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8月24日

§1 重要提示

1.1 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。本半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8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2017年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成优选混合（LOF）
基金主代码	160916
交易代码	160916
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2012年7月27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	252,235,258.25份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年12月28日

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，追求基金资产长期稳健增值
投资策略	本基金将在全球视野下，基于宏观经济研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，主要采用优选个股的主动投资策略，获取超额收益。优选个股是指积极、深入、全面地了解上市公司基本面，动态评估公司价值，当股价低于合理价值区域时，买入并持有；在股价回复到合理价值的过程中，分享股价提升带来的超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。

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	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	38,231,275.61
本期利润	85,371,081.86
加权平均基金份额本期利润	0.3121
本期基金份额净值增长率	14.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.2095
期末基金资产净值	635,556,104.69
期末基金份额净值	2.520

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。

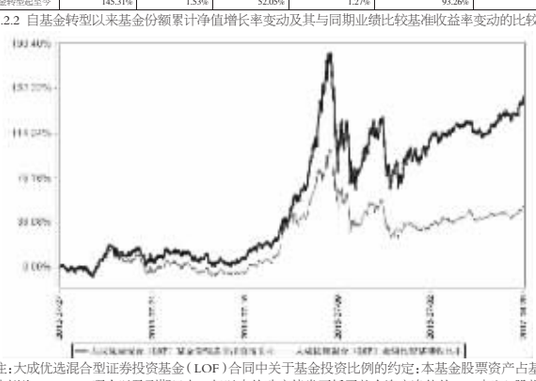
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	6.64%	0.73%	4.19%	0.54%	2.45%	0.19%
过去三个月	7.97%	0.64%	4.92%	0.50%	3.05%	0.14%
过去六个月	14.29%	0.59%	8.59%	0.46%	5.70%	0.13%
过去一年	17.76%	0.63%	13.05%	0.54%	4.71%	0.09%
过去三年	129.30%	1.76%	59.62%	1.40%	69.68%	0.36%
日基金转型起至今	145.31%	1.53%	52.05%	1.27%	93.26%	0.26%

3.2.2 自基金转型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：大成优选混合型证券投资基金（LOF）合同中关于基金投资比例的约定：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%；现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金转型日期为2012年7月27日。本基金的建仓期为6个月，截至报告日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。

§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6月30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74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		
戴军先生	本基金基金经理，研究部副总监	2015年5月21日	-	6年	金融学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司，历任研究员、行业研究主管、大成价值增长基金经理助理。2015年5月21日至2015年7月23日任大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理。2015年7月24日起任大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年8月19日起任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任研究部副总监。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

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。

4.3.2 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6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

上半年，在经济回暖、利率上行、监管加强背景下，A股运行结构显著区别于过去三年，大市值、低估值、龙头白马股重获机构青睐，并且有愈演愈烈趋势。本基金核心持有的两类资产中，估值中枢回归类获得了显著的超额收益，这类处于成熟期的龙头公司，相当一部分已经创出历史新高，或处于历史估值中枢偏上限位置；细分成长类受到高估值压制，并无特别表现，但亦无风险出现。同时，本基金在定增量化、打新、交易所回购等策略方向也有所斩获。总体来说，大成优选保持了低换手、低回撤、较高的收益排位，延续了一贯稳健不失积极的风格。

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2.520元；本报告期基金份额净值增长率为14.29%，业绩比较基准收益率为8.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

可以预见的未来一年，政局稳定，经济保持中高速发展，同时产业结构升级和开放度加大，这为企业盈利端继续成长提供了较好的基础。金融监管进入新一轮加强周期，溯本清源，有利于抑制不合理杠杆和泡沫。我们认为在合理收益预期下，A股市场仍是积极可为，并且机构投资者、长期投资者具备更佳的投资环境。经过近三季度的纠偏调整、风格演进，目前来看前期部分较热的大市值、低估值、龙头白马股市值、估值已经处于合理偏高位置，展望未来，组合也需要进行结构性调整。我们长期看好消费健康、核心制造、互联娱乐三个符合中国产业升级、消费升级的方向，对于正确的方向，需要日复一日进行知识积累，力图达到更高的选股胜率。中期，在成熟型行业中，汽车及零配件国产化加速趋势，平台型医药公司、金融类绝对低估值领域，周期过剩行业中率先走出的公司值得重点研究跟踪。另外，2014-2017新上市一批次新股，其中必然会有一些新产业、新技术、新模式，需要认真甄别筛选，这是最容易出现大幅超额收益成长股的领域。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成优选混合型证券投资基金(LOF)（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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

大成优选混合型证券投资基金（LOF）

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成优选混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：		
银行存款	27,038,102.36	105,053,667.10
结算备付金	35,293,027.68	35,578,005.10
存出保证金	202,665.87	135,765.57
交易性金融资产	563,205,445.15	448,184,061.23
其中：股票投资	562,119,045.55	448,184,061.23
基金投资	-	-
债券投资	1,086,399.60	-
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	-	50,000,000.00
应收证券清算款	11,000,002.66	-
应收利息	8,366.38	163,237.68
应收股利	-	-
应收申购款	218,134.80	427.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	636,965,744.90	639,115,163.96
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30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	-	-
应付赎回款	144,727.75	46,417.14
应付管理人报酬	638,544.67	725,106.44
应付托管费	127,708.94	145,021.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	268,740.41	595,174.43
应交税费	16,313.60	16,313.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	213,604.84	170,168.62
负债合计	1,409,640.21	1,698,201.52
所有者权益：		
实收基金	330,485,749.06	378,702,793.64
未分配利润	305,070,355.63	258,714,168.80
所有者权益合计	635,556,104.69	637,416,962.44
负债和所有者权益总计	636,965,744.90	639,115,163.96

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值2.520元，基金份额总额252,235,258.25份。

6.2 利润表

会计主体：大成优选混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	91,999,534.48	-43,376,546.61
1.利息收入	361,971.01	660,581.99
其中：存款利息收入	344,039.99	445,241.58
债券利息收入	660.07	38,703.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	17,270.95	176,636.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	44,374,776.43	13,579,874.79
其中：股票投资收益	38,487,106.56	1,793,972.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-2,150.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	9,138,182.86
股利收益	5,887,669.87	2,649,868.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	47,139,806.25	-57,645,762.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	122,980.79	28,758.90
减：二、费用	6,628,452.62	5,573,320.00
1.管理人报酬	3,923,701.51	3,601,440.15
2.托管费	784,740.36	720,288.03
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,681,380.15	1,024,137.30
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	238,630.60	227,454.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	85,371,081.86	-48,949,866.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	85,371,081.86	-48,949,866.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成优选混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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）	378,702,793.64	258,714,168.80	637,416,962.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	85,371,081.86	85,371,081.86
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）	-48,217,044.58	-39,014,895.03	-87,231,939.61
其中：1.基金申购款	12,614,104.80	9,344,655.94	21,958,760.74
2.基金赎回款	-60,831,149.38	-48,359,550.97	-109,190,700.35
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）	330,485,749.06	305,070,355.63	635,556,104.69

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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）	390,711,001.19	295,828,298.22	686,539,299.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-48,949,866.61	-48,949,866.61
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）	-10,282,375.25	-6,106,429.49	-16,388,804.74
其中：1.基金申购款	8,559,603.78	4,323,806.76	12,883,410.54
2.基金赎回款	-18,841,979.03	-10,430,236.25	-29,272,215.28
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）	380,428,625.94	240,772,002.12	621,200,628.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____罗登攀_____ _____周立新_____ _____崔伟____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 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。

(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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	54,718,345.61	4.87%	42,663,663.78	6.44%

6.4.4.1.2 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6月30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	49,869.44	4.87%	434.44	0.16%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	38,880.56	6.44%	38,880.56	12.72%

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,923,701.51	3,601,440.15
其中：支付销售机构的客户维护费	766,132.27	723,979.02

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1.25%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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 ×1.25% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	784,740.36	720,288.03

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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	27,038,102.36	333,366.36	57,809,278.94	438,404.98

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末（ 2017年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.12.1.1 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
000513	丽珠集团	2016年9月19日	2017年9月20日	非公开发行流通受限	50.10	63.93	200,000	10,020,000.00	12,786,000.00	-
601689	拓普集团	2017年5月26日	2018年5月24日	非公开发行流通受限	30.52	30.81	327,653	9,999,969.56	10,094,988.93	-
601000	唐山港	2016年12月19日	2017年12月19日	非公开发行流通受限	4.16	4.67	1,201,923	4,999,999.68	5,612,980.41	-
002705	新宝股份	2017年3月30日	2018年4月2日	非公开发行流通受限	17.86	13.86	363,917	4,999,656.96	5,043,889.62	2017年6月9日每股转增0.3股
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烈智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月5日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
	合计							562,119,045.55		88.45

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票，所认购的股票自股份解除限售之日起12个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%；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。

6.4.5.2 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
002127	南极电商	2017年6月29日	临时停牌	12.08	2017年7月6日	12.61	56,590	461,989.59	683,607.20	-
300461	田中精机	2017年5月10日	临时停牌	64.65	-	-	7,200	511,261.31	465,480.00	-
300518	盛讯达	2016年12月13日	临时停牌	113.30	2017年7月10日	101.97	1,306	29,019.32	147,969.80	-

注：本基金截至2017年6月30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。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，银行间市场本基金无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，交易所市场本基金无债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 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	562,119,045.55	88.25
	其中：股票	562,119,045.55	88.25
2	固定收益投资	1,086,399.60	0.17
	其中：债券	1,086,399.60	0.17
	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	62,331,130.04	9.79
7	其他各项资产	11,429,169.71	1.79
8	合计	636,965,744.90	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	17,564,203.00	2.76
C	制造业	410,148,717.92	64.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	63,448.00	0.01
E	建筑业	429,214.23	0.07
F	批发和零售业	1,088,496.50	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	19,951,562.90	3.14
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,867,410.63	7.85
J	金融业	684,043.49	0.11
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	1,683,341.72	0.26
M	科学研究和技术服务业	54,671.04	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	40,907,362.12	6.44
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	19,548,867.00	3.08
R	文化、体育和娱乐业	127,707.00	0.02
S	综合	-	0.00
	合计	562,119,045.55	88.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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	000513	丽珠集团	685,328	45,836,836.80	7.21
2	002126	银轮股份	3,525,400	35,465,524.00	5.58
3	600406	国电南瑞	1,799,989	31,769,805.85	5.00
4	600104	上汽集团	999,918	31,