航空	62,593,557.25	5.11
5	300408	三环集团	61,988,607.79	5.06
6	000980	众泰汽车	59,652,869.61	4.87
7	000963	华东医药	59,070,625.89	4.82
8	600079	人福医药	55,820,050.96	4.55
9	601168	西部矿业	51,824,766.17	4.23
10	002497	雅化集团	51,253,047.20	4.18
11	601600	中国铝业	49,855,293.13	4.07
12	601111	中国国航	46,186,967.42	3.77
13	600060	海信电器	44,399,834.32	3.62
14	300144	宋城演艺	43,263,057.56	3.53
15	300027	华谊兄弟	42,549,002.59	3.47
16	002126	银轮股份	42,262,034.64	3.45
17	601117	中国化学	40,007,761.24	3.26
18	600195	中牧股份	39,322,516.74	3.21
19	300015	爱尔眼科	38,201,689.77	3.12
20	002690	美亚光电	38,094,843.25	3.11
21	600547	山东黄金	37,448,521.35	3.06
22	600050	中国联通	36,292,574.44	2.96
23	601888	中国国旅	35,993,455.69	2.94
24	300338	开元股份	34,673,608.59	2.83
25	002640	跨境通	34,402,505.04	2.81
26	600219	南山铝业	33,962,509.53	2.77
27	600782	新钢股份	33,624,490.77	2.74
28	603008	喜临门	31,236,489.78	2.55
29	300116	坚瑞沃能	29,884,034.04	2.44
30	600104	上汽集团	29,385,350.94	2.40
31	000100	TCL 集团	29,265,956.96	2.39
32	600873	梅花生物	28,106,066.17	2.29
33	600569	安阳钢铁	27,903,907.30	2.28
34	300156	神雾环保	27,766,428.22	2.27
35	600872	中炬高新	27,416,245.82	2.24
36	600998	九州通	27,402,706.65	2.24

37	000402	金融街	27,364,845.75	2.23
38	600266	北京城建	26,360,466.39	2.15
39	000060	中金岭南	25,296,153.08	2.06
40	000671	阳光城	24,770,338.71	2.02
41	600054	黄山旅游	24,722,571.92	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,056,734,562.09
卖出股票收入（成交）总额	3,305,096,996.25

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

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：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	802,558.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	59,968.99
5	应收申购款	39,229.89
6	其他应收款	2,884,512.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,786,270.51

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
43,558	20,737.32	33,004,064.26	3.65%	870,271,959.72	96.35%

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	-	0.00000%

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（2007年1月16日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,122,110,449.31
本报告期基金总申购份额	138,230,382.60
减:本报告期基金总赎回份额	357,064,807.93
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	903,276,023.98

§ 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，杜鹃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 100,000.00 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、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	
兴业证券		2966,747,448.76	15.22%	881,031.18	15.22%	-
中信建投		2685,045,308.41	10.78%	624,297.04	10.78%	-
第一创业		1532,867,143.02	8.39%	485,616.40	8.39%	-
光大证券		2407,549,596.38	6.42%	371,404.13	6.42%	-
浙商证券		1379,557,553.98	5.97%	345,890.48	5.97%	-
国金证券		2370,152,202.90	5.83%	337,316.44	5.83%	-
西藏东财		1369,508,935.66	5.82%	336,721.12	5.82%	-
万和证券		1361,196,581.77	5.69%	329,173.11	5.69%	-
方正证券		1357,324,389.44	5.62%	325,627.80	5.62%	-
中泰证券		1282,825,812.27	4.45%	257,741.35	4.45%	-
东吴证券		1250,744,826.44	3.95%	228,509.57	3.95%	-
中金公司		3249,742,305.36	3.93%	227,599.03	3.93%	-
天风证券		2237,531,600.90	3.74%	216,453.92	3.74%	-
东北证券		2204,062,272.23	3.21%	185,977.49	3.21%	-

申银万国	1	190,372,811.91	3.00%	173,492.80	3.00%	-
海通证券	1	126,158,309.17	1.99%	114,972.61	1.99%	-
民生证券	1	102,622,080.83	1.62%	93,515.17	1.62%	-
中信证券	2	67,319,746.98	1.06%	61,347.96	1.06%	-
东方证券	1	59,291,257.20	0.93%	54,030.45	0.93%	-
安信证券	1	57,123,254.19	0.90%	52,055.87	0.90%	-
国泰君安	2	54,905,134.32	0.86%	50,038.85	0.86%	-
银河证券	4	38,005,489.74	0.60%	34,632.72	0.60%	-
华创证券	1	2,324,338.97	0.04%	2,118.22	0.04%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	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%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	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
光大证券	-	0.00%	120,000,000.00	25.26%	-	0.00%
西藏东财	-	0.00%	355,000,000.00	74.74%	-	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

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

大成基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日