

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
报告送出日期:2018年1月20日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2018年1月19日核对了本报表中的财务数据、净值表现和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。

本报告公告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

基金简称 大成创新

交易代码 000910

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2006年10月26日

报告期末基金资产净值 2,106,290,782.99

投资目标 在控制风险的前提下，追求资本增值，精选具备成长潜力、价值低估的个股进行投资和长期持有。

投资策略 本基金的股票投资策略为主，采用行业投资策略、精选具备成长潜力、价值低估的个股进行投资和长期持有。

业绩比较基准 沪深300指数×70%+中债国债总指数×30%

风险收益特征 本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年10月1日 - 2017年12月31日)

1.本期利润 30,114,083.03

2.本期利润/期初基金资产净值 -210,000,796.70

3.期末基金资产净值 0.0964

4.期末基金份额净值 2,399,693,079.07

5.期末基金净值增长率 1.00%

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.所列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将低于不计费用的。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.5 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.6 基金净值表现

3.2.7 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.8 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.11 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.12 基金净值表现

3.2.13 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.14 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.15 基金净值表现

3.2.16 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.17 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.18 基金净值表现

3.2.19 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.20 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.21 基金净值表现

3.2.22 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.23 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.24 基金净值表现

3.2.25 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.26 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.27 基金净值表现

3.2.28 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.29 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.30 基金净值表现

3.2.31 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.32 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.33 基金净值表现

3.2.34 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.35 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.36 基金净值表现

3.2.37 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.38 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.39 基金净值表现

3.2.40 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.41 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.42 基金净值表现

3.2.43 本报告期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 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.10% 0.05% -0.23% -0.40% -0.43% 0.04%

3.2.44 自基金合同生效以来基金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.本基金合同规定,基金合同生效之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。建仓期结束后,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
2.所列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将低于不计费用的。

3.2.45 基金净值表现

3.2.46 本报告期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 净值增长(%)