

大成蓝筹稳健证券投资基金 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。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	大成蓝筹稳健混合
基金主代码	090003
前端交易代码	090003
后端交易代码	091003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 6 月 3 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	4,308,630,234.05 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例；行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准；个股选择策略则采用蓝筹成分股优选策略，运用“价值—势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相 280 指数成分股投资；债券投资采用完全积极的投资策略，采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略。
业绩比较基准	天相 280 指数×70%+中债综合指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益水平低于股票型基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	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	698,282,543.85	-150,677,644.48	4,084,551,639.03
本期利润	841,842,330.43	-447,732,648.82	2,494,445,480.04
加权平均基金份额本期利润	0.1820	-0.0892	0.3446
本期基金份额净值增长率	24.49%	-10.68%	13.18%
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	-0.0795	-0.2606	-0.1722
期末基金资产净值	3,966,059,703.22	3,593,746,248.59	4,216,284,825.72
期末基金份额净值	0.9205	0.7394	0.8278

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。

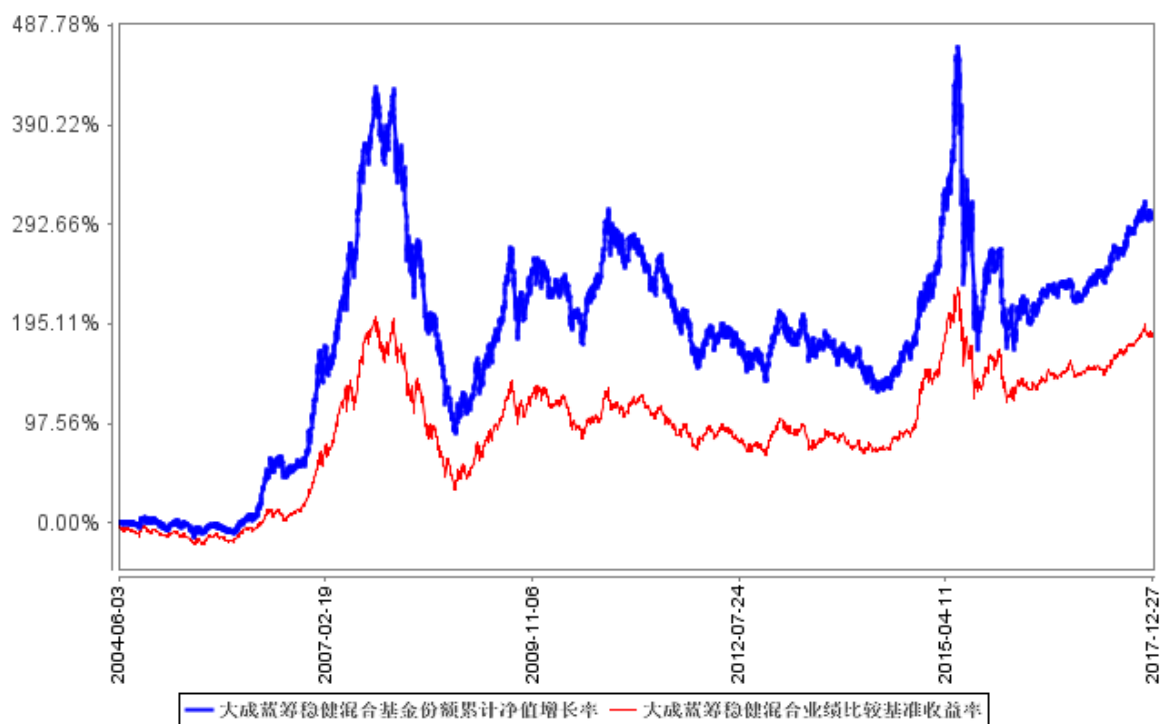
3.2 基金净值表现

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	3.57%	0.70%	3.86%	0.58%	-0.29%	0.12%
过去六个月	8.45%	0.64%	8.04%	0.51%	0.41%	0.13%
过去一年	24.49%	0.63%	16.79%	0.46%	7.70%	0.17%
过去三年	25.85%	1.97%	16.00%	1.18%	9.85%	0.79%
过去五年	42.78%	1.72%	50.54%	1.09%	-7.76%	0.63%
自基金合同生效起至今	302.18%	1.61%	185.22%	1.23%	116.96%	0.38%

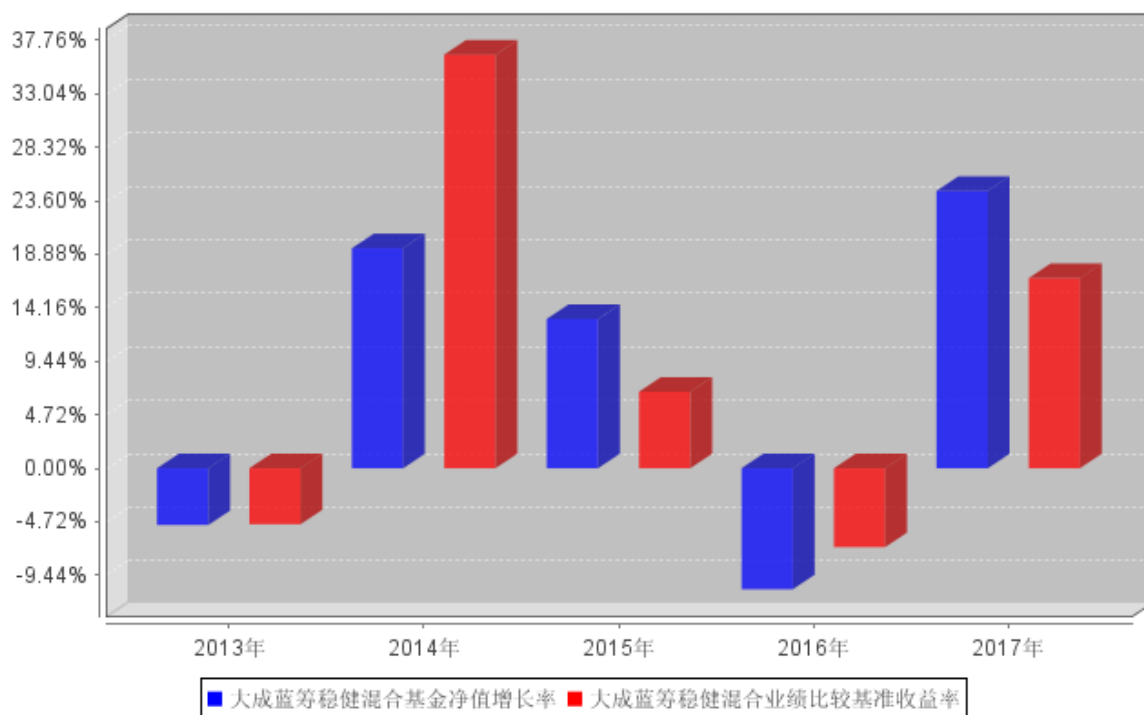
注：根据《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2015 年 9 月 14 日起，由“70%×天相 280 指数+30%×中信标普国债指数”变更为“70%×天相 280 指数+30%×中债综合指数”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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：本基金合同规定，基金管理人应当自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，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

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		
侯春燕女士	本基金基金经理	2015 年 12 月 9 日	-	7 年	经济学硕士，2010 年 6 月加入大成基金管理有限公司。历任研究员，基金经理助理。2015 年 12 月 9 日起担任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 18 日起任大成消费主题混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 1 日起担任大成新锐产业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
张正先生	本基金基金经理助理	2015 年 1 月 14 日	2017 年 6 月 30 日	6 年	经济学硕士。2011 年 7 月加入大成基金管理有限公司。2015 年 1 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日担任大成蓝筹稳健证券

					投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。 国籍：中国
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	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

				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部

负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，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

在过去的 2017 年大部分的行业都感受到了宏观经济的复苏，从白酒、乳制品、家居家电、零售到广告的需求端都出现了明显的改善，从结构上强者恒强的趋势也越来越明显，这些变化和差异在资本市场上都反应的淋漓尽致。由于本基金较为集中配置在蓝筹白马上，产品取得了比较好的收益。本基金今年的收益主要来自食品饮料、新能源汽车、电子的个股选择以及银行和保险的配置，但是由于配置了较多乘用车和券商，均表现较弱，因此没能取得更高的收益。

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 0.9205 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.49%，业绩比较基准收益率为 16.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国实际 GDP 每年 6.5% 左右增长的背景下，未来 5 年证券市场始终存在好的投资机会。大消费、大制造和大金融中部分细分领域经过 17 年的上涨目前估值已经在合理水平，但是还有很多

行业和公司仍然处于行业景气的底部，比如自主品牌的整车股和汽车零部件、证券公司、电子元器件、纺织服装等。这些行业的市场空间足够大，但行业内的公司是否能在未来几年实现稳健增长关键在于管理层是否有相应开拓市场的能力，在研究过程中，我们看到了一些积极的信号，企业核心竞争力的形成是一个长期的过程，我们保持密切跟踪，以期为持有人取得较好的收益。

4.6 管理人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、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构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、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构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/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

注：无。

§ 5 托管人报

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”）在对大成蓝筹稳健证券投资基金（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：大成蓝筹稳健证券投资基金

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	329,264,179.39	400,870,829.18
结算备付金	2,978,635.32	5,234,511.60
存出保证金	490,845.82	521,272.98
交易性金融资产	3,543,368,772.88	3,185,017,946.13
其中：股票投资	3,543,368,772.88	3,185,017,946.13
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	199,917,419.88	99,960,269.94
应收证券清算款	-	-
应收利息	205,074.88	112,326.94
应收股利	-	-
应收申购款	61,057.27	245,684.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,076,285,985.44	3,691,962,841.28
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	100,049,985.90	89,274,987.14
应付赎回款	1,467,900.01	685,208.30
应付管理人报酬	5,085,559.03	4,597,650.20
应付托管费	847,593.21	766,275.06
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,172,276.32	2,391,166.98
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	602,967.75	501,305.01
负债合计	110,226,282.22	98,216,592.69
所有者权益：		
实收基金	4,308,630,234.05	4,860,177,417.62
未分配利润	-342,570,530.83	-1,266,431,169.03
所有者权益合计	3,966,059,703.22	3,593,746,248.59
负债和所有者权益总计	4,076,285,985.44	3,691,962,841.28

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9205 元，基金份额总额 4,308,630,234.05 份。

7.2 利润表

会计主体：大成蓝筹稳健证券投资基金

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	926,346,966.82	-365,675,406.59
1. 利息收入	6,829,371.90	7,390,038.97
其中：存款利息收入	3,183,216.16	3,634,151.85
债券利息收入	-	3,885.69
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,646,155.74	3,752,001.43
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	775,589,452.54	-76,214,416.15
其中：股票投资收益	723,351,711.08	-124,032,892.35
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	1,409,853.20
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	52,237,741.46	46,408,623.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	143,559,786.58	-297,055,004.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	368,355.80	203,974.93
减：二、费用	84,504,636.39	82,057,242.23
1. 管理人报酬	57,604,495.67	54,462,818.78
2. 托管费	9,600,749.29	9,077,136.40
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	16,752,608.41	17,962,624.94
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	546,783.02	554,662.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	841,842,330.43	-447,732,648.82
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	841,842,330.43	-447,732,648.82

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成蓝筹稳健证券投资基金

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）	4,860,177,417.62	-1,266,431,169.03	3,593,746,248.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	841,842,330.43	841,842,330.43
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）	-551,547,183.57	82,018,307.77	-469,528,875.80
其中：1. 基金申购款	63,537,621.37	-9,464,910.24	54,072,711.13
2. 基金赎回款	-615,084,804.94	91,483,218.01	-523,601,586.93
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）	4,308,630,234.05	-342,570,530.83	3,966,059,703.22
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）	5,093,483,950.43	-877,199,124.71	4,216,284,825.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-447,732,648.82	-447,732,648.82

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

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

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

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

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“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	2,326,231,498.23	21.19%	892,251,623.54	7.39%

7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	2,119,847.34	21.19%	587,112.58	27.05%
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	813,108.74	7.38%	77,110.14	3.25%

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	57,604,495.67	54,462,818.78

其中：支付销售机构的客户维护费	11,352,750.97	10,722,327.54
-----------------	---------------	---------------

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×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	9,600,749.29	9,077,136.40

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×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本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之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	329,264,179.39	3,095,665.24	400,870,829.18	3,524,500.05

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证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
002352	顺丰控股	2017年8月22日	2018年8月23日	非公开发行流通受限	35.19	47.51	994,600	34,999,974.00	47,253,446.00	-
002352	顺丰控股	2017年8月22日	2019年8月23日	非公开发行流通受限	35.19	43.40	994,601	35,000,009.19	43,165,683.40	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	52.04	-	-	451,700	23,577,106.68	23,506,468.00	-

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

注：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	3,543,368,772.88	86.93
	其中：股票	3,543,368,772.88	86.93
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	199,917,419.88	4.90
	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	332,242,814.71	8.15
8	其他各项资产	756,977.97	0.02
9	合计	4,076,285,985.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	1,968,300,367.53	49.63
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	145,948,539.75	3.68
G	交通运输、仓储和邮政业	115,249,133.08	2.91
H	住宿和餐饮业	87,827,411.53	2.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	658,281,997.04	16.60
K	房地产业	182,410,774.29	4.60
L	租赁和商务服务业	304,222,841.36	7.67
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	81,127,708.30	2.05
S	综合	-	0.00
	合计	3,543,368,772.88	89.34

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	300124	汇川技术	8,137,641	236,154,341.82	5.95
2	601633	长城汽车	19,364,124	222,493,784.76	5.61
3	000538	云南白药	1,958,910	199,397,448.90	5.03
4	600887	伊利股份	5,821,701	187,400,555.19	4.73
5	600340	华夏幸福	5,811,111	182,410,774.29	4.60
6	600036	招商银行	5,805,760	168,483,155.20	4.25
7	002027	分众传媒	11,770,820	165,733,145.60	4.18
8	601688	华泰证券	9,562,980	165,057,034.80	4.16
9	600030	中信证券	8,782,900	158,970,490.00	4.01
10	000625	长安汽车	12,575,386	158,449,863.60	4.00

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	601633	长城汽车	492,023,650.86	13.69
2	600036	招商银行	248,171,793.63	6.91
3	600340	华夏幸福	245,618,956.31	6.83
4	601318	中国平安	220,591,162.19	6.14
5	601688	华泰证券	216,770,937.51	6.03
6	601377	兴业证券	183,310,110.06	5.10
7	600030	中信证券	178,533,469.15	4.97
8	002007	华兰生物	175,586,798.38	4.89
9	000538	云南白药	174,718,537.18	4.86
10	002292	奥飞娱乐	169,397,972.22	4.71
11	601857	中国石油	163,623,799.90	4.55
12	600048	保利地产	163,550,825.62	4.55
13	601899	紫金矿业	154,066,800.00	4.29
14	601766	中国中车	151,489,334.94	4.22
15	002126	银轮股份	133,750,669.05	3.72
16	002027	分众传媒	131,429,400.59	3.66
17	000625	长安汽车	129,921,626.91	3.62
18	300072	三聚环保	119,964,026.25	3.34
19	601398	工商银行	118,421,230.46	3.30
20	600837	海通证券	118,090,443.16	3.29
21	002202	金风科技	111,167,206.41	3.09
22	600029	南方航空	86,459,390.91	2.41
23	600887	伊利股份	85,875,975.15	2.39
24	300408	三环集团	84,961,541.32	2.36
25	600754	锦江股份	82,530,180.17	2.30
26	002739	万达电影	76,757,223.53	2.14
27	600011	华能国际	73,501,705.10	2.05

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	601318	中国平安	321,190,067.54	8.94
2	002236	大华股份	320,654,815.27	8.92

3	600036	招商银行	317,994,062.66	8.85
4	600340	华夏幸福	281,562,078.43	7.83
5	601633	长城汽车	273,048,213.72	7.60
6	002475	立讯精密	248,844,732.05	6.92
7	600079	人福医药	233,990,212.82	6.51
8	600048	保利地产	186,136,096.09	5.18
9	601398	工商银行	185,693,793.38	5.17
10	600271	航天信息	180,609,339.21	5.03
11	002007	华兰生物	178,556,708.22	4.97
12	600887	伊利股份	174,345,553.11	4.85
13	601628	中国人寿	170,190,415.78	4.74
14	601857	中国石油	168,890,817.33	4.70
15	601899	紫金矿业	163,363,355.39	4.55
16	601377	兴业证券	162,754,624.52	4.53
17	002230	科大讯飞	149,403,534.23	4.16
18	000063	中兴通讯	138,468,630.26	3.85
19	002405	四维图新	125,249,187.75	3.49
20	600837	海通证券	119,831,280.04	3.33
21	002050	三花智控	107,981,226.54	3.00
22	002202	金风科技	104,792,801.51	2.92
23	600998	九州通	99,375,559.65	2.77
24	600029	南方航空	95,827,808.50	2.67
25	002450	康得新	94,660,935.29	2.63
26	300298	三诺生物	82,044,709.10	2.28
27	601766	中国中车	73,899,787.21	2.06

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	5,268,415,051.64
卖出股票收入（成交）总额	5,776,975,722.55

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 本基金投资的前十名证券之一中信证券（600030），于 2017 年 5 月 24 日公告其收到中国证券监督管理委员会出具的《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57 号）。本基金认为，对中信证券的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	490,845.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	205,074.88
5	应收申购款	61,057.27
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	756,977.97

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未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
268,751	16,032.05	7,230,250.99	0.17%	4,301,399,983.06	99.83%

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	-	0.0000%

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（2004年6月3日）基金份额总额	2,234,307,480.29
本报告期期初基金份额总额	4,860,177,417.62
本报告期基金总申购份额	63,537,621.37
减:本报告期基金总赎回份额	615,084,804.94
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	4,308,630,234.05

§ 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)，本年度应支付的审计费用为 15 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	
光大证券	2	22,326,231,498.23	21.19%	2,119,847.34	21.19%	-
东方证券	1	11,169,965,425.78	10.66%	1,066,178.99	10.66%	-
广发证券	1	11,160,614,946.38	10.57%	1,057,693.13	10.57%	-
长江证券	1	885,697,982.09	8.07%	807,127.86	8.07%	-
海通证券	2	835,300,002.55	7.61%	761,192.42	7.61%	-
中信建投	1	661,128,195.22	6.02%	602,540.96	6.02%	-
招商证券	2	629,790,862.35	5.74%	573,946.55	5.74%	-
银河证券	1	557,382,341.59	5.08%	507,937.87	5.08%	-
中信证券	2	542,375,687.92	4.94%	494,267.19	4.94%	-
申万宏源	1	413,748,992.72	3.77%	377,051.77	3.77%	-
万联证券	1	357,036,608.25	3.25%	325,359.99	3.25%	-
方正证券	1	318,324,160.16	2.90%	290,098.74	2.90%	-
安信证券	2	211,813,353.20	1.93%	193,023.53	1.93%	-

东莞证券	1	185,589,804.27	1.69%	169,126.68	1.69%	-
国信证券	1	163,965,022.50	1.49%	149,427.64	1.49%	-
中金公司	2	124,342,992.67	1.13%	113,312.50	1.13%	-
中投证券	2	121,454,330.61	1.11%	110,686.08	1.11%	-
西南证券	1	119,498,742.93	1.09%	108,902.79	1.09%	-
华宝证券	1	102,604,507.85	0.93%	93,489.26	0.93%	-
华泰证券	2	88,525,333.73	0.81%	80,675.75	0.81%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	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%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	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	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%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	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、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：

本报告期内本基金无新增交易单元。

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

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

注：无。

大成基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日