

大成景恒保本混合型证券投资基金  
2016 年半年度报告  
2016 年 6 月 30 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：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 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.....	38
7.9 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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	39

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 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.....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>46</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成景恒保本混合型证券投资基金
基金简称	大成景恒保本混合
基金主代码	090019
交易代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 15 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	227,432,824.38 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用 VPPI 可变组合保险策略 (Variable Proportion Portfolio Insurance)。VPPI 策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制，将基金资产动态优化分配在保本资产和风险资产上；并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重，在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上，积极参与分享市场可能出现的风险收益，从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产，其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具；风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率（按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位，单位为百分数）计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

## 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	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司	深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22、23 层

## § 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	82,335.93
本期利润	-5,565,613.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0106
本期加权平均净值利润率	-1.04%
本期基金份额净值增长率	-0.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	58,094,531.49
期末可供分配基金份额利润	0.2554
期末基金资产净值	230,005,766.70
期末基金份额净值	1.011
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.34%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

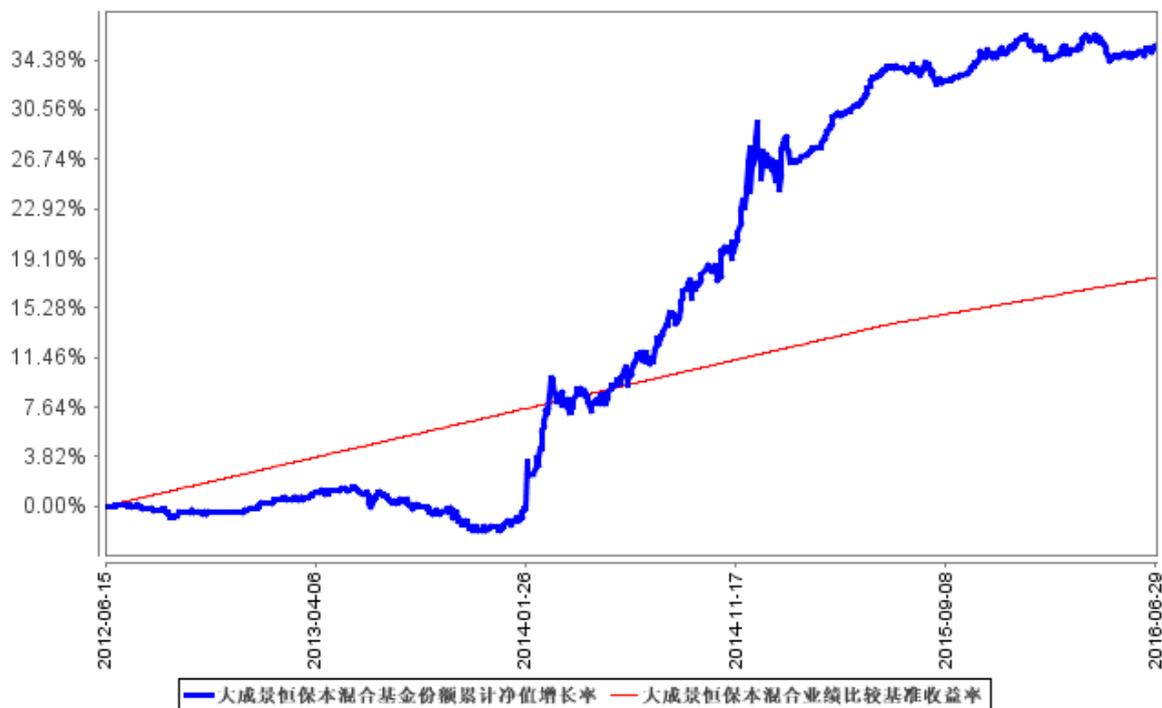
3、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	0.40%	0.11%	0.24%	0.01%	0.16%	0.10%
过去三个月	-0.49%	0.11%	0.75%	0.01%	-1.24%	0.10%
过去六个月	-0.59%	0.12%	1.50%	0.01%	-2.09%	0.11%
过去一年	1.10%	0.12%	3.07%	0.01%	-1.97%	0.11%
过去三年	34.40%	0.32%	12.19%	0.01%	22.21%	0.31%
自基金合同生效起至今	35.34%	0.28%	17.64%	0.01%	17.70%	0.27%

### 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：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。

## § 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%)。截至 2016 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：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金 (LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、

大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

#### 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		
赵世宏先生	本基金基金经理	2016 年 3 月 26 日	-	5 年	经济学硕士，2011 年 3 月至 2012 年 9 月任中银基金管理有限公司研究员。2012 年 9 月至 2015 年 9

					<p>月任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2015 年 9 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。自 2016 年 3 月 26 日起担任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成景利混合型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金和大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
王磊先生	本基金基金经理	2013 年 7 月 17 日	2016 年 3 月 25 日	12 年	<p>经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳</p>

					收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2014 年 12 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动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
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2013 年 10 月 28 日	-	12 年	南开大学经济学学士，2013 年 7 月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013 年 10 月 14 日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013 年 10 月 28 日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014 年 3 月 18 日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014 年 3 月 18 日至 2014 年 12 月 23 日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 23 日至 2014 年 12 月 23 日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理。2014 年 6 月 26 日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014 年 12 月 24 日起，任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015 年 3 月 21 日起，任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月 27 日起，任大成景秀灵活配置混合型

					证券投资基金基金经理。 2015 年 4 月 29 日起，任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 2015 年 5 月 4 日起，任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 2015 年 5 月 15 日起，任大成景源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》、《大成景恒保本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，大成景恒保本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分析及相应交易情形的分析结果表明：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组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的

行为进行分析。2016 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

#### 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

一季度，在经济下行压力下，政府加大了稳增长力度，大宗商品持续走强，信贷迭创新高。以

“权威”人士谈话作为分界线，二季度国内经济政策出现转向，供给侧改革重回政策主线。临近季末，英国“脱欧”公投又给资本市场带来极大的扰动，全球货币政策宽松预期再起。

各类资产表现方面，供需缺口带来金属、能源等大宗商品的持续上涨。权益市场震荡向上，周期股走势较强。信贷需求猛增导致以 10 年国开债为标志的无风险利率大幅上行 50 个 BP，信用利差则在债转股的政策传闻下直接大幅走阔。但在 5 月初“权威”人士谈话后，大宗能源价格迅速回落，债券市场重回牛市，信用利差迅速缩窄，权益市场重回存量博弈的格局。

组合操作上，本基金根据市场变化灵活调整了仓位，并积极参与新股的申购。

##### 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 1.011 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.50%，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

展望下半年，国内货币政策环境依然会相对宽松。一方面，供给侧改革的基调应不会改变，需求端的刺激相对有限。另一方面，通胀数据在高基数的影响下，三季度仍将处低位。与此同时，英国“脱欧”带来较大的不确定，全球货币宽松格局还将延续，G20 会议将加强全球主要经济体间经济政策的协调，人民币汇率风险明显降低。

在供给侧改革与宽货币的政策环境下，权益市场的投资机会更多体现于个股和板块，债券市场利率风险可控，但需要提防垃圾债的违约风险。权益类操作将继续注重自下而上挖掘投资机会，关注符合转型升级方向的成长个股。债券类操作将继续规避高风险行业及个券，积极调整杠杆及

久期，把握利率波段行情。

#### 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、专户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、风险管理部和专户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”）在大成景恒保本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

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：大成景恒保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	2,795,221.29	4,899,599.48
结算备付金		2,422,311.95	12,341,046.58
存出保证金		64,659.43	246,872.68
交易性金融资产	6.4.3.2	158,088,762.60	573,261,552.04
其中：股票投资		11,715,912.08	34,380,052.04
基金投资		-	-
债券投资		146,372,850.52	538,881,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.3.4	60,000,380.00	360,000,860.00
应收证券清算款		5,549,893.63	15,459,314.49
应收利息	6.4.3.5	1,879,295.74	11,670,984.34
应收股利		-	-
应收申购款		99.05	70,523.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		230,800,623.69	977,950,752.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		34,461.70	1,482,021.61
应付管理人报酬		248,545.65	991,118.97
应付托管费		41,424.27	165,186.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	98,171.37	269,785.12
应交税费		188,252.80	188,252.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	184,001.20	170,246.25
负债合计		794,856.99	3,266,611.22
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	169,892,713.86	715,394,926.80
未分配利润	6.4.3.10	60,113,052.84	259,289,214.91
所有者权益合计		230,005,766.70	974,684,141.71
负债和所有者权益总计		230,800,623.69	977,950,752.93

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.011 元，基金份额总额 227,432,824.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
-----	-----	--------------------------------	-------------------------------------

一、收入		-1,101,704.33	223,979,220.96
1. 利息收入		10,799,577.65	33,981,940.00
其中：存款利息收入	6.4.3.11	173,198.35	15,872,860.45
债券利息收入		9,629,441.93	6,446,735.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		996,937.37	11,662,343.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,381,612.25	198,765,250.63
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-8,642,323.62	195,257,290.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	2,211,648.55	3,357,045.18
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	49,062.82	150,914.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-5,647,949.30	-10,683,201.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	128,279.57	1,915,231.38
<b>减：二、费用</b>		4,463,909.04	22,583,669.12
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	3,202,664.82	18,263,498.53
2. 托管费	6.4.6.2.2	533,777.49	3,043,916.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	512,674.65	1,038,531.06
5. 利息支出		-	6,536.72
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,536.72
6. 其他费用	6.4.3.20	214,792.08	231,186.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,565,613.37	201,395,551.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,565,613.37	201,395,551.84

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	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)	715,394,926.80	259,289,214.91	974,684,141.71
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-5,565,613.37	-5,565,613.37
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)	-545,502,212.94	-193,610,548.70	-739,112,761.64
其中: 1. 基金申购款	973,270.68	343,971.61	1,317,242.29
2. 基金赎回款	-546,475,483.62	-193,954,520.31	-740,430,003.93
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	169,892,713.86	60,113,052.84	230,005,766.70
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	293,139,885.73	79,512,997.95	372,652,883.68
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	201,395,551.84	201,395,551.84
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)	3,143,533,969.47	883,043,655.45	4,026,577,624.92
其中: 1. 基金申购款	3,562,907,139.35	1,014,098,705.61	4,577,005,844.96
2. 基金赎回款	-419,373,169.88	-131,055,050.16	-550,428,220.04
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)	3,436,673,855.20	1,163,952,205.24	4,600,626,060.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗登攀	_____ 周立新	_____ 范瑛
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

#### 6.4.2.1 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。

#### 6.4.2.2 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征收范围，不征收营业税。

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。

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。

#### 6.4.2.3 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，减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得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。

#### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,795,221.29
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,795,221.29

##### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,077,682.36	11,715,912.08	638,229.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	33,246,317.44	33,102,850.52
	银行间市场	112,884,938.81	113,270,000.00
	合计	146,131,256.25	146,372,850.52
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	157,208,938.61	158,088,762.60	879,823.99

**6.4.3.3 衍生金融资产/负债**

无。

**6.4.3.4 买入返售金融资产****6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	20,000,000.00	—
买入返售证券_银行间	40,000,380.00	—
合计	60,000,380.00	—

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.3.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,892.63
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	981.09
应收债券利息	1,851,703.83
应收买入返售证券利息	24,692.00
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	26.19
合计	1,879,295.74

**6.4.3.6 其他资产**

无。

**6.4.3.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	88,373.52
银行间市场应付交易费用	9,797.85
合计	98,171.37

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.76
预提费用	183,987.44
预提审计费	-
预提信息披露费	-
合计	184,001.20

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	958,035,336.39	715,394,926.80
本期申购	1,303,308.37	973,270.68
本期赎回(以“-”号填列)	-731,905,820.38	-546,475,483.62
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	227,432,824.38	169,892,713.86

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

## 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	240,192,195.04	19,097,019.87	259,289,214.91
本期利润	82,335.93	-5,647,949.30	-5,565,613.37
本期基金份额交易产生的变动数	-182,179,999.48	-11,430,549.22	-193,610,548.70
其中：基金申购款	323,091.04	20,880.57	343,971.61
基金赎回款	-182,503,090.52	-11,451,429.79	-193,954,520.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,094,531.49	2,018,521.35	60,113,052.84

## 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日

活期存款利息收入	158,469.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,773.70
其他	955.57
合计	173,198.35

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	172,507,910.28
减：卖出股票成本总额	181,150,233.90
买卖股票差价收入	-8,642,323.62

#### 6.4.3.13 债券投资收益

##### 6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	839,352,255.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	820,227,846.44
减：应收利息总额	16,912,760.54
买卖债券差价收入	2,211,648.55

##### 6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无。

##### 6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

##### 6.4.3.15 衍生工具收益

无。

##### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	49,062.82
基金投资产生的股利收益	-

合计	49,062.82
----	-----------

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,647,949.30
——股票投资	923,498.21
——债券投资	-6,571,447.51
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-5,647,949.30

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	127,992.94
转换费收入	286.63
合计	128,279.57

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	503,499.65
银行间市场交易费用	9,175.00
上清所市场交易费用	-
合计	512,674.65

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	34,809.32

信息披露费	149,178.12
其他	600.00
上清所债券托管帐户维护费	9,000.00
银行划款手续费	12,204.64
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	214,792.08

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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

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。

##### 6.4.5.2 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、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:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	0.00%	261,794,255.31	46.06%

#### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	27,404,313.90	100.00%

#### 6.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	185,000,000.00	100.00%

#### 6.4.6.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单位进行权证交易。

#### 6.4.6.1.5 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	-	0.00%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	238,338.52	46.77%	103,668.26	27.65%

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。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,202,664.82	18,263,498.53
其中：支付销售机构的客户维护费	173,780.61	1,076,076.88

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支，由基金管理人支付给担保人。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	533,777.49	3,043,916.40

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

##### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日 至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年6月30日
基金合同生效日（2012年6月15日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	78,988,151.66
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	26,754,892.40
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	105,743,044.06
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.30%

## 6.4.6.4.2 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之外的其他关联方无投资本基金的情况。

## 6.4.6.5 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6月30 日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	2,795,221.29	158,469.08	425,112,946.44	3,452,802.94

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。

## 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.7 利润分配情况

## 6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

#### 6.4.8 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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: 张)	期末成本总额	期末估值总额
127003	海印转债	2016/6/15	2016/7/1	新债未上市	100	100	1,590	159,000.00	159,000.00

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末，本基金未持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

##### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权

证的 10%。本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	10,098,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	50,055,000.00
合计	-	60,153,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为债券期限在一年以内的政策性金融债。

3. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	40,008,634.80	30,522,000.00
AAA 以下	76,195,752.52	448,206,500.00
未评级	30,168,463.20	-
合计	146,372,850.52	478,728,500.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金投资范围限于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、债券、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,795,221.29	-	-	-	2,795,221.29
结算备付金	2,422,311.95	-	-	-	2,422,311.95
存出保证金	64,659.43	-	-	-	64,659.43
交易性金融资产	29,949,000.00	102,843,615.72	13,580,234.80	11,715,912.08	158,088,762.60
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	60,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	5,549,893.63	5,549,893.63
应收利息	-	-	-	1,879,295.74	1,879,295.74
应收申购款	-	-	-	99.05	99.05
其他资产	-	-	-	380.00	380.00
资产总计	95,231,192.67	102,843,615.72	13,580,234.80	19,145,580.50	230,800,623.69

负债					
应付赎回款	-	-	-	34,461.70	34,461.70
应付管理人报酬	-	-	-	248,545.65	248,545.65
应付托管费	-	-	-	41,424.27	41,424.27
应付交易费用	-	-	-	98,171.37	98,171.37
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	184,001.20	184,001.20
负债总计	-	-	-	794,856.99	794,856.99
利率敏感度缺口	95,231,192.67	102,843,615.72	13,580,234.80	18,350,723.51	230,005,766.70
本期末 2015年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,899,599.48	-	-	-	4,899,599.48
结算备付金	12,341,046.58	-	-	-	12,341,046.58
存出保证金	246,872.68	-	-	-	246,872.68
交易性金融资产	80,733,000.00	314,266,500.00	143,882,000.00	34,380,052.04	573,261,552.04
买入返售金融资产	360,000,860.00	-	-	-	360,000,860.00
应收证券清算款	-	-	-	15,459,314.49	15,459,314.49
应收利息	-	-	-	11,670,984.34	11,670,984.34
应收申购款	-	-	-	70,523.32	70,523.32
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	458,221,378.74	314,266,500.00	143,882,000.00	61,580,874.19	977,950,752.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,482,021.61	1,482,021.61
应付管理人报酬	-	-	-	991,118.97	991,118.97
应付托管费	-	-	-	165,186.47	165,186.47
应付交易费用	-	-	-	269,785.12	269,785.12
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	170,246.25	170,246.25
负债总计	-	-	-	3,266,611.22	3,266,611.22
利率敏感度缺口	458,221,378.74	314,266,500.00	143,882,000.00	58,314,262.97	974,684,141.71

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。	
分	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

析		本期末 2016 年 6 月 30 日	本期末 2015 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基准点		-670,000.00
利率下降 25 个基准点		680,000.00	2,968,225.56

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为 0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为 60%—100%，其中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%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的 40%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	11,715,912.08	5.09	34,380,052.04	3.53
交易性金融资产—基金投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—债券投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	0.00	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	0.00	—	0.00
其他	—	0.00	—	0.00
合计	11,715,912.08	5.09	34,380,052.04	3.53

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资占基金资产净值比例仅为 5.09%（2015 年为 3.53%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

### § 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	11,715,912.08	5.08
	其中：股票	11,715,912.08	5.08
2	固定收益投资	146,372,850.52	63.42
	其中：债券	146,372,850.52	63.42
	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	60,000,380.00	26.00
	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	5,217,533.24	2.26
7	其他各项资产	7,493,947.85	3.25
8	合计	230,800,623.69	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	1,238,889.00	0.54
C	制造业	8,609,407.00	3.74
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	745,243.08	0.32

G	交通运输、仓储和邮政业	445,673.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	676,700.00	0.29
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	11,715,912.08	5.09

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600110	诺德股份	137,100	1,349,064.00	0.59
2	002155	湖南黄金	86,900	1,144,473.00	0.50
3	601799	星宇股份	18,200	833,924.00	0.36
4	300153	科泰电源	28,200	761,118.00	0.33
5	600386	北巴传媒	39,938	745,243.08	0.32
6	000338	潍柴动力	90,000	702,900.00	0.31
7	002440	闰土股份	47,200	700,920.00	0.30
8	601555	东吴证券	50,500	676,700.00	0.29
9	002196	方正电机	18,300	625,677.00	0.27
10	002045	国光电器	38,600	551,208.00	0.24
11	603788	宁波高发	11,700	550,251.00	0.24
12	300322	硕贝德	22,600	485,900.00	0.21
13	600436	片仔癀	10,100	454,601.00	0.20
14	002450	康得新	26,200	448,020.00	0.19

15	002245	澳洋顺昌	34,900	445,673.00	0.19
16	300014	亿纬锂能	9,800	423,262.00	0.18
17	300136	信维通信	17,600	368,896.00	0.16
18	600458	时代新材	22,700	353,666.00	0.15
19	600489	中金黄金	8,400	94,416.00	0.04

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	601198	东兴证券	6,053,535.78	0.62
2	002655	共达电声	4,396,763.00	0.45
3	300367	东方网力	3,679,618.00	0.38
4	000709	河钢股份	3,632,829.00	0.37
5	002452	长高集团	3,482,533.71	0.36
6	600123	兰花科创	3,379,440.00	0.35
7	600386	北巴传媒	3,302,031.00	0.34
8	000628	高新发展	3,255,554.48	0.33
9	002667	鞍重股份	3,244,356.98	0.33
10	002094	青岛金王	3,035,914.00	0.31
11	300230	永利股份	3,006,415.00	0.31
12	300113	顺网科技	2,582,511.59	0.26
13	002224	三力士	2,428,736.00	0.25
14	000563	陕国投 A	2,269,482.70	0.23
15	300064	豫金刚石	1,993,097.95	0.20
16	600295	鄂尔多斯	1,981,483.62	0.20
17	600783	鲁信创投	1,939,473.00	0.20
18	000776	广发证券	1,932,319.00	0.20
19	601699	潞安环能	1,931,353.34	0.20
20	002235	安妮股份	1,928,840.00	0.20

注：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。

##### 7.4.2 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	601198	东兴证券	6,098,081.42	0.63
2	300367	东方网力	5,705,728.04	0.59
3	000901	航天科技	4,759,000.00	0.49
4	002094	青岛金王	4,203,477.00	0.43
5	002655	共达电声	3,867,004.97	0.40
6	300065	海兰信	3,781,917.00	0.39
7	300064	豫金刚石	3,480,402.58	0.36
8	002667	鞍重股份	3,460,785.40	0.36
9	000709	河钢股份	3,419,420.00	0.35
10	002452	长高集团	3,285,515.18	0.34
11	600279	重庆港九	3,267,379.80	0.34
12	000628	高新发展	3,214,248.88	0.33
13	600386	北巴传媒	2,884,750.98	0.30
14	300230	永利股份	2,799,912.00	0.29
15	600123	兰花科创	2,755,418.00	0.28
16	300113	顺网科技	2,594,188.84	0.27
17	600735	新华锦	2,273,374.00	0.23
18	600019	宝钢股份	2,261,460.00	0.23
19	000563	陕国投A	1,998,084.00	0.20
20	002224	三力士	1,970,782.00	0.20

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。

#### 7.4.3 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	157,562,595.73
卖出股票收入（成交）总额	172,507,910.28

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	29,949,000.00	13.02
	其中：政策性金融债	29,949,000.00	13.02
4	企业债券	99,876,400.00	43.42
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	9,981,000.00	4.34
7	可转债（可交换债）	6,566,450.52	2.85

8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	146,372,850.52	63.64

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160209	16 国开 09	300,000	29,949,000.00	13.02
2	1080111	10 渝江北嘴债	150,000	15,390,000.00	6.69
3	1480233	14 昌平债	100,000	10,856,000.00	4.72
4	1480459	14 石景山债	100,000	10,765,000.00	4.68
5	1480385	14 德州城投债	100,000	10,749,000.00	4.67

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	64,659.43
2	应收证券清算款	5,549,893.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,879,295.74
5	应收申购款	99.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,493,947.85

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	3,372,752.52	1.47

### 7.12.5 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不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
1,443	157,611.10	161,605,727.10	71.06%	65,827,097.28	28.94%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 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	29,100.03	0.0128%

### 8.3 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年6月15日）基金份额总额	1,071,726,792.02
本报告期期初基金份额总额	958,035,336.39
本报告期基金总申购份额	1,303,308.37
减：本报告期基金总赎回份额	731,905,820.38
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	227,432,824.38

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

1、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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 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。

### 10.5 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），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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
申银万国	1	233,411,740.61	70.79%	212,712.95	70.66%	-
银河证券	1	96,311,015.23	29.21%	88,304.89	29.34%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	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%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	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%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	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%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、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。

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：恒泰证券、方正证券、平安证券。退出交易单元：无。

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	17,156,533.50	33.10%	20,000,000.00	1.50%	-	0.00%
银河证券	8,018,609.88	15.47%	1,314,000,000.00	98.50%	-	0.00%
长江证券	26,652,336.21	51.43%	-	0.00%	-	0.00%

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月6日
2	大成景恒保本混合型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月20日
3	大成景恒保本混合型证券投资基金（第二个保本周期）更新招募说明书（2015年2期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月29日
4	大成景恒保本混合型证券投资基金（第二个保本周期）更新招募说明书（2015年2期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月29日
5	大成景恒保本混合型证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月26日
6	大成景恒保本混合型证券投资基金	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月26日

	2015 年年度报告	网站	
7	大成景恒保本混合型证券投资基金 变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 3 月 29 日
8	大成景恒保本混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 4 月 22 日
9	大成基金管理有限公司关于因指数 熔断调整公司旗下部分公募基金开 放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 1 月 5 日
10	关于旗下场内基金在指数熔断期间 暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 1 月 6 日
11	大成基金管理有限公司关于因指数 熔断调整公司旗下部分公募基金开 放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 1 月 8 日
12	大成基金管理有限公司关于养老金 账户通过直销中心申购旗下部分基 金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 1 月 18 日
13	大成基金管理有限公司关于降低旗 下部分开放式基金申购、赎回、转 换转出及最低持有份额数额限制的 公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 1 月 30 日
14	大成基金管理有限公司关于增加上 海凯石财富基金销售有限公司代销 公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 2 月 18 日
15	大成基金关于旗下部分基金增加深 圳前海微众银行股份有限公司为代 销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 2 月 27 日
16	大成基金管理有限公司关于增加北 京葱次方资产管理有限公司为开放 式基金代销机构及相关费率优惠的	中国证监会指定报刊及本公司 网站	2016 年 3 月 1 日

	公告		
17	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月12日
18	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月17日
19	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月18日
20	大成基金管理有限公司关于增加万和证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月26日
21	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月29日
22	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年4月18日
23	大成基金管理来有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年4月27日
24	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年4月30日
25	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月5日
26	大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月5日

	的公告		
27	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 7 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 10 日
29	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 17 日
30	大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 22 日
31	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成景恒保本混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司  
2016年8月25日