

大成景辉灵活配置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：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京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>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<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>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
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	大成景辉灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	大成景辉灵活配置混合	
基金主代码	001582	
交易代码	001582	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 30 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	503,914,900.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成景辉灵活配置混合 A	大成景辉灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	001582	002290
报告期末下属分级基金的份额总额	503,914,900.02 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。
业绩比较基准	三年期定存款税后利率 +2%
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基金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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	刘晔
	联系电话	0755-83183388	010-66223586
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4008885558	95526
传真		0755-83199588	010-66225309
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	518040	100033
法定代表人	刘卓	闫冰竹

#### 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	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区金融大街甲 17 号北京银行股份有限公司

#### 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

### § 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

基金级别	大成景辉灵活配置混合 A	大成景辉灵活配置混合 C
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)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-9,373.78	-
本期利润	1,205,962.91	-
加权平均基金份额本期利润	0.0039	-
本期加权平均净值利润率	0.39%	-
本期基金份额净值增长率	2.09%	-
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	10,529,347.75	-
期末可供分配基金份额利润	0.0209	-
期末基金资产净值	516,516,421.94	-
期末基金份额净值	1.025	-
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	2.50%	0.00%

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、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认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、根据我司 2015 年 12 月 17 日《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并相应修订基金合同的公告》，自 2015 年 12 月 17 日起，大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加收取销售服务费的 C 类份额。截止本报告期末，景辉 C 类份额未发生申购业务，本报告期无景辉 C 类份额的相关财务指标及净值表现的数据。

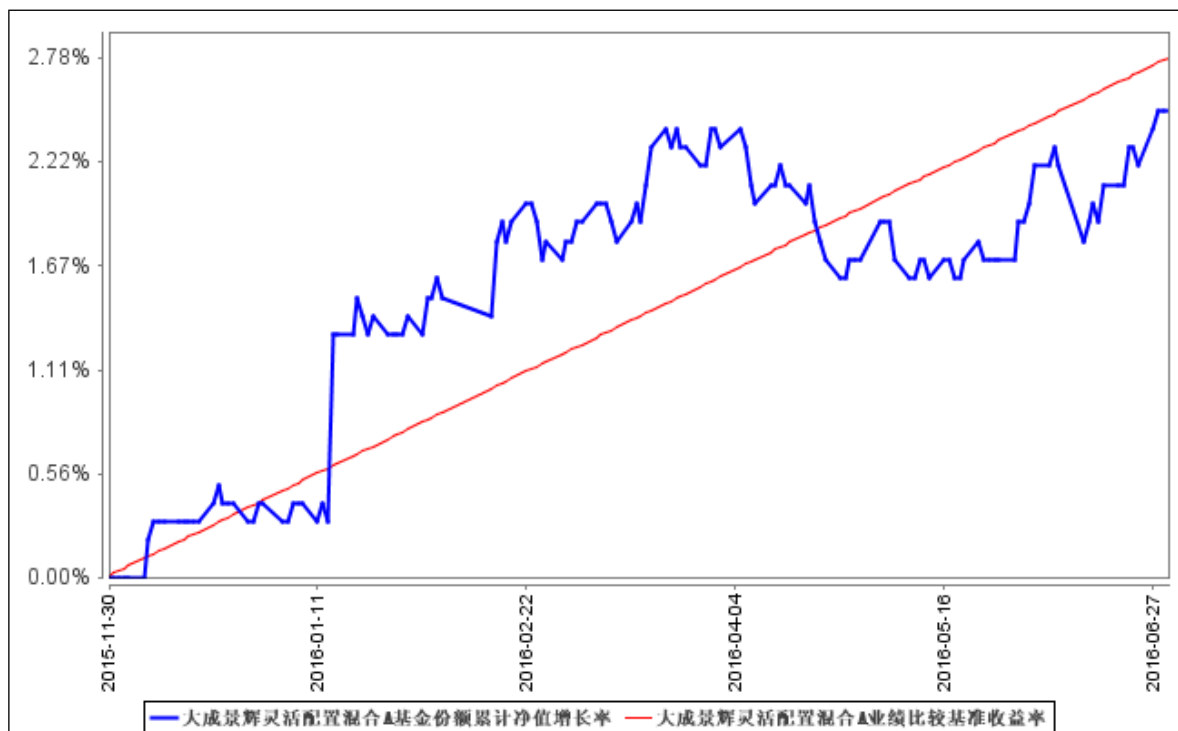
### 3.2 基金净值表现

#### 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

大成景辉灵活配置混合 A

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	0.59%	0.14%	0.38%	0.01%	0.21%	0.13%
过去三个月	0.10%	0.11%	1.16%	0.01%	-1.06%	0.10%
过去六个月	2.09%	0.14%	2.35%	0.02%	-0.26%	0.12%
自基金合同生效起至今	2.50%	0.13%	2.78%	0.01%	-0.28%	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 2015 年 11 月 30 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，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 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		
黄万青女士	本基金基金经理	2015-11-30	-	20 年	经济学硕士。1999 年 5 月加入大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员，固定收益部高级研究员。2010 年 4 月 7 日至 2013 年 3 月 7 日任景宏证券投资基金基金经理。2011 年 7 月 13 日至 2013 年 3 月 7 日任大成行·业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011 年 3 月 8 日至 2011 年 6 月 5 日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。2011 年 3 月 8 日至 2011 年 6 月 5 日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 28 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 11 月 30 日起任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 5 月 25 日起任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 6 日起任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
孙丹	本基金基金经理助理	2016-5-5	-	8 年	2008 年-2012 年就职于景顺长城产品开发部任产品经理；2012 年-2014 年就职于华夏基金机构债券投资部任研究员；2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，历任固定收益部信用策略、宏观利率研究员，现任基金经理助理。2016 年 5 月 5 日起任大成景辉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基金经理助理。2016 年 6 月 22 日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。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合规守信情况的说明

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》、《大成景辉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，大成景辉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

2016 年上半年上证指数下跌 17.22%，中小板综指下跌 14.22%，创业板综指下跌 17.92%。2016 年上半年股票市场经过 1 月份的暴跌，后面几个月基本是围绕 2800 点-3000 点区间作窄幅震荡，基本都是存量资金的博弈，所以指数涨不高，但主题表现非常活跃。债券市场方面，由于资金面整体宽松，年初至 3 月底，债券收益率一直下行，但 4 月份由于信用违约事件的爆发，债券收益率上行一段时间，但目前整体已经回到 3 月份的水平。

由于年初对股票市场相对谨慎，所以权益仓位控制在相对较低的水平，但 3 月底因为申购，

刚把权益仓位加到年初的水平，债券组合也有一定的杠杆，就遇上股票市场和债券市场大跌，净值造成一定的回撤。5 月底，我们判断股票市场反弹，在仓位基本不变的情况下，我们对组合进行了调整，加大食品饮料和中药等低估值的配置，获得了较好的回报，净值开始回升。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，景辉 A 基金份额资产净值为 1.025 元，本报告期景辉 A 基金份额净值增长率为 2.09%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%，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，我们认为股票市场依然没有趋势性的投资机会，但 7、8 月份是较好的反弹窗口，我们会积极把握这次的机会，重点配置低估值且增长确定的消费类行业和个股，做好波段操作。债券市场方面，由于资金面继续宽松，经济基本面不会出现恶化，信用违约事件暂告一段落，所以我们在债券配置上继续以利率债和资质较好的信用债为主。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

#### 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/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

本基金在本报告期内，曾于 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

### § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管大成景辉灵活配置混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：大成景辉灵活配置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	6.4.7.1	5,706,544.30	19,737,695.54
结算备付金		260,324.44	-
存出保证金		117,356.17	-
交易性金融资产	6.4.7.2	462,473,955.60	454,730.00
其中：股票投资		24,983,955.60	356,730.00
基金投资		-	-
债券投资		437,490,000.00	98,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	42,500,000.00	140,000,000.00
应收证券清算款		1,846,603.97	5,027,791.67
应收利息	6.4.7.5	4,924,045.28	5,700.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		517,828,829.76	165,225,917.87
<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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		472,993.15	-
应付赎回款		101,210.95	235,962.91
应付管理人报酬		283,263.83	144,274.98
应付托管费		47,210.65	24,045.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	226,214.64	10,708.64
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	181,514.60	5,120.42
负债合计		1,312,407.82	420,112.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	503,914,900.02	164,228,357.47
未分配利润	6.4.7.10	12,601,521.92	577,447.61
所有者权益合计		516,516,421.94	164,805,805.08
负债和所有者权益总计		517,828,829.76	165,225,917.87

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.025 元，基金份额总额 503,914,900.02 份。

2、本基金合同生效日为 2015 年 11 月 30 日，本报告期无上年度同期可比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景辉灵活配置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
<b>一、收入</b>		3,601,598.47
1. 利息收入		4,006,551.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	147,746.46
债券利息收入		3,042,323.92
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		816,480.69
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,146,908.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,505,224.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	209,060.33
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	149,255.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,215,336.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	526,619.59
<b>减：二、费用</b>		2,395,635.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,276,452.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	212,742.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	431,114.66

5. 利息支出		243,554.87
其中：卖出回购金融资产支出		243,554.87
6. 其他费用	6.4.7.20	231,771.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,205,962.91</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,205,962.91</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景辉灵活配置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）	164,228,357.47	577,447.61	164,805,805.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,205,962.91	1,205,962.91
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）	339,686,542.55	10,818,111.40	350,504,653.95
其中：1. 基金申购款	489,146,741.08	11,733,965.17	500,880,706.25
2. 基金赎回款	-149,460,198.53	-915,853.77	-150,376,052.30
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）	503,914,900.02	12,601,521.92	516,516,421.94

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
周立新

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
范瑛

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成景辉灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]第 1309 号《关于准予大成景辉灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 236,987,119.77 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1034 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 237,037,779.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 50,659.71 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,基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并相应修订基金合同的公告》,经本基金管理人大成基金与本基金托管行北京银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案后,决定自 2015 年 12 月 17 起,对本基金增加收取销售服务费的 C 类份额并对本基金的基金合同作出相应修改。本基金增加 C 类份额后,将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值,投资者申购时可以自主选择与 A 类份额或 C 类份额相对应的基金代码进行申购。原有的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类份额后,全部自动转换为大成景辉灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(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,可交换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等、货币市场工具)、国债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(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%—95%;债券、货币市场工具、现金以及银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 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,应当保持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%;权证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。

本基金投资业绩比较基准为：三年期定期存款税后利率+2%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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其估值日的市场交易价格确定公允价值；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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期

权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

同类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支

持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于封闭式基金]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于开放式基金]、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补充政策的通知》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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	5,706,544.30
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,706,544.30

##### 6.4.7.2 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	23,171,909.73	24,983,955.60	1,812,045.87
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	399,000.00	399,000.00
	银行间市场	437,681,853.38	437,091,000.00
	合计	438,080,853.38	437,490,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	461,252,763.11	462,473,955.60	1,221,192.49

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 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
交易所买入返售证券	42,500,000.00	-
合计	42,500,000.00	-

## 6.4.7.5 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	1,032.44
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	117.20
应收债券利息	4,030,077.16
应收买入返售证券利息	225,657.66
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	667,160.82
合计	4,924,045.28

## 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.7 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	218,265.41
银行间市场应付交易费用	7,949.23
合计	226,214.64

## 6.4.7.8 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	75.98
预提费用	181,438.62
合计	181,514.60

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景辉灵活配置混合 A		
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	164,228,357.47	164,228,357.47
本期申购	489,146,741.08	489,146,741.08
本期赎回(以“-”号填列)	-149,460,198.53	-149,460,198.53
本期末	503,914,900.02	503,914,900.02

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、根据我司 2015 年 12 月 17 日《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并相应修订基金合同的公告》，自 2015 年 12 月 17 日起，大成景辉灵活配置混合型证券投资基金增加收取销售服务费的 C 类份额。截止本报告期末，景辉 C 类份额未发生申赎业务。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成景辉灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	573,112.75	4,334.86	577,447.61
本期利润	-9,373.78	1,215,336.69	1,205,962.91
本期基金份额交易产生的变动数	9,965,608.78	852,502.62	10,818,111.40
其中：基金申购款	10,915,076.66	818,888.51	11,733,965.17
基金赎回款	-949,467.88	33,614.11	-915,853.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,529,347.75	2,072,174.17	12,601,521.92

#### 6.4.7.11 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
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	28,176.71

其他	382.79
合计	147,746.46

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	134,096,437.87
减：卖出股票成本总额	136,601,662.08
买卖股票差价收入	-2,505,224.21

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	209,060.33
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	209,060.33

##### 6.4.7.13.2 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	71,590,780.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	71,020,043.56
减：应收利息总额	361,676.73
买卖债券差价收入	209,060.33

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.16 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	149,255.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	149,255.00

## 6.4.7.17 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	1,215,336.69
——股票投资	1,806,190.07
——债券投资	-590,853.38
——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	1,215,336.69

## 6.4.7.18 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	526,619.59
合计	526,619.59

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

## 6.4.7.19 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	427,202.16
银行间市场交易费用	3,912.50

合计	431,114.66
----	------------

#### 6.4.7.20 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	27,436.50
信息披露费	149,178.12
持有人大会费用	43,000.00
银行划款手续费	7,257.27
中债登债券托管帐户维护费	4,500.00
其他	400.00
合计	231,771.89

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司(“北京银行”)	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,276,452.13
其中：支付销售机构的客户维护费	17,284.78

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 0.90% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.90\% \div \text{当年天数}。$$

根据大成基金管理有限公司 2016 年 6 月 8 日的公告《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2016 年 6 月 7 日起，本基金的管理费率调整为 0.60%。

###### 6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	212,742.01

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

根据大成基金管理有限公司 2016 年 6 月 8 日的公告《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2016 年 6 月 7 日起，本基金的托管费率调整为 0.10%。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 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。

**6.4.10.4.2 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以外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 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	
	期末余额	当期利息收入
北京银行	5,706,544.30	119,186.96

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内无利润分配。

**6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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
601966	玲珑轮胎	2016-6-24	2016-7-6	未上市	12.98	12.98	4,328	56,177.44	56,177.44	-
603016	新宏泰	2016-6-23	2016-7-1	未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-6-30	2016-7-8	未上市	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-

002805	丰元股份	2016-6-29	2016-7-7	未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
--------	------	-----------	----------	-----	------	------	-----	----------	----------	---

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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	备注
127003	海印转债	2016-6-8	2016-7-1	未上市	100.00	100.00	3,990	399,000.00	399,000.00	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有因重大事项而停牌的流通受限股票。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。

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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行北京银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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	140,352,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	222,610,000.00	-
合计	362,962,000.00	-

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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	-	-
AAA 以下	44,300,000.00	98,000.00
未评级	30,228,000.00	-
合计	74,528,000.00	98,000.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合



理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于报告期末，本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 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	5,706,544.30	-	-	-	5,706,544.30
结算备付金	260,324.44	-	-	-	260,324.44
存出保证金	117,356.17	-	-	-	117,356.17
交易性金融资产	363,361,000.00	74,129,000.00	-	24,983,955.60	462,473,955.60
买入返售金融资产	42,500,000.00	-	-	-	42,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,846,603.97	1,846,603.97
应收利息	-	-	-	4,924,045.28	4,924,045.28
资产总计	411,945,224.91	74,129,000.00	-	31,754,604.85	517,828,829.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	472,993.15	472,993.15
应付赎回款	-	-	-	101,210.95	101,210.95
应付管理人报酬	-	-	-	283,263.83	283,263.83
应付托管费	-	-	-	47,210.65	47,210.65
应付交易费用	-	-	-	226,214.64	226,214.64
其他负债	-	-	-	181,514.60	181,514.60
负债总计	-	-	-	1,312,407.82	1,312,407.82
利率敏感度缺口	411,945,224.91	74,129,000.00	-	30,442,197.03	516,516,421.94
上年度末 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	19,737,695.54	-	-	-	19,737,695.54
交易性金融资产	98,000.00	-	-	356,730.00	454,730.00
买入返售金融资产	140,000,000.00	-	-	-	140,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	5,027,791.67	5,027,791.67
应收利息	-	-	-	5,700.66	5,700.66
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	159,835,695.54	-	-	5,390,222.33	165,225,917.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	235,962.91	235,962.91
应付管理人报酬	-	-	-	144,274.98	144,274.98
应付托管费	-	-	-	24,045.84	24,045.84
应付交易费用	-	-	-	10,708.64	10,708.64
其他负债	-	-	-	5,120.42	5,120.42
负债总计	-	-	-	420,112.79	420,112.79
利率敏感度缺口	159,835,695.54	-	-	4,970,109.54	164,805,805.08

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。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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）	
		本期末 （2016年6月30日）	上年度末 （2015年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,000,000.00	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-990,000.00	-

## 6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资范围为股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；债券、货币市场工具、现金以及银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 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，应当保持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%；权证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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 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	24,983,955.60	4.84	356,730.00	0.22
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	24,983,955.60	4.84	356,730.00	0.22

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.84%(2015 年 12 月 31 日：0.22%)，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(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 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	24,983,955.60	4.82
	其中：股票	24,983,955.60	4.82
2	固定收益投资	437,490,000.00	84.49
	其中：债券	437,490,000.00	84.49
	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	42,500,000.00	8.21
	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	5,966,868.74	1.15
7	其他各项资产	6,888,005.42	1.33
8	合计	517,828,829.76	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	-	0.00
C	制造业	20,981,145.14	4.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	282,691.96	0.05
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	3,699,992.40	0.72
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	20,126.10	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	24,983,955.60	4.84

### 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	000538	云南白药	60,000	3,858,000.00	0.75
2	600085	同仁堂	100,000	2,979,000.00	0.58
3	600519	贵州茅台	10,000	2,919,200.00	0.57
4	000423	东阿阿胶	50,000	2,641,500.00	0.51
5	600332	白云山	100,000	2,464,000.00	0.48

6	000568	泸州老窖	80,000	2,376,000.00	0.46
7	600718	东软集团	100,000	1,832,000.00	0.35
8	600446	金证股份	50,000	1,797,500.00	0.35
9	000858	五粮液	50,000	1,626,500.00	0.31
10	002304	洋河股份	20,095	1,445,232.40	0.28
11	601611	中国核建	13,513	282,691.96	0.05
12	601127	小康股份	7,694	183,655.78	0.04
13	600887	伊利股份	9,981	166,383.27	0.03
14	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
15	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
16	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
17	601966	玲珑轮胎	4,328	56,177.44	0.01
18	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
19	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
20	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
21	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
22	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
23	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
24	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

#### 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	600570	恒生电子	8,705,699.00	5.28
2	600085	同仁堂	8,464,911.66	5.14
3	002292	奥飞娱乐	7,926,913.50	4.81
4	600332	白云山	7,101,927.61	4.31
5	000423	东阿阿胶	6,538,864.42	3.97
6	000538	云南白药	5,181,211.77	3.14
7	600519	贵州茅台	4,899,189.97	2.97
8	601688	华泰证券	4,620,510.00	2.80
9	300059	东方财富	4,495,307.20	2.73
10	300085	银之杰	4,435,633.75	2.69
11	002657	中科金财	4,136,940.66	2.51
12	300113	顺网科技	4,125,971.70	2.50

13	000686	东北证券	3,733,353.08	2.27
14	002673	西部证券	3,676,004.00	2.23
15	000568	泸州老窖	3,426,742.97	2.08
16	600718	东软集团	2,851,661.00	1.73
17	000858	五粮液	2,425,335.00	1.47
18	000526	紫光学大	2,298,716.82	1.39
19	002668	奥马电器	2,284,696.00	1.39
20	300251	光线传媒	2,272,507.41	1.38

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	600570	恒生电子	8,805,577.80	5.34
2	002292	奥飞娱乐	7,218,315.81	4.38
3	600085	同仁堂	5,236,991.90	3.18
4	600332	白云山	4,705,063.33	2.85
5	601688	华泰证券	4,612,833.85	2.80
6	300085	银之杰	4,264,725.00	2.59
7	000423	东阿阿胶	4,212,655.74	2.56
8	300059	东方财富	4,198,957.00	2.55
9	002657	中科金财	4,064,924.32	2.47
10	000686	东北证券	3,867,277.00	2.35
11	300113	顺网科技	3,861,255.00	2.34
12	002673	西部证券	3,398,840.50	2.06
13	600519	贵州茅台	2,422,238.40	1.47
14	000526	紫光学大	2,243,868.30	1.36
15	600074	保千里	2,190,670.62	1.33
16	002008	大族激光	2,171,839.00	1.32
17	601601	中国太保	2,136,000.00	1.30
18	002668	奥马电器	2,092,513.98	1.27
19	600109	国金证券	2,052,628.67	1.25
20	601555	东吴证券	2,046,894.77	1.24

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	159,422,697.61
卖出股票收入（成交）总额	134,096,437.87

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	60,177,000.00	11.65
	其中：政策性金融债	60,177,000.00	11.65
4	企业债券	43,901,000.00	8.50
5	企业短期融资券	235,253,000.00	45.55
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	399,000.00	0.08
8	同业存单	97,760,000.00	18.93
9	其他	-	0.00
10	合计	437,490,000.00	84.70

### 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	111616065	16 上海银行 CD065	500,000	49,265,000.00	9.54
2	111619058	16 恒丰银行 CD058	500,000	48,495,000.00	9.39
3	160416	16 农发 16	300,000	30,228,000.00	5.85
4	160209	16 国开 09	300,000	29,949,000.00	5.80
5	1280488	12 淮城资债	300,000	25,641,000.00	4.96

### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

## 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

基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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 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。

### 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	117,356.17
2	应收证券清算款	1,846,603.97
3	应收股利	-
4	应收利息	4,924,045.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,888,005.42

**7.12.4 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。

**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的股票。

**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

份额级别	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
大成景辉灵活配置混合 A	319	1,579,670.53	489,270,822.45	97.09%	14,644,077.57	2.91%
大成景辉灵活配置混合 C	-	-	-	-	-	-
合计	319	1,579,670.53	489,270,822.45	97.09%	14,644,077.57	2.91%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、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	份额级别	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	大成景辉灵活配置混合 A	-	0.0000%
	大成景辉灵活配置混合 C	-	0.0000%
	合计	-	0.0000%

**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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研部门负 责人持有本开放式基金	大成景辉灵活配置混合 A	0
	大成景辉灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	大成景辉灵活配置混合 A	0
	大成景辉灵活配置混合 C	0

	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景辉灵活配置混合 A	大成景辉灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 11 月 30 日）基金份额总额	237,037,779.48	-
本报告期期初基金份额总额	164,228,357.47	-
本报告期基金总申购份额	489,146,741.08	-
减：本报告期基金总赎回份额	149,460,198.53	-
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	503,914,900.02	-

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会表决投票时间为 2016 年 5 月 4 日起至 2016 年 6 月 6 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会于 2016 年 6 月 7 日表决通过了《关于大成景辉灵活配置混合型证券投资基金调整基金管理费率及基金托管费率相关事项的议案》，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本次大会决议自该日起生效。基金管理人已自该日起五日内将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

### 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

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普华永道中天会计师事务所(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	
国信证券	1	146,772,202.38	50.09%	133,752.52	50.09%	-
招商证券	1	146,234,829.90	49.91%	133,267.32	49.91%	-

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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的未发生变更情况。

## 10.7.2 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
国信证券	9,146,459.67	83.22%	1,205,000,000.00	100.00%	-	0.00%
招商证券	1,844,857.23	16.78%	-	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	大成景辉灵活配置混合型证券投资基金暂停申购及转换转入业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月24日
2	大成景辉灵活配置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
3	大成基金管理有限公司关于召开大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月4日
4	大成基金管理有限公司关于召开大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月5日
5	大成基金管理有限公司关于召开大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月6日
6	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5月11日
7	大成基金管理有限公司关于大成景辉灵活配置混合型基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年6月8日
8	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
9	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
10	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
11	大成基金管理有限公司关于养老金	中国证监会指定报刊	2016年1月18日

	账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	及本公司网站	
12	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
13	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
14	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
15	大成基金管理有限公司关于增加北京蕙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公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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		
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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 年第一次临时股东大会的有关决议，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辉灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景辉灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

- 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

备查文件存放于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