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

大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金

2016 年度 报告摘要

2016年12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 2016年5月4日（基金合同生效日）起至 12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成国家安全主题灵活配置混合
基金主代码	002567
交易代码	002567
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月4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	152,940,101.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是通过投资于与国家安全主题相关的优质上市公司，在控制风险的前提下追求基金资产长期稳定增长。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评估各类资产的市场趋势，预期风险收益水平和配置权利，在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	中证800指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于较高风险水平中高的基金。

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	林晓
	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	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	2016年5月4日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-16,728,521.51
本期利润	-17,546,303.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0947
本期基金份额净值增长率	-10.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1021
期末基金资产净值	137,319,931.33
期末基金份额净值	0.898

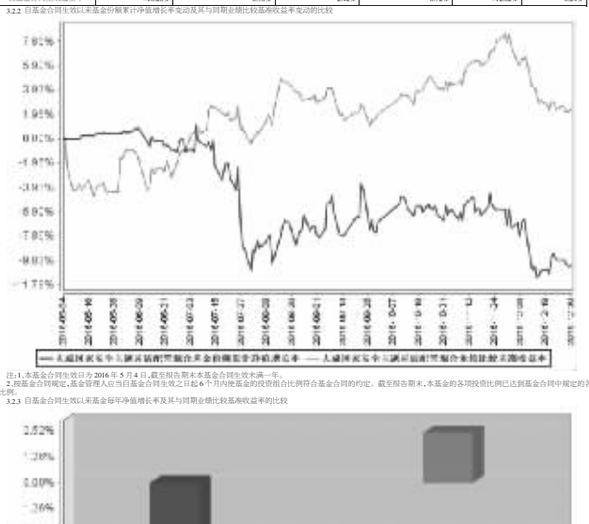
注:1.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.本基金合同生效日为2016年5月4日，截至报告日本基金合同生效未满一年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	-3.75%	0.82%	0.45%	0.57%	-4.20%	0.25%
过去六个月	-10.11%	1.10%	3.42%	0.62%	-13.53%	0.48%
自基金合同生效起至今	-10.20%	0.96%	2.42%	0.72%	-12.62%	0.24%

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



注:1.本基金合同生效日为2016年5月4日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 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:2016年净值增长率表现期间为2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金自2016年5月4日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金投资情况

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批准设立于1999年10月5日，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，分别为中国信托投资有限公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银行投资管理有限公司(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）、特定客户资产管理等业务资格。

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、51只OEM基金及68只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金投资总监）担任本基金投资决策委员会主席（或总经理助理）期间的情况

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张君鹏先生	本基金基金经理	2016年5月4日	-	7年	经济学硕士，2010年7月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、基金经理助理。2015年6月24日至2015年7月2日起任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理，2015年7月3日起任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理，2016年5月4日至2017年1月18日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理，2016年5月4日至2017年1月18日任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。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。
3.张君鹏先生自2017年1月18日离任本基金基金经理，续春燕女士于同日起担任本基金基金经理，详见2017年1月19日的变更基金经理公告。

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》、《大成国家安全主题灵活配置混合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，大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金基金的投资范围、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，没有出用基金资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资产，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

按照《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禁止内幕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，参与投票、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，投资决策与负责投资决策、交易管理职责分离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，通过多层门的制约互控，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

按照公司、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1日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，分析结果剔除债券交易同向交易和不较短、较票面同交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个别当日价格波幅较高）的因素，以期使投资组合或交易同向不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别投资组合间的成交价格差异较大，但综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所在个笔同日反向交易，原因为投资策略需要，主动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或交价予价让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，成交价格等交易指标数据表明类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内本基金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业绩表现的说明

我们认为，2016年宏观经济转变出现关键性变化，而低点在三季度，实际上，宏观经济在去年的二季度就开始好转了，而四季度进一步确认好转，全年通胀的走势也是先低后高，PPI从10月份开始同比转正说明宏观经济在出现关键性变化，不妨，我们认为货币政策至少仍然维持宽松的环境，尽管记际上不再进一步宽松，地产和基建成为2016年重要的抓手。

基于以上的判断，本基金从成立之初开始就基于宏观经济复苏的逻辑进行资产配置，但事实上，市场对于宏观经济复苏的逻辑并不认可，二季度的配置主要集中在化工、汽车及电子等主要板块上面，因此本基金并未在二季度取得良好的收益，特别是上台对全球宏观经济和国际政治带来了巨大的不确定性，因此，四季度调整了市场策略，加大在国家安全领域的配置，比如加大了军工、军工等领域的配置比例，另外小幅调整了食品安全领域的个股，超额收益较为明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净产净值为0.898元，本报告期内基金份额净值增长率为-10.20%，同期业绩比较基准收益率2.42%，低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年中国资本市场面临了全新的环境，首先，特别是上台以来于全球经济发展、国际贸易、地缘政治等方面带来了不确定性，法国总统大选等对欧元区的发展也存在不确定性；其次，中国宏观经济运用了确定性的反转，中国和全球制造业投资及基建投资的复苏中中国制造的产品带来了潜在的需求，最后，全球进入了加息周期，预计2017年美联储有两次加息动作，欧元区和日本货币宽松的环境不可能延续，中国央行也进入了 加息期，全球流动性将趋于收紧。

基于过去环境的判断，我们认为，A股市场不存在趋势性行情，但结构性行情仍然不断演绎，第一，全球货币收紧带来无风险利率的上行，全球不确定性增加带来的风险偏好下降等都使得分母端上行，对估值不利；第二，由于全球的经济复苏和国内经济复苏等来的企业盈利拐点不断增强，分子端将不断改善。

在行业配置上，我们遵循上述的判断，一季度加配国防军工、周期类板块，但核心持仓以大消费和大制造为主。

4.6 管理人对报告期内基金投资决策委员会、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。

本基金管理人作基金估值业务的领导小组为公司的估值委员会，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。估值委员会设投资投资部、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决策委员会成员中的投资总监。

4.6.1 基金估值方法

本基金持有的资产和承担的负债按本方金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)公投双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

4.6.2 实收基金

实收基金是对外发行基金份额所募集的总金额在扣除掉平准金分摊部分后的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

4.6.3 报益平准金

报益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现报益占基金单位份额比例计算的金额，未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现报益占基金单位份额比例计算的金额。报益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末金额转入未分配利润(累计亏损)。

4.6.4 收入/损失的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利和按融出上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

4.6.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同的规定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

4.6.4.11 基金利润及分配政策

每一基金份额享有同等分配权，本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值日纳税方基金份额进行再投资，若期末未分配利润中的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润减去未实现部分。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

4.6.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向该部分配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个统一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

4.6.4.13 其他的重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别投资投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若当周最大跌幅限制幅度公允未达到停牌条件的，按当周最后一个交易日的收盘价作为当日的公允价值；若当周最大跌幅限制幅度公允达到停牌条件的，则采用指数收益法或市场法确定公允价值。

对于证券交易所上市的债券，交易所市场当日有交易的，按当日的收盘价作为当日的公允价值；当日无交易的，按当日的最近交易日的收盘价作为当日的公允价值，但当日至最近交易日期间发生了影响该债券公允价值重大因素的，则采用指数收益法或市场法确定公允价值。

对于银行间同业市场交易的债券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于证券交易所发行的可转换债券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于证券交易所发行的可分离交易可转换债券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于证券交易所发行的可分离交易可转换债券的权证，当日有交易的，按当日的收盘价作为当日的公允价值；当日无交易的，按当日的最近交易日的收盘价作为当日的公允价值。

对于银行间同业市场交易的资产支持证券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于银行间同业市场交易的中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购等，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于银行间同业市场交易的同业存单，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于证券交易所上市的可交换债券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于证券交易所上市的可分离交易可转换债券的权证，当日有交易的，按当日的收盘价作为当日的公允价值；当日无交易的，按当日的最近交易日的收盘价作为当日的公允价值。

对于银行间同业市场交易的资产支持证券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于银行间同业市场交易的中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购等，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于银行间同业市场交易的同业存单，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

4.6.4.14 其他的重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别投资投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若当周最大跌幅限制幅度公允未达到停牌条件的，按当周最后一个交易日的收盘价作为当日的公允价值；若当周最大跌幅限制幅度公允达到停牌条件的，则采用指数收益法或市场法确定公允价值。

对于证券交易所上市的债券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值；当日无交易的，按当日的最近交易日的收盘价作为当日的公允价值，但当日至最近交易日期间发生了影响该债券公允价值重大因素的，则采用指数收益法或市场法确定公允价值。

对于证券交易所发行的可转换债券，按当日的第三方估值机构提供的估值净价作为当日的公允价值。

对于证券交易所发行的可分离交易可转换债券的权证，当日有交易的，按当日的收盘价作为当日的公允价值；当日无交易的，按当日的最近交易日的收盘价作为当日的公允价值。

4.6.5 报告期末本基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

4.6.6 报告期末本基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

4.6.7 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5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	13,042,912.99	322,993.23

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。

4.7.7.6 本基金承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金不承销期内参与关联方承销证券的情况。

4.7.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期内无其他关联交易事项。

4.7.8 期末（2016年12月31日）除基金持有的流通受限证券

4.7.8.1 因认购新发/配发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

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	未上市股票	4.00	4.00	19,068	76,272.00	76,272.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	未上市股票	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	未上市股票	21.30	21.30	1,908	40,640.40	40,640.40	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市股票	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市股票	14.63	14.63	1,406	20,569.78	20,569.78	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	未上市股票	14.11	14.11	1,295	18,272.45	18,272.45	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	未上市股票	23.16	23.16	520	12,043.20	12,043.20	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	未上市股票	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	未上市股票	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	未上市股票	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	未上市股票	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	未上市股票	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	未上市股票	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	未上市股票	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注:1.报告期末基金持有的流通受限证券不存在因认购新股而产生的应付款项。
2.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。

7.4.8.2 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
002745	木林森	2016年7月15日	重大资产重组	33.50	-	-	159,300	5,612,979.17	5,336,550.00	-

注:1.本基金截至2016年12月31日止持有以上因公告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。

7.4.8.3 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	123,714,867.84	89.69
	其中:股票	123,714,867.84	89.69
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	13,779,889.96	9.99
7	其他各项资产	447,065.22	0.32
8	合计	137,941,823.02	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	2,695,934.44	1.96
C	制造业	62,774,441.20	45.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,201,565.26	7.43
E	建筑业	2,898,299.07	2.11
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	20,503,166.68	14.93
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,835,668.29	7.89
J	金融业	76,272.00	0.06
K	房地产业	3,978,961.90	2.90
L	租赁和商务服务业	4,226,044.00	3.08
M	科学研究和技术服务业	5,524,515.00	4.02
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	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	123,714,867.84	90.09

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	600115	东方航空	1,815,600	12,836,292.00	9.35
2	002281	光迅科技	144,900	11,374,650.00	8.28
3	600399	抚顺特钢	1,471,550	10,109,548.50	7.36
4	300461	田中精机	121,900	7,780,877.00	5.67
5	600029	南方航空	1,090,800	7,657,416.00	5.58
6	600856	中天能源	438,807	6,055,536.60	4.41
7	300339	润和软件	180,678	5,528,746.80	4.03
8	002738	中矿资源	209,500	5,524,515.00	4.02
9	002745	木林森	159,300	5,336,550.00	3.89
10	300031	宝通科技	243,188	5,126,403.04	3.73

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300431	暴风集团	48,666,573.44	35.44
2	300031	宝通科技	31,199,761.42	22.72
3	600115	东方航空	24,964,883.99	18.18
4	300228	富瑞特装	20,998,854.15	15.29
5	300471	厚普股份	19,940,547.40	14.52
6	000952	广济药业	18,346,388.22	13.36
7	600459	贵研铂业	18,060,240.01	13.15
8	300467	迅游科技	17,414,662.99	12.68
9	300033	同花顺	17,158,012.44	12.49
10	002751	易尚展示	16,399,729.00	11.94
11	002668	奥马电器	16,255,616.43	11.84
12	603869	北部湾旅	15,852,621.00	11.54
13	002766	索菱股份	15,823,996.00	11.52
14	600136	当代明诚	15,551,272.50	11.32
15	000531	穗恒运A	15,484,106.23	11.28
16	600571	信雅达	15,477,507.74	11.27
17	300113	顺网科技	15,277,460.26	11.13
18	002076	雪莱特	15,148,797.92	11.03
19	600372	中航电子	15,087,446.13	10.99
20	600458	时代新材	14,249,814.74	10.38
21	601377	兴业证券	14,225,534.32	10.36
22	600879	航天电子	13,862,865.69	10.10
23	002491	通鼎互联	13,030,256.61	9.49
24	002327	富安娜	12,846,604.01	9.36
25	600478	科力远	12,824,103.68	9.34
26	002433	太安堂	12,756,468.18	9.29
27	002281	光迅科技	12,661,526.00	9.22
28	600693	东百集团	12,494,495.88	9.10
29	300408	三环集团	12,493,133.60	9.10
30	600856	中天能源	12,232,439.47	8.91
31	601111	中国国航	12,182,087.00	8.87
32	600029	南方航空	12,169,067.83	8.86
33	000818	方大化工	12,164,492.16	8.86
34	600399	抚顺特钢	12,053,413.50	8.78
35	000639	西王食品	11,762,466.36	8.57
36	002339	积成电子	11,362,958.64	8.27
37	002285	世联行	11,295,801.20	8.23
38	600221	海南航空	11,175,066.00	8.14
39	300325	德威新材	10,886,215.15	7.93
40	000100	TCL集团	10,629,210.00	7.74
41	600685	中船防务	10,382,125.66	7.56
42	601668	中国建筑	9,683,593.00	7.05
43	002665	首航节能	9,175,064.05	6.68
44	600801	华新水泥	9,025,152.05	6.57
45	000882	华联股份	8,996,915.90	6.55
46	300461	田中精机	8,659,519.16	6.31
47	601388	怡球资源	8,373,896.71	6.10
48	600778	友好集团	8,350,015.52	6.08
49	002502	骅威文化	7,837,453.08	5.71
50	002425	凯撒文化	7,835,525.00	5.71
51	300177	中海达	7,786,738.00	5.67
52	300336	新文化	7,740,008.82	5.64
53	601989	中国重工	7,716,168.50	5.62
54	603020	爱普股份	7,695,395.00	5.60
55	600990	四创电子	7,680,925.08	5.59
56	300121	阳谷华泰	7,595,140.85	5.53
57	600184	光电股份	7,593,476.76	5.53
58	600038	中直股份	7,593,467.55	5.53
59	002013	中航机电	7,584,769.74	5.52
60	600893	中航动力	7,579,774.10	5.52
61	002350	北京科锐	7,577,315.58	5.51
62	000768	中航飞机	7,571,305.24	5.51
63	300465	高伟达	7,566,205.00	5.51
64	300429	强力新材	7,552,158.91	5.50
65	600677	航天通信	7,551,999.06	5.50
66	002568	百润股份	7,529,252.81	5.48
67	002719	麦趣尔	7,527,626.00	5.48
68	600316	洪都航空	7,524,407.26	5.48
69	600118	中国卫星	7,514,945.00	5.47
70	000801	四川九洲	7,510,290.94	5.47
71	600855	航天长峰	7,492,348.99	5.46
72	002686	亿利达	7,370,160.00	5.37
73	002639	雪人股份	7,356,119.32	5.36
74	601677	明泰铝业	7,291,916.00	5.31
75	000758	中色股份	7,283,400.00	5.30
76	603008	喜临门	7,250,999.00	5.28
77	300278	华昌达	7,229,494.00	5.26
78	002522	浙江众成	7,218,059.00	5.26
79	000887	中鼎股份	7,191,616.85	5.24
80	000625	长安汽车	7,187,588.69	5.23
81	001979	招商蛇口	7,150,298.00	5.21
82	000851	高鸿股份	7,124,954.00	5.19
83	600860	京城股份	7,113,062.63	5.18
84	002622	融钰集团	7,110,457.01	5.18
85	000035	中国天楹	7,081,654.01	5.16
86	600418