大成趋势回报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

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：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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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3月22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	大成趋势回报灵活配置混合
基金主代码	002383
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月22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	218,739,680.20份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，把握市场运行趋势，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略主要体现在两个方面：一方面对权益类资产及固定收益类资产等不同类别资产的大类配置上，另一方面体现在对单个投资品种的选择上。本基金强调趋势投资，具体可以概括为： 本基金根据对宏观趋势的分析实施大类资产的配置，本基金将在权益类证券投资方面，将对市场趋势进行研判，同时通过对行业发展趋势、公司成长趋势以及股票价格趋势的研究精选个股进行投资；在固定收益类证券投资方面，本基金将通过综合分析市场利率趋势、证券市场走势、资金供求关系流动性风险信用和有政策法规等因素，研判各类属固定收益资产的风险趋势与收益预期，精选个券进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型和货币市场基金，低于股票型基金，属证券投资基金中的中高风险品种。

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	罗登攀	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 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3月22日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-16,644,321.55
本期利润	-21,417,166.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0752
本期基金份额净值增长率	-8.50%
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	-0.0848
期末基金资产净值	200,193,155.20
期末基金份额净值	0.915

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。

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	-5.96%	0.59%	0.19%	0.38%	-6.15%	0.21%
过去六个月	-8.68%	0.58%	2.80%	0.39%	-11.48%	0.19%
自基金合同生效起至今	-8.50%	0.56%	1.63%	0.44%	-10.13%	0.12%

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3月22日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2016年3月22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		
魏庆国先生	基金经理	2016年3月22日	-	7年	经济学硕士。2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员；2012年至2013年任职于平安大华基金研究部；2013年5月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日至2015年3月30日担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。2015年4月7日至2015年7月23日起担任大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年7月24日起任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2015年4月7日至2016年8月19日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日至2016年8月19日任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年3月22日起任大成趋势回报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》、《大成趋势回报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，大成趋势回报灵活配置混合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

2016年本基金跑输基准，向各位持有人表示深深的歉意。反思如下：

第一是判断2016年是一个震荡市，但是操作手法上延续2015年的趋势投资思路，未及时根据市场进行相应的调整。

第二是对于之前的传统产业有色煤炭钢铁白酒等今年表现出彩的板块，存在偏见，没有充分挖掘其中的投资机会。

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0.915元。本报告期内基金份额净值增长率为-8.50%，同期业绩比较基准收益率1.63%，低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

展望2017年，本基金将吸取过去2年投资的经验和教训，深度研究个股，集中持仓，长期投资，减少交易和博弈。具体来说，就是两个方面：

第一是坚持GARP策略，就是估值和业绩增长的权衡。

第二是精选行业龙头，努力从长期的角度去评估一个企业的价值，精选 “四有” 类的公司，即：有远大前景的行业，有野心的企业家，有壁垒的商业模式和有弹性的价格。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金（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2016年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（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：大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

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
资 产：	
银行存款	113,488,036.39
结算备付金	2,862,395.13
存出保证金	315,815.60
交易性金融资产	85,287,047.99
其中：股票投资	85,287,047.99
基金投资	0.00
债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
贵金属投资	0.00
衍生金融资产	0.00
买入返售金融资产	0.00
应收证券清算款	0.00
应收利息	20,245.30
应收股利	0.00
应收申购款	5,094.28
递延所得税资产	0.00
其他资产	0.00
资产总计	201,978,634.69
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日
负 债：	
短期借款	0.00
交易性金融负债	0.00
衍生金融负债	0.00
卖出回购金融资产款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	583,293.50
应付管理人报酬	266,567.85
应付托管费	44,427.99
应付销售服务费	0.00
应付交易费用	765,750.83
应交税费	0.00
应付利息	0.00
应付利润	0.00
递延所得税负债	0.00
其他负债	125,439.32
负债合计	1,785,479.49
所有者权益：	
实收基金	218,739,680.20
未分配利润	-18,546,525.00
所有者权益合计	200,193,155.20
负债和所有者权益总计	201,978,634.69

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值人民币0.915元，基金份额总额218,739,680.20份。

7.2 利润表

会计主体：大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	-11,439,656.93
1.利息收入	1,081,583.76
其中：存款利息收入	1,081,583.76
债券利息收入	0.00
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产收入	0.00
其他利息收入	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,135,648.31
其中：股票投资收益	-8,545,872.35
基金投资收益	0.00
债券投资收益	0.00
资产支持证券投资收益	0.00
贵金属投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
股利收益	410,224.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,772,845.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5.其他收入（损失以“-”号填列）	387,252.76
减：二、费用	9,977,509.76
1.管理人报酬	3,242,382.33
2.托管费	540,397.05
3.销售服务费	0.00
4.交易费用	6,056,064.65
5.利息支出	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00
6.其他费用	138,665.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-21,417,166.69
减：所得税费用	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-21,417,166.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月22日(基金合同生效日)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）	334,595,722.64	0.00	334,595,722.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-21,417,166.69	-21,417,166.69
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）	-115,856,042.44	2,870,641.69	-112,985,400.75
其中：1.基金申购款	29,634,323.54	-729,246.36	28,905,077.18
2.基金赎回款	-145,490,365.98	3,599,888.05	-141,890,477.93
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	218,739,680.20	-18,546,525.00	200,193,155.20

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 基金基本情况

大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]3006号文“关于准予大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2016)验字第60469430_H02号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年3月22日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为2016年2月29日至2016年3月18日，首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币334,498,286.64元，折合334,498,286.64份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币97,436.00元，折合97,436.00份基金份额；以上收到的资金共计人民币334,595,722.64元，折合334,595,722.64份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券等固定收益类投资工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、短期融资券、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等）、股指期货、国债期货、权证、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为0-95%；在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于5%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率x50%+中证综合债券指数收益率x50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年3月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、衍生工具等投资。本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)每一基金份额享有同等分配权；

(4)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 税项

7.4.5.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.5.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.5.3 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.6 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
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董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券将所持大成基金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)以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	669,703,872.58	16.45%

7.4.7.1.2 债券交易

本期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

本期无通过关联方交易单元进行的回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.7.1.5 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3月22日(基金合同生效日)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	610,306.32	16.45%	0.00	-

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

(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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,242,382.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,284,053.33

注：(1)基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

(2)于2016年12月31日的应付基金管理费为人民币266,567.85元。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	540,397.05	-

注：(1)基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

(2)于2016年12月31日的应付基金托管费为人民币44,427.99元。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末持有本基金份额。

7.4.7.5 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3月22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
中国银行	113,488,036.39	1,052,632.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

7.4.8 期末（ 2016年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

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
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大资产重组	33.74	2017年2月8日	33.50	296,200	9,850,556.00	9,993,788.00	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大资产重组	14.03	2017年1月23日	14.26	627,000	9,558,293.59	8,796,810.00	-
300213	佳讯飞鸿	2016年11月4日	重大资产重组	25.93	2017年2月17日	25.48	338,600	9,821,052.89	8,779,898.00	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	85,287,047.99	42.23
	其中：股票	85,287,047.99	42.23
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	116,350,431.52	57.61
7	其他各项资产	341,155.18	0.17
8	合计	201,978,634.69	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	64,799,415.99	32.37
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	-	0.00
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	20,487,632.00	10.23
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
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	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	85,287,047.99	42.60

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	002101	广东鸿图	576,181	13,396,208.25	6.69
2	002777	久远银海	129,610	11,690,822.00	5.84
3	002635	安洁科技	296,200	9,993,788.00	4.99
4	600686	金龙汽车	623,160	8,855,103.60	4.42
5	300098	高新兴	627,000	8,796,810.00	4.39
6	300213	佳讯飞鸿	338,600	8,779,898.00	4.39
7	300461	田中精机	118,258	7,548,408.14	3.77
8	600195	中牧股份	324,100	6,887,125.00	3.44
9	300236	上海新阳	104,800	4,034,800.00	2.02
10	300334	津膜科技	165,750	3,013,335.00	1.51

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	002609	捷顺科技	34,833,991.42	17.40
2	600686	金龙汽车	34,664,017.99	17.32
3	600195	中牧股份	32,595,978.96	16.28
4	600458	时代新材	32,075,543.14	16.02
5	300210	森远股份	30,865,195.98	15.42
6	002662	京威股份	29,692,341.30	14.83
7	002537	海立美达	24,884,844.21	12.43
8	000021	深科技	24,644,386.54	12.31
9	603005	晶方科技	24,429,003.52	12.20
10	300078	思创医惠	23,338,986.57	11.66
11	603008	喜临门	23,237,014.54	11.61
12	600497	驰宏锌锗	23,003,332.80	11.49
13	601992	金隅股份	22,266,444.00	11.12
14	000911	南宁糖业	21,927,195.40	10.95
15	000957	中通客车	20,921,976.05	10.45
16	002766	索菱股份	20,177,763.92	10.08
17	000925	众合科技	19,948,351.53	9.96
18	600476	湘邮科技	19,848,370.97	9.91
19	300178	腾邦国际	19,786,533.46	9.88
20	603788	宁波高发	19,525,115.27	9.75
21	600386	北巴传媒	19,510,595.73	9.75
22	002454	松芝股份	19,030,500.70	9.51
23	002668	奥马电器	18,506,296.11	9.24
24	300461	田中精机	18,396,220.87	9.19
25	000060	中金岭南	18,233,627.70	9.11
26	300310	宜通世纪	17,387,735.22	8.69
27	600898	三联商社	16,966,056.77	8.47
28	002103	广博股份	16,951,934.49	8.47
29	002425	凯撒文化	16,427,923.04	8.21
30	002120	韵达股份	15,735,310.89	7.86
31	000065	北方国际	15,036,612.50	7.51
32	002101	广东鸿图	14,730,792.05	7.36
33	002777	久远银海	14,236,874.70	7.11
34	601899	紫金矿业	14,202,998.50	7.09
35	300334	津膜科技	14,036,644.40	7.01
36	300241	瑞丰光电	13,938,564.55	6.96
37	002599	盛通股份	13,865,896.07	6.93
38	600990	四创电子	13,804,748.74	6.90
39	002405	四维图新	13,785,871.50	6.89
40	002669	康达新材	13,696,171.82	6.84
41	002087	新野纺织	13,428,962.19	6.71
42	000948	南天信息	13,363,437.11	6.68
43	002271	东方雨虹	13,338,999.43	6.66
44	601208	东材科技	13,182,153.98	6.58
45	300384	三联虹普	13,076,284.08	6.53
46	002675	东诚药业	13,046,961.48	6.52
47	000889	茂业通信	13,042,105.63	6.51
48	300096	易联众	12,989,754.55	6.49
49	002418	康盛股份	12,982,798.35	6.49
50	002357	富临运业	12,970,169.20	6.48
51	600110	诺德股份	12,939,351.98	6.46
52	300026	红日药业	12,900,585.00	6.44
53	300339	润和软件	12,884,010.05	6.44
54	601689	拓普集团	12,828,650.98	6.41
55	000801	四川九洲	12,817,502.32	6.40
56	002079	苏州固锝	12,812,875.71	6.40
57	002719	麦趣尔	12,737,885.28	6.36
58	603588	高能环境	12,714,854.00	6.35
59	603968	醋化股份	12,639,948.80	6.31
60	300320	海达股份	12,601,213.70	6.29
61	603993	洛阳钼业	12,575,996.00	6.28
62	601789	宁波建工	12,433,659.00	6.21
63	603021	山东华鹏	12,409,763.74	6.20
64	300322	硕贝德	12,320,442.50	6.15
65	601688	华泰证券	12,213,890.89	6.10
66	002753	永东股份	12,147,318.25	6.07
67	300221	银禧科技	12,110,677.80	6.05
68	002434	万里扬	11,995,819.98	5.99
69	600571	信雅达	11,928,644.40	5.96
70	600525	长园集团	11,729,483.29	5.86
71	002051	中工国际	11,606,317.41	5.80
72	002522	浙江众成	11,277,046.00	5.63
73	002264	新 华 都	11,204,766.45	5.60
74	600418	江淮汽车	10,670,624.00	5.33
75	600395	盘江股份	10,607,094.50	5.30
76	603026	石大胜华	10,487,945.44	5.24
77	600155	宝硕股份	10,446,106.75	5.22
78	300502	新易盛	10,440,118.00	5.22
79	300473	德尔股份	10,204,531.00	5.10
80	300230	永利股份	10,115,024.28	5.05
81	002221	东华能源	10,084,530.96	5.04
82	002538	司尔特	10,071,142.84	5.03
83	000421	南京公用	10,064,547.62	5.03
84	300302	同有科技	10,045,677.60	5.02
85	600976	健民集团	10,009,452.68	5.00
86	603601	再升科技	9,950,787.46	4.97
87	000639	西王食品	9,923,878.10	4.96
88	300523	辰安科技	9,874,854.78	4.93
89	002635	安洁科技	9,850,556.00	4.92
90	603818	曲美家居	9,821,214.32	4.91
91	300213	佳讯飞鸿	9,821,052.89	4.91
92	002212	南洋股份	9,804,377.85	4.90
93	300326	凯利泰	9,773,792.40	4.88
94	300408	三环集团	9,760,005.00	4.88
95	000776	广发证券	9,755,844.00	4.87
96	600166	福田汽车	9,747,695.00	4.87
97	002191	劲嘉股份	9,676,163.06	4.83
98	603816	顾家家居	9,644,260.90	4.82
99	300033	同花顺	9,642,904.00	4.82
100	300098	高新兴	9,558,293.59	4.77
101	300236	上海新阳	9,522,246.94	4.76
102	601377	兴业证券	9,406,000.00	4.70
103	002025	航天电器	9,227,726.84	4.61
104	002094	青岛金王	9,227,498.12	4.61
105	000596	古井贡酒	9,114,367.18	4.55
106	603616	韩建河山	9,038,352.92	4.51
107	000937	冀中能源	8,945,900.50	4.47
108	300503	昊志机电	8,831,292.60	4.41
109	002260	德奥通航	8,796,464.10	4.39
110	600860	京城股份	8,659,251.00	4.33
111	600136	当代明诚	8,569,823.28	4.28
112	300336	新文化	8,386,135.46	4.19
113	002268	卫 士 通	8,130,421.00	4.06
114	002529	海源机械	8,084,964.58	4.04
115	000404	华意压缩	7,878,926.00	3.94
116	002553	南方轴承	7,742,183.72	3.87
117	300422	博世科	7,579,249.25	3.79
118	000882	华联股份	7,472,572.78	3.73
119	300247	乐金健康	7,323,436.04	3.66
120	300101	振芯科技	7,305,378.20	3.65
121	300225	金力泰	7,278,158.00	3.64
122	300542	新晨科技	7,186,662.27	3.59
123	300136	信维通信	7,132,977.44	3.56
124	300548	博创科技	7,115,774.71	3.55
125	002354	天神娱乐	7,066,502.00	3.53
126	000606	*ST易桥	7,021,750.77	3.51
127	000810	创维数字	7,002,789.64	3.50
128	002761	多喜爱	6,855,841.66	3.42
129	600498	烽火通信	6,711,402.70	3.35
130	002303	美盈森	6,706,269.26	3.35
131	300479	神思电子	6,693,845.68	3.34
132	600661	新南洋	6,686,601.00	3.34
133	002730	电光科技	6,677,847.00	3.34
134	002153	石基信息	6,657,062.81	3.33
135	603313	梦百合	6,642,495.70	3.32
136	600595	中孚实业	6,632,968.76	3.31
137	300231	银信科技	6,602,791.05	3.30
138	300449	汉邦高科	6,589,620.00	3.29
139	300165	天瑞仪器	6,530,598.70	3.26
140	002196	方正电机	6,487,626.50	3.24
141	002017	东信和平	6,339,030.44	3.17
142	600731	湖南海利	6,256,305.87	3.13
143	002686	亿利达	6,193,614.50	3.09
144	300174	元力股份	6,189,695.82	3.09
145	300282	汇冠股份	6,108,587.75	3.05
146	300325	德威新材	6,030,721.96	3.01
147	300342	天银机电	6,002,831.71	3.00
148	603869	北部湾旅	5,968,813.00	2.98
149	600080	金花股份	5,966,202.00	2.98
150	002544	杰赛科技	5,954,741.66	2.97
151	601618	中国中冶	5,936,697.00	2.97
152	600530	交大昂立	5,907,645.00	2.95
153	603766	隆鑫通用	5,902,118.00	2.95
154	002053	云南能投	5,463,994.00	2.73
155	300521	爱司凯	5,224,147.00	2.61
156	603020	爱普股份	5,141,893.00	2.57
157	002322	理工环科	5,133,266.00	2.56
158	000818	方大化工	5,057,193.00	2.53
159	300130	新国都	5,052,177.18	2.52
160	300146	汤臣倍健	5,038,429.00	2.52
161	002371	七星电子	5,026,161.00	2.51
162	300284	苏交科	4,908,522.00	2.45
163	600506	香梨股份	4,892,227.00	2.44
164	300056	三维丝	4,870,321.00	2.43
165	300538	同益股份	4,821,979.20	2.41
166	002247	帝龙文化	4,806,760.00	2.40
167	300436	广生堂	4,747,874.72	2.37
168	300458	全志科技	4,725,893.00	2.36
169	300379	东方通	4,708,305.70	2.35
170	603729	龙韵股份	4,707,551.24	2.35
171	000529	广弘控股	4,598,649.00	2.30
172	300144	宋城演艺	4,519,605.59	2.26
173	000531	穗恒运A	4,443,218.05	2.22
174	600075	新疆天业	4,355,514.17	2.18
175	600551	时代出版	4,149,089.04	2.07
176	600779	水井坊	4,109,518.00	2.05
177	000997	新 大 陆	4,106,620.00	2.05

注：本项中“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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002609	捷顺科技	33,650,471.12	16.81
2	600458	时代新材	33,105,296.82	16.54
3	300210	森远股份	29,834,398.52	14.90
4	002662	京威股份	29,402,654.59	14.69
5	600686	金龙汽车	27,143,533.18	13.56
6	000021	深科技	26,945,525.61	13.46
7	002537	海立美达	25,421,742.47	12.70
8	600195	中牧股份	25,210,030.79	12.59
9	603005	晶方科技	24,435,410.29	12.21
10	000911	南宁糖业	23,685,899.69	11.83
11	603008	喜临门	23,152,679.53	11.57
12	300078	思创医惠	22,842,113.50	11.41
13	600386	北巴传媒	22,016,314.30	11.00
14	600497	驰宏锌锗	21,833,832.90	10.91
15	000925	众合科技	21,442,450.32	10.71
16	601992	金隅股份	20,534,722.91	10.26
17	002766	索菱股份	20,485,869.74	10.23
18	603788	宁波高发	19,687,410.00	9.83
19	300178	腾邦国际	19,210,143.45	9.60
20	002120	韵达股份	19,194,614.70	9.59
21	000957	中通客车	19,004,224.78	9.49
22	002668	奥马电器	18,840,512.85	9.41
23	600476	湘邮科技	18,772,704.08	9.38
24	000060	中金岭南	18,525,092.94	9.25
25	002454	松芝股份	18,064,212.55	9.02
26	300310	宜通世纪	17,492,566.15	8.74
27	002103	广博股份	16,002,770.78	7.99
28	600898	三联商社	15,914,445.46	7.95
29	002425	凯撒文化	15,287,867.60	7.64
30	000065	北方国际	14,777,900.97	7.38
31	002079	苏州固锝	14,103,295.70	7.04
32	600990	四创电子	14,098,746.88	7.04
33	002418	康盛股份	14,094,311.30	7.04
34	002719	麦趣尔	14,001,169.37	6.99
35	300339	润和软件	13,910,644.44	6.95
36	601689	拓普集团	13,822,897.56	6.90
37	600110	诺德股份	13,809,062.84	6.90
38	601899	紫金矿业	13,803,755.00	6.90
39	002271	东方雨虹	13,781,118.77	6.88
40	002599	盛通股份	13,736,902.36	6.86
41	300322	硕贝德	13,604,983.86	6.80
42	000948	南天信息	13,471,765.11	6.73
43	000889	茂业通信	13,457,089.54	6.72
44	002405	四维图新	13,412,453.55	6.70
45	002669	康达新材	13,286,546.68	6.64
46	300026	红日药业	13,095,959.26	6.54
47	300096	易联众	13,095,016.84	6.54
48	002087	新野纺织	13,025,029.86	6.51
49	002675	东诚药业	13,004,326.36	6.50
50	603588	高能环境	12,987,787.80	6.49
51	000801	四川九洲	12,686,265.65	6.34
52	300384	三联虹普	12,669,185.70	6.33
53	601789	宁波建工	12,578,971.80	6.28
54	603993	洛阳钼业	12,530,986.94	6.26
55	002522	浙江众成	12,348,335.00	6.17
56	300241	瑞丰光电	12,267,986.00	6.13
57	601208	东材科技	12,235,207.55	6.11
58	002434	万里扬	12,210,102.39	6.10
59	600418	江淮汽车	12,062,045.00	6.03
60	603021	山东华鹏	12,014,620.00	6.00
61	002357	富临运业	12,009,682.00	6.00
62	300320	海达股份	11,994,885.50	5.99
63	002051	中工国际	11,988,866.56	5.99
64	601688	华泰证券	11,978,418.83	5.98
65	603968	醋化股份	11,915,841.00	5.95
66	002264	新 华 都	11,746,013.90	5.87
67	600525	长园集团	11,369,299.50	5.68
68	300221	银禧科技	11,251,790.86	5.62
69	300503	昊志机电	11,055,091.54	5.52
70	300473	德尔股份	10,978,879.70	5.48
71	600976	健民集团	10,875,933.75	5.43
72	300334	津膜科技	10,735,440.50	5.36
73	600155	宝硕股份	10,626,684.56	5.31
74	300461	田中精机	10,609,731.84	5.30
75	000639	西王食品	10,500,362.60	5.25
76	603601	再升科技	10,402,782.24	5.20
77	600166	福田汽车	10,387,198.00	5.19
78	300502	新易盛	10,351,789.26	5.17
79	300326	凯利泰	10,311,559.60	5.15
80	002753	永东股份	10,276,069.36	5.13
81	603026	石大胜华	10,204,229.00	5.10
82	600395	盘江股份	10,159,180.79	5.07
83	002221	东华能源	10,135,478.58	5.06
84	603816	顾家家居	10,059,289.00	5.02
85	002191	劲嘉股份	10,036,916.34	5.01
86	002212	南洋股份	9,945,488.00	4.97
87	603818	曲美家居	9,905,081.00	4.95
88	300302	同有科技	9,734,835.00	4.86
89	300523	辰安科技	9,724,742.29	4.86
90	002538	司尔特	9,647,614.00	4.82
91	600571	信雅达	9,617,346.32	4.80
92	601377	兴业证券	9,591,165.00	4.79
93	300230	永利股份	9,574,004.15	4.78
94	000776	广发证券	9,554,061.00	4.77
95	300033	同花顺	9,538,271.00	4.76
96	000421	南京公用	9,412,687.64	4.70
97	300408	三环集团	9,254,334.86	4.62
98	002094	青岛金王	9,059,857.88	4.53
99	002025	航天电器	8,931,914.92	4.46
100	000937	冀中能源	8,711,074.22	4.35
101	000596	古井贡酒	8,684,781.00	4.34
102	603616	韩建河山	8,239,419.96	4.12
103	002529	海源机械	8,180,094.97	4.09
104	600136	当代明诚	8,124,100.35	4.06
105	600860	京城股份	8,079,052.00	4.04
106	002268	卫 士 通	7,827,981.32	3.91
107	002260	德奥通航	7,772,129.09	3.88
108	300336	新文化	7,679,185.17	3.84
109	300136	信维通信	7,643,245.12	3.82
110	300101	振芯科技	7,532,559.21	3.76
111	000404	华意压缩	7,508,583.00	3.75
112	300422	博世科	7,299,485.20	3.65
113	002761	多喜爱	7,279,328.20	3.64
114	300548	博创科技	7,170,025.42	3.58
115	000606	*ST易桥	7,142,520.83	3.57
116	300247	乐金健康	7,094,353.56	3.54
117	000810	创维数字	7,036,131.15	3.51
118	002354	天神娱乐	6,903,864.80	3.45
119	002553	南方轴承	6,896,204.09	3.44
120	002730	电光科技	6,839,363.45	3.42
121	300225	金力泰	6,805,038.00	3.40
122	300542	新晨科技	6,740,972.33	3.37
123	603313	梦百合	6,623,281.00	3.31
124	002303	美盈森	6,616,791.32	3.31
125	603869	北部湾旅	6,608,630.86	3.30
126	000882	华联股份	6,595,201.75	3.29
127	002153	石基信息	6,541,139.43	3.27
128	002196	方正电机	6,499,887.44	3.25
129	300479	神思电子	6,490,917.71	3.24
130	600498	烽火通信	6,440,715.50	3.22
131	600661	新南洋	6,389,379.69	3.19
132	600595	中孚实业	6,374,431.24	3.18
133	300231	银信科技	6,292,933.44	3.14
134	002017	东信和平	6,222,665.00	3.11
135	601618	中国中冶	6,027,412.00	3.01
136	300342	天银机电	6,016,658.82	3.01
137	300165	天瑞仪器	5,935,419.28	2.96
138	002544	杰赛科技	5,891,129.74	2.94
139	300282	汇冠股份	5,882,948.69	2.94
140	600731	湖南海利	5,790,660.46	2.89
141	600080	金花股份	5,769,734.00	2.88
142	300174	元力股份	5,655,180.36	2.82
143	603766	隆鑫通用	5,643,144.22	2.82
144	300521	爱司凯	5,553,340.00	2.77
145	002686	亿利达	5,527,556.64	2.76
146	600530	交大昂立	5,459,185.00	2.73
147	300449	汉邦高科	5,424,069.50	2.71
148	002053	云南能投	5,297,425.29	2.65
149	300130	新国都	5,293,864.40	2.64
150	000818	方大化工	5,291,660.00	2.64
151	300325	德威新材	5,267,986.49	2.63
152	000531	穗恒运A	5,149,675.98	2.57
153	603020	爱普股份	5,018,200.84	2.51
154	300146	汤臣倍健	4,962,828.04	2.48
155	002371	七星电子	4,908,019.92	2.45
156	002247	帝龙文化	4,865,046.00	2.43
157	002322	理工环科	4,814,265.00	2.40
158	300284	苏交科	4,756,805.84	2.38
159	600506	香梨股份	4,707,665.99	2.35
160	300379	东方通	4,682,101.00	2.34
161	600075	新疆天业	4,678,389.96	2.34
162	300538	同益股份	4,646,879.00	2.32
163	300458	全志科技	4,643,081.00	2.32
164	300056	三维丝	4,586,176.49	2.29
165	300436	广生堂	4,555,624.00	2.28
166	000529	广弘控股	4,502,684.48	2.25
167	603729	龙韵股份	4,484,506.76	2.24
168	300144	宋城演艺	4,471,419.68	2.23
169	300499	高澜股份	4,413,036.00	2.20
170	600552	凯盛科技	4,277,855.00	2.14
171	600779	水井坊	4,195,497.42	2.10
172	300236	上海新阳	4,165,204.00	2.08

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	2,084,391,111.15
卖出股票收入（成交）总额	1,985,785,345.67

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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备选股票库之外股票。

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	315,815.60
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	20,245.30
5	应收申购款	5,094.28
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	341,155.18

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002635	安洁科技	9,993,788.00	4.99	重大事项
2	300098	高新兴	8,796,810.00	4.39	重大事项
3	300213	佳讯飞鸿	8,779,898.00	4.39	重大事项

§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
2,122	103,081.85	11,788,422.29	5.39%	206,951,257.91	94.61%

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	1,488,952.45	0.6807%

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（2016年3月22日 ）基金份额总额	334,595,722.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,634,323.54
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	145,490,365.98
本报告期期末基金份额总额	218,739,680.20

§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：

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为5万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内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	669,703,872.58	16.45%	610,306.32	16.45%	-
招商证券	2	548,461,770.35	13.48%	499,816.97	13.48%	-
长江证券	1	494,739,803.93	12.16%	450,857.37	12.16%	-
万联证券	1	371,157,406.57	9.12%	338,239.65	9.12%	-
安信证券	2	308,586,313.15	7.58%	281,216.95	7.58%	-
渤海证券	2	278,317,521.52	6.84%	253,635.50	6.84%	-
国海证券	1	212,424,150.78	5.22%	193,585.62	5.22%	-
东方证券	1	175,921,780.62	4.32%	160,317.62	4.32%	-
国泰君安	1	156,695,230.93	3.85%	142,800.38	3.85%	-
中投证券	3	105,905,379.71	2.60%	96,510.56	2.60%	-
方正证券	1	90,461,607.58	2.22%	82,442.73	2.22%	-
中信证券	2	79,264,996.34	1.95%	72,233.91	1.95%	-
湘财证券	1	69,140,497.27	1.70%	63,006.08	1.70%	-
华泰证券	2	65,773,278.74	1.62%	59,940.47	1.62%	-
广发证券	1	64,419,121.06	1.58%	58,707.24	1.58%	-
华鑫证券	1	61,530,746.35	1.51%	56,070.34	1.51%	-
东吴证券	1	41,400,710.67	1.02%	37,728.44	1.02%	-
中泰证券	1	39,517,964.78	0.97%	36,012.45	0.97%	-
海通证券	2	38,855,673.60	0.95%	35,410.10	0.95%	-
平安证券	1	36,493,920.43	0.90%	33,258.12	0.90%	-
申银万国	1	36,462,093.31	0.90%	33,228.61	0.90%	-
国都证券	1	25,724,345.02	0.63%	23,443.23	0.63%	-
华林证券	1	24,443,691.69	0.60%	22,274.59	0.60%	-
银河证券	1	23,423,544.04	0.58%	21,347.57	0.58%	-
东莞证券	1	20,646,174.50	0.51%	18,814.38	0.51%	-
西南证券	1	18,107,321.63	0.44%	16,501.53	0.44%	-
中信建投	1	12,597,539.67	0.31%	11,480.28	0.31%	-
中银国际	1	0.00	-	0.00	-	-
天源证券	1	0.00	-	0.00	-	-
英大证券	1	0.00	-	0.00	-	-
中航证券	1	0.00	-	0.00	-	-
中金公司	2	0.00	-	0.00	-	-
国信证券	1	0.00	-	0.00	-	-
江海证券	1	0.00	-	0.00	-	-
民生证券	1	0.00	-	0.00	-	-
民族证券	1	0.00	-	0.00	-	-
广州证券	1	0.00	-	0.00	-	-
恒泰证券	1	0.00	-	0.00	-	-
华宝证券	1	0.00	-	0.00	-	-
华福证券	1	0.00	-	0.00	-	-
东兴证券	1	0.00	-	0.00	-	-
东海证券	1	0.00	-	0.00	-	-
财富证券	1	0.00	-	0.00	-	-
长城证券	1	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。

本报告期内交易单元全部为新增。

§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