大成高新技术产业股票型证券投资基金

2016 年度 报告摘要

2016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：2017年3月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月23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2016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	大成高新技术产业股票
基金主代码	000628
交易代码	000628
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月3日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	123,256,045.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于高新技术产业相关上市公司，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	(一)大类资产配置。本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。(二)股票投资策略。本基金将采取"自下而上"的方式，依靠定量与定性相结合的方法进行个股选择。(三)股指期货投资策略。本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。(四)其它投资策略。由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略等，由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于高新技术产业股票，其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。

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	罗登攀	林葛
	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

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	2016年	2015年2月3日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	14,026,838.58	81,421,784.19
本期利润	1,527,164.12	108,355,745.93
加权平均基金份额本期利润	0.0108	0.2882
本期基金份额净值增长率	0.83%	20.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.2112	0.2012
期末基金资产净值	149,287,323.50	176,432,728.49
期末基金份额净值	1.211	1.201

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。

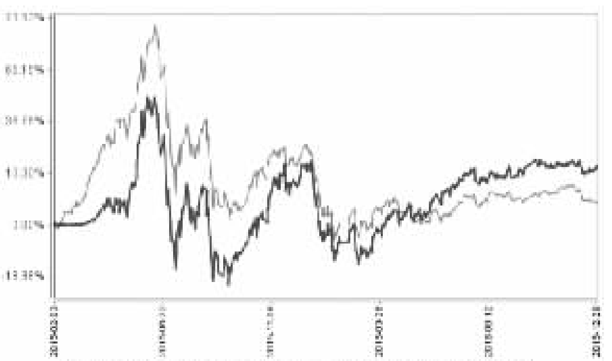
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

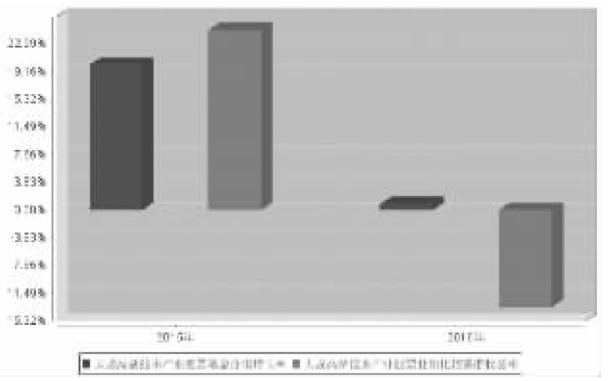
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.25%	0.68%	-0.85%	0.64%	1.10%	0.04%
过去六个月	6.41%	0.80%	2.39%	0.71%	4.02%	0.09%
过去一年	0.83%	1.74%	-13.41%	1.45%	14.24%	0.29%
自基金合同生效起至今	21.10%	2.41%	8.15%	1.90%	12.95%	0.51%

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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015年净值增长率表现期间为2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未进行利润分配。

§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2016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，4只QDII基金及68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		
徐彦先生	本基金基金经理	2015年2月3日	-	11年	管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部，2007年加入大成基金研究部，曾任中游制造行业研究主管，2011年7月29日至2012年10月27日曾任景宏证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2012年10月31日至2015年7月21日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2014年4月25日至2015年7月21日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。2015年2月3日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2015年9月15日起任大成景阳领先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
刘旭先生	本基金基金经理	2015年7月29日	-	6年	管理学硕士。2009年至2010年在毕马威华振会计师事务所任审计师；2011年2月至2013年5月任广发证券研究所研究员；2013年5月加入大成基金管理有限公司。2015年3月30日至2015年7月21日担任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理助理。2015年7月22日至2015年7月28日任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理助理。2015年3月30日至2015年7月21日担任大成竞争优势混合型证券投资基金的基金经理助理。2015年7月22日至2015年7月28日担任大成竞争优势混合型证券投资基金的基金经理助理。2015年3月30日至2015年7月28日担任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理助理，2015年7月29日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016年8月20日起任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成高新技术产业股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成高新技术产业股票型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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9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2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

我们认为未来几年中国经济整体向上概率较低，结构性机会多出现在民间自发转型升级过程中。这一过程对依靠人口红利市场和成本优势的中国企业提出了更高要求，我们的选择标准也加大了对企业可持续市场化能力、具体系转型升级能力等方面的考量权重。尽管受到投资者结构及流动性等因素影响导致A股阶段性出现估值非理性，但作用于其他成熟资本市场的定律并未失效，优秀企业的股价在相对长时间内仍表现出绝对收益与相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为1.211元。本报告期内基金份额净值增长率为0.83%，同期业绩比较基准收益率-13.41%，高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们希望有能力前瞻性的识别出在经济转型中涌现出的领先消费服务型企业和具备持续竞争力的制造型企业，并在风险收益比适当时买入。统计表明，把过去7年看成一个整体，优秀标的构成的组合能够取得超越市场均值的回报水平。我们认为今年的宏观经济复苏会随着库存周期进入尾声而进入平台期。二级市场也以结构性机会为主。

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

本基金管理人将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

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—大成基金管理有限公司2016年1月1日至2016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2016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：大成高新技术产业股票型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	21,008,496.22	16,213,202.67
结算备付金	327,862.34	873,101.72
存出保证金	90,620.53	303,815.47
交易性金融资产	130,544,529.15	153,423,521.02
其中：股票投资	130,544,529.15	153,423,521.02
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	-	7,893,019.44
应收利息	5,110.10	4,289.89
应收股利	-	-
应收申购款	55,332.89	20,992.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	152,031,951.23	178,731,942.33
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	2,085,236.31	873,938.45
应付赎回款	176,234.62	595,904.95
应付管理人报酬	189,656.80	232,218.29
应付托管费	31,609.45	38,703.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	101,440.95	466,502.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,449.60	91,947.00
负债合计	2,744,627.73	2,299,213.84
所有者权益：		
实收基金	123,256,045.50	146,885,537.83
未分配利润	26,031,278.00	29,547,190.66
所有者权益合计	149,287,323.50	176,432,728.49
负债和所有者权益总计	152,031,951.23	178,731,942.33

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.211元，基金份额总额123,256,045.50份。

7.2 利润表

会计主体：大成高新技术产业股票型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	6,101,573.94	118,010,235.62
1.利息收入	179,340.93	3,663,644.66
其中：存款利息收入	179,340.93	3,425,737.01
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	-	237,907.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	18,251,511.80	82,640,459.38
其中：股票投资收益	16,932,549.66	81,236,477.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,318,962.14	1,403,982.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-12,499,674.46	26,933,961.74
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	170,395.67	4,772,169.84
减：二、费用	4,574,409.82	9,654,489.69
1.管理人报酬	2,321,925.18	5,486,821.68
2.托管费	386,987.50	914,470.22
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,481,535.73	2,974,201.26
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	383,961.41	278,996.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,527,164.12	108,355,745.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,527,164.12	108,355,745.93

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：大成高新技术产业股票型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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)	146,885,537.83	29,547,190.66	176,432,728.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,527,164.12	1,527,164.12
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)	-23,629,492.33	-5,043,076.78	-28,672,569.11
其中：1.基金申购款	44,434,656.92	3,524,624.20	47,959,281.12
2.基金赎回款	-68,064,149.25	-8,567,700.98	-76,631,850.23
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)	123,256,045.50	26,031,278.00	149,287,323.50
项目	上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015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)	1,140,630,132.41	-	1,140,630,132.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	108,355,745.93	108,355,745.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-993,744,594.58	-78,808,555.27	-1,072,553,149.85
其中：1.基金申购款	203,824,464.02	36,099,726.88	239,924,190.90
2.基金赎回款	-1,197,569,058.60	-114,908,282.15	-1,312,477,340.75
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)	146,885,537.83	29,547,190.66	176,432,728.49

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______　　____周立新____
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、注册登记机构、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
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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金管理人的股东(2016年4月25日前)
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。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015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	326,344,344.78	33.37%	338,415,684.60	16.99%

7.4.4.1.2 权证交易

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 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	297,830.83	33.41%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015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	311,734.11	17.38%	210,267.01	45.07%

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,321,925.18	5,486,821.68
其中：支付销售机构的客户维护费	1,069,209.04	2,497,475.74

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	386,987.50	914,470.22

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×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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015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	21,008,496.22	169,375.09	16,213,202.67	1,018,660.43

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

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

本基金本报告期内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(2016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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	20,158	80,632.00	80,632.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	1,908	40,640.40	40,640.40	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
603111	康尼机电	2016年12月26日	重大事项	14.70	-	-	11,685	120,656.72	171,769.50	-
002113	天润数娱	2016年11月30日	重大事项	18.81	-	-	124	1,011.54	2,332.44	-
300449	汉邦高科	2016年11月11日	重大事项	48.44	2017年2月24日	43.88	46	2,387.68	2,228.24	-

注：本基金截至2016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

本基金本报告期末无从事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	130,544,529.15	85.87
	其中：股票	130,544,529.15	85.87
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	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	银行存款和结算备付金合计	21,336,358.56	14.03
7	其他各项资产	151,063.52	0.10
8	合计	152,031,951.23	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	3,232,182.00	2.17
C	制造业	78,704,017.10	52.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,839.19	0.08
E	建筑业	1,955,242.23	1.31
F	批发和零售业	10,412,192.47	6.97
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	159,280.76	0.11
J	金融业	11,003,640.00	7.37
K	房地产业	9,124,060.44	6.11
L	租赁和商务服务业	5,959,864.96	3.99
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	9,873,210.00	6.61
S	综合	-	0.00
	合计	130,544,529.15	87.45

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002050	三花智控	1,297,723	14,326,861.92	9.60
2	600885	宏发股份	389,542	12,445,866.90	8.34
3	002126	银轮股份	1,180,102	11,435,188.38	7.66
4	300144	宋城演艺	471,500	9,873,210.00	6.61
5	600325	华发股份	712,635	9,121,728.00	6.11
6	000513	丽珠集团	148,313	8,824,623.50	5.91
7	002032	苏泊尔	239,200	8,352,864.00	5.60
8	600458	时代新材	443,750	6,279,062.50	4.21
9	002127	南极电商	519,152	5,959,864.96	3.99
10	600998	九州通	273,814	5,678,902.36	3.80

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	000513	丽珠集团	13,591,363.29	7.70
2	600885	宏发股份	12,801,582.20	7.26
3	002281	光迅科技	12,457,481.58	7.06
4	600325	华发股份	11,748,968.93	6.66
5	002475	立讯精密	11,739,389.09	6.65
6	300144	宋城演艺	11,698,810.38	6.63
7	600386	北巴传媒	11,249,117.17	6.38
8	002050	三花智控	10,526,048.90	5.97
9	000100	TCL集团	10,339,473.00	5.86
10	603788	宁波高发	9,438,682.80	5.35
11	002547	春兴精工	9,362,750.00	5.31
12	002550	千红制药	9,092,466.00	5.15
13	002032	苏泊尔	8,294,435.20	4.70
14	600060	海信电器	8,092,218.45	4.59
15	600571	信雅达	7,964,064.21	4.51
16	002327	富安娜	7,958,545.00	4.51
17	000967	盈峰环境	7,849,615.00	4.45
18	002258	利尔化学	7,725,802.68	4.38
19	601311	骆驼股份	7,700,611.34	4.36
20	000625	长安汽车	7,591,811.00	4.30
21	000333	美的集团	7,584,855.00	4.30
22	600458	时代新材	6,627,183.66	3.76
23	000531	穗恒运A	6,207,414.00	3.52
24	300395	菲利华	6,189,393.38	3.51
25	002322	理工环科	6,176,487.13	3.50
26	000521	美菱电器	6,172,395.00	3.50
27	000525	红太阳	6,119,379.37	3.47
28	600110	诺德股份	6,096,670.00	3.46
29	300396	迪瑞医疗	5,956,954.51	3.38
30	002138	顺络电子	5,797,026.00	3.29
31	601388	怡球资源	5,750,263.00	3.26
32	601799	星宇股份	5,535,296.50	3.14
33	000596	古井贡酒	5,376,749.12	3.05
34	002235	安妮股份	5,011,666.00	2.84
35	601398	工商银行	4,936,165.00	2.80
36	002409	雅克科技	4,894,993.18	2.77
37	300183	东软载波	4,885,283.03	2.77
38	002434	万里扬	4,792,605.00	2.72
39	002609	捷顺科技	4,786,429.93	2.71
40	600141	兴发集团	4,772,349.30	2.70
41	002039	黔源电力	4,654,751.72	2.64
42	600235	民丰特纸	4,606,930.00	2.61
43	600990	四创电子	4,548,104.00	2.58
44	002127	南极电商	4,514,019.00	2.56
45	300461	田中精机	4,502,456.00	2.55
46	600297	广汇汽车	4,467,399.00	2.53
47	601939	建设银行	4,421,030.16	2.51
48	600998	九州通	4,409,195.20	2.50
49	002555	三七互娱	4,244,568.00	2.41
50	600741	华域汽车	4,047,860.02	2.29
51	600376	首开股份	3,966,993.96	2.25
52	603601	再升科技	3,845,999.68	2.18
53	002264	新华都	3,762,680.00	2.13
54	300409	道氏技术	3,686,416.00	2.09
55	002008	大族激光	3,594,755.35	2.04

注：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)，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	002355	兴民智通	18,280,062.70	10.36
2	002138	顺络电子	17,965,751.23	10.18
3	300395	菲利华	13,202,781.60	7.48
4	002281	光迅科技	12,813,837.52	7.26
5	600386	北巴传媒	12,078,802.97	6.85
6	603788	宁波高发	11,557,530.14	6.55
7	002475	立讯精密	11,068,386.53	6.27
8	000333	美的集团	10,868,582.36	6.16
9	000100	TCL集团	10,017,329.00	5.68
10	300078	思创医惠	9,917,032.43	5.62
11	002550	千红制药	9,083,871.05	5.15
12	002327	富安娜	8,478,421.85	4.81
13	000596	古井贡酒	8,375,796.30	4.75
14	002113	天润数娱	8,156,405.40	4.62
15	002588	史丹利	8,109,527.56	4.60
16	600060	海信电器	8,087,004.51	4.58
17	600571	信雅达	7,984,327.08	4.53
18	002127	南极电商	7,933,365.91	4.50
19	000625	长安汽车	7,745,879.60	4.39
20	601799	星宇股份	7,642,144.24	4.33
21	002547	春兴精工	7,472,646.74	4.24
22	000967	盈峰环境	7,465,283.50	4.23
23	600122	宏图高科	7,365,969.00	4.17
24	000531	穗恒运A	6,839,485.37	3.88
25	600647	同达创业	6,713,070.31	3.80
26	002322	理工环科	6,564,352.82	3.72
27	600110	诺德股份	6,437,878.00	3.65
28	000513	丽珠集团	6,204,006.66	3.52
29	000521	美菱电器	6,199,166.16	3.51
30	002039	黔源电力	5,913,814.74	3.35
31	000525	红太阳	5,904,005.50	3.35
32	000893	东凌国际	5,883,976.90	3.33
33	002434	万里扬	5,836,008.86	3.31
34	300031	宝通科技	5,662,130.91	3.21
35	300178	腾邦国际	5,616,034.42	3.18
36	002409	雅克科技	5,597,369.78	3.17
37	300396	迪瑞医疗	5,546,082.89	3.14
38	300183	东软载波	5,071,928.09	2.87
39	600885	宏发股份	5,024,237.05	2.85
40	300342	天银机电	4,865,730.28	2.76
41	300461	田中精机	4,694,513.82	2.66
42	002609	捷顺科技	4,546,304.84	2.58
43	600235	民丰特纸	4,536,390.18	2.57
44	002264	新华都	4,385,450.00	2.49
45	002517	恺英网络	4,345,820.28	2.46
46	002675	东诚药业	4,312,641.68	2.44
47	601388	怡球资源	4,274,018.61	2.42
48	600141	兴发集团	4,270,545.40	2.42
49	603601	再升科技	4,217,474.90	2.39
50	002258	利尔化学	4,204,115.28	2.38
51	600376	首开股份	4,145,236.00	2.35
52	600990	四创电子	4,139,359.57	2.35
53	002730	电光科技	3,932,041.00	2.23
54	002582	好想你	3,885,396.53	2.20
55	300145	中金环境	3,840,894.30	2.18
56	300409	道氏技术	3,765,782.59	2.13
57	600741	华域汽车	3,763,091.48	2.13
58	601311	骆驼股份	3,751,539.96	2.13
59	002555	三七互娱	3,697,573.10	2.10
60	002235	安妮股份	3,636,064.64	2.06
61	000554	泰山石油	3,625,127.40	2.05
62	300447	全信股份	3,572,381.11	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	475,947,143.66
卖出股票收入(成交)总额	503,259,010.73

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末无贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	90,620.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,110.10
5	应收申购款	55,332.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	151,063.52

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

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
4,819	25,577.10	100,747.29	0.08%	123,155,298.21	99.92%

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	593.74	0.0005%

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(2015年2月3日)基金份额总额	1,140,630,132.41
本报告期期初基金份额总额	146,885,537.83
本报告期基金总申购份额	44,434,656.92
减：本报告期基金总赎回份额	68,064,149.25
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	123,256,045.50

§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

基金管理人于2016年6月25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十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动：

无。

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6万元整。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、报告期内基金管理人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并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请6个月，暂停受理新设子公司业务申请1年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内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	326,344,344.78	33.37%	297,830.83	33.41%	-
银河证券	4	86,247,455.46	8.82%	78,596.75	8.82%	-
国盛证券	1	77,598,399.30	7.94%	70,715.43	7.93%	-
中信建投	2	76,630,167.15	7.84%	69,834.87	7.83%	-
爱建证券	1	75,389,168.88	7.71%	68,705.03	7.71%	-
万和证券	1	49,229,335.94	5.03%	44,864.15	5.03%	-
招商证券	2	48,430,529.15	4.95%	44,134.46	4.95%	-
上海证券	1	43,089,862.15	4.41%	39,271.00	4.40%	-
民生证券	1	41,649,711.58	4.26%	37,954.74	4.26%	-
东方证券	1	31,832,365.91	3.26%	29,010.07	3.25%	-
海通证券	1	26,102,012.38	2.67%	23,787.68	2.67%	-
西部证券	1	23,981,261.68	2.45%	21,853.71	2.45%	-
华创证券	1	18,250,289.95	1.87%	16,630.98	1.87%	-
国泰君安	2	17,570,871.10	1.80%	16,015.75	1.80%	-
红塔证券	1	11,925,236.34	1.22%	10,864.08	1.22%	-
中泰证券	1	7,169,583.35	0.73%	6,533.25	0.73%	-
联讯证券	1	5,952,677.54	0.61%	5,424.87	0.61%	-
中信证券	2	3,112,023.00	0.32%	2,835.79	0.32%	-
东北证券	2	2,498,097.00	0.26%	2,276.79	0.26%	-
安信证券	1	2,309,558.00	0.24%	2,104.67	0.24%	-
瑞银证券	1	1,442,261.99	0.15%	1,314.28	0.15%	-
国信证券	1	1,059,956.60	0.11%	965.89	0.11%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	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。

报告期内本基金新增交易单元：爱建证券、东方证券、万和证券、中原证券、中金公司、广发证券、东吴证券；无退租交易单元。

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

无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据2016年4月27日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改<公司章程>的公告》，根据大成基金管理有限公司(以下简称"本公司")第六届董事会第十四次会议和2016年第一次临时股东会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司2%股权(对应出资额400万元)以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至50%(对应出资额1亿元)，同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《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。

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(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，代为履职时间不超过90日。

3、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。

大成基金管理有限公司
2017年3月25日