

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金  
2016 年年度报告摘要  
2016 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成景穗灵活配置混合	
基金主代码	001263	
交易代码	001263	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 4 日	
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	
报告期末基金份额总额	723,163,819.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成景穗灵活配置混合 A	大成景穗灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	001263	002372
报告期末下属分级基金的份额总额	675,452,020.24 份	47,711,798.84 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	三年期定期存款税后利率+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，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年 5 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
	大成景穗灵活配置混合 A	大成景穗灵活配置混合 C	大成景穗灵活配置混合
本期已实现收益	4,021,399.82	242,348.46	139,747,881.75
本期利润	-10,903,149.86	-1,842,817.02	141,618,588.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0266	-0.0203	0.0279
本期基金份额净值增长率	-0.68%	-1.55%	2.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0193	0.0180	0.0120
期末基金资产净值	688,500,852.47	48,569,182.98	539,533,791.23
期末基金份额净值	1.019	1.018	1.026

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。

3、根据我司 2016 年 1 月 13 日《关于大成景穗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 2016 年 1 月 14 日起，大成景穗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，大成景穗灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额 675,452,020.24 份，C 类份额为 47,711,798.84 份。

## 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

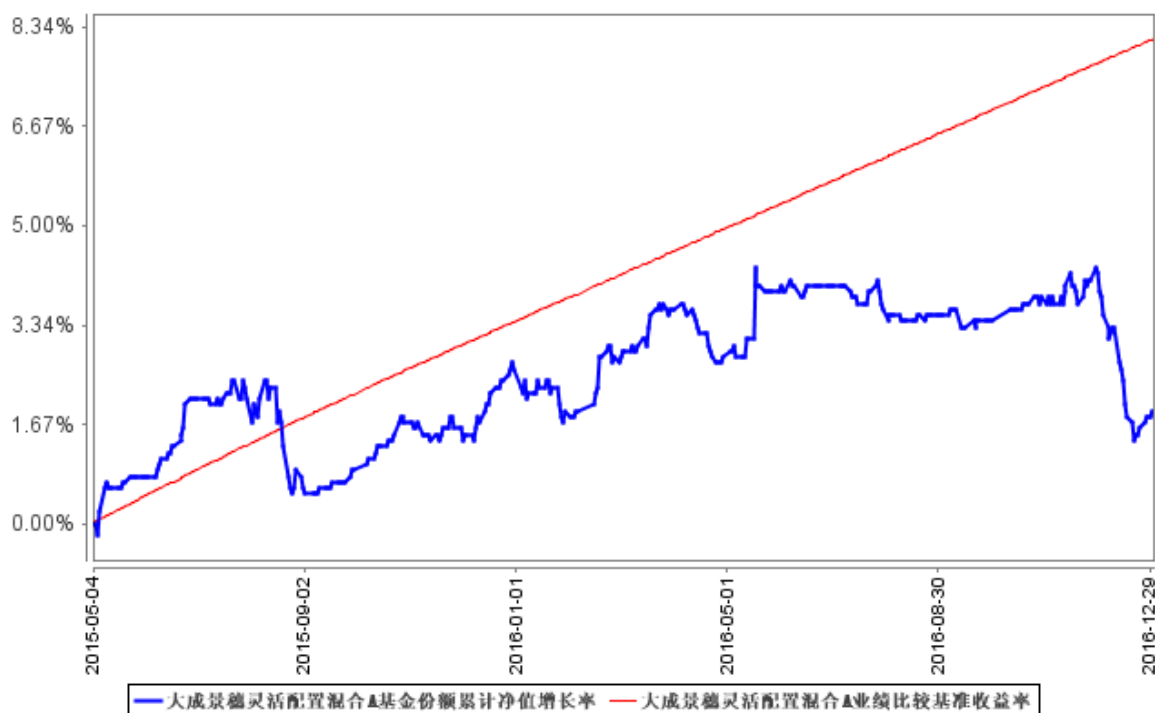
大成景穗灵活配置混合 A

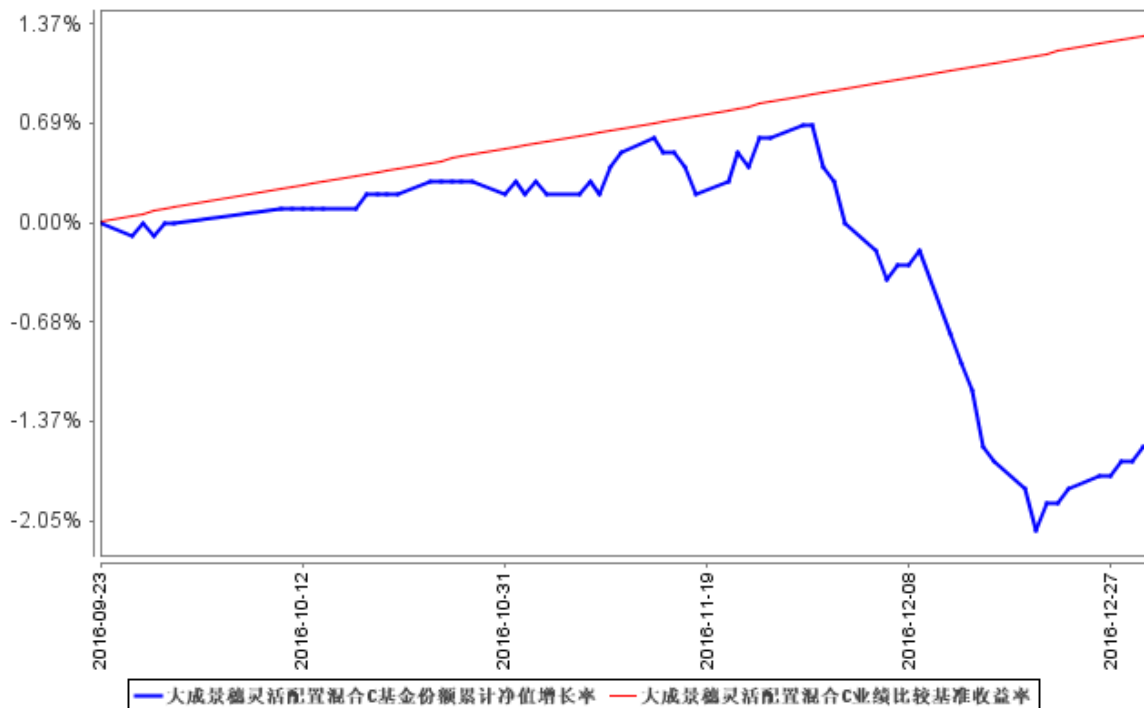
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.45%	0.15%	1.12%	0.02%	-2.57%	0.13%
过去六个月	-2.02%	0.12%	2.26%	0.01%	-4.28%	0.11%
过去一年	-0.68%	0.14%	4.59%	0.01%	-5.27%	0.13%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.14%	8.14%	0.01%	-6.24%	0.13%

大成景穗灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.55%	0.15%	1.19%	0.02%	-2.74%	0.13%
自基金合同生效起至今	-1.55%	0.14%	1.30%	0.02%	-2.85%	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

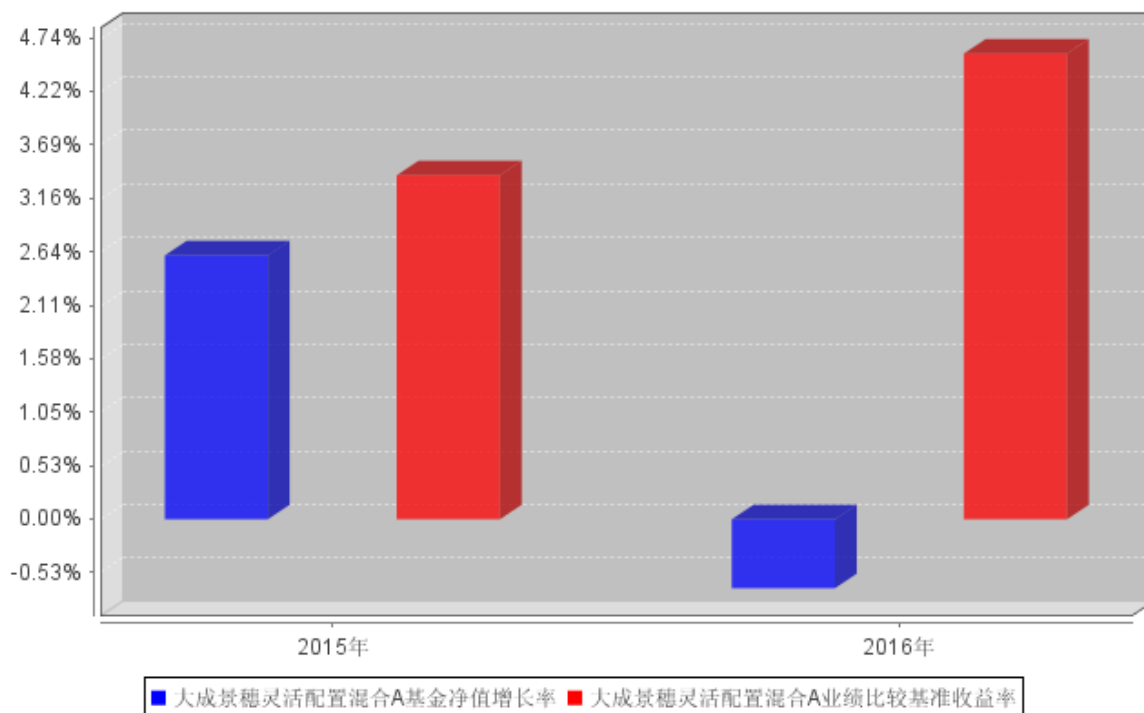


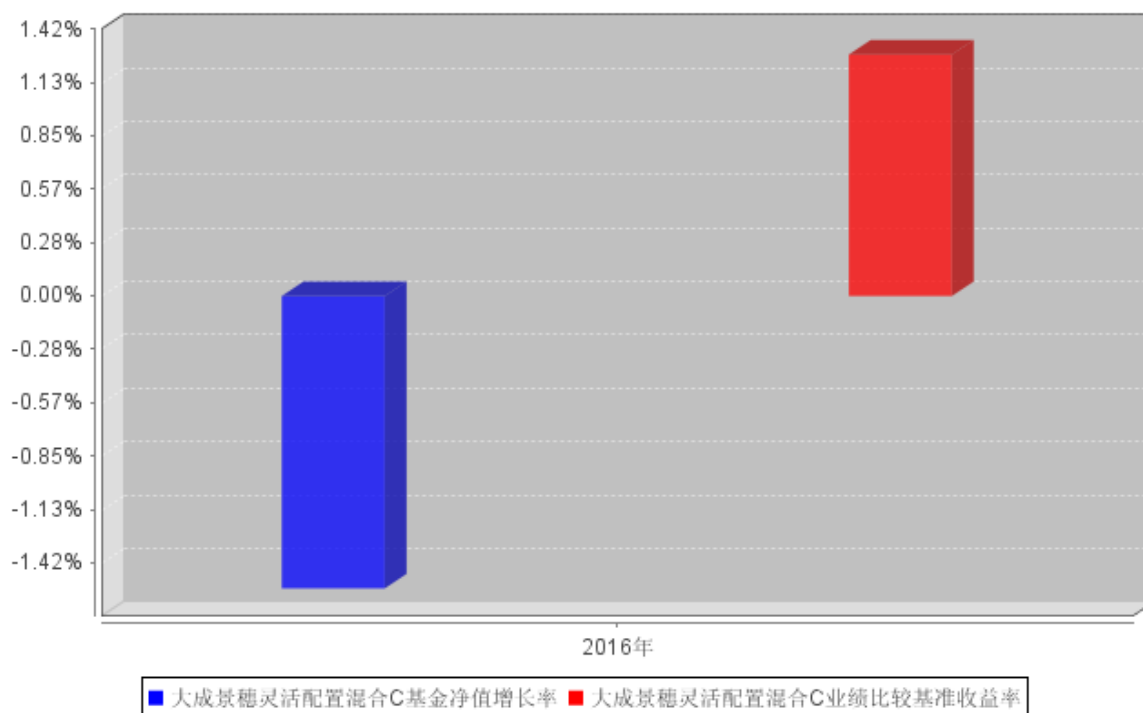


注：1、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、根据本基金合同，本基金分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，截止本报告期末，A 类份额为 675,452,020.24 份，C 类份额为 47,711,798.84 份。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2015 年 5 月 4 日（基金合同生效日）以来未有利润分配事项。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金，4 只 QDII 基金及 68 只开放式证券投资基金。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈会荣先生	本基金基金经理	2016年8月6日	-	10年	中央财经大学经济学学士。2007年10月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部基金经理。自2016年8月6日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理，自2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。自2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理，自2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。自2017年3月22日起任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债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
黄万青女士	本基金基金经理	2016年9月20日	-	21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，



				<p>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日至2017年3月18日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。2016年9月20日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月29日起任大成景禄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。2017年1月25日起担任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自2017年3月</p>
--	--	--	--	---

					18 日起担任大成景鹏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
黄海峰先生	本基金基金经理	2015 年 5 月 4 日	2016 年 8 月 31 日	13 年	经济学学士，2013 年 7 月加入大成基金。2013 年 10 月 14 日至 2016 年 8 月 31 日任大成现金宝货币基金经理助理。2013 年 10 月 28 日至 2016 年 8 月 31 日大成景恒保本混合基金经理助理。2014 年 3 月 18 日至 2016 年 8 月 31 日任大成强化收益定期开放债券基金经理助理。2014 年 3 月 18 日至 2014 年 12 月 23 日任大成货币基金经理助理。2014 年 6 月 23 日至 2014 年 12 月 23 日任大成丰财宝货币基金经理助理。2014 年 6 月 26 日至 2016 年 8 月 31 日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 日至 2016 年 8 月 31 日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 日至 2016 年 8 月 31 日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 日至 2016 年 8 月 31 日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 日至 2016 年 8 月 31 日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 日至 2016 年 8 月 31 日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 日至 2016 年 8 月 31 日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》、《大成景穗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，大成景穗灵活配置混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽

核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年股票市场震荡下行，上证指数下跌 12.31%，中小板综指下跌 14.89%，创业板综指下跌 20.35%，市场风格表现为大盘更强。2016 年 1 月份，市场在融断机制推出时出现快速下跌，后来市场跟随经济的小复苏而逐步回暖，12 月份，在资金面趋紧、保险资金加强监管以及美国加息等不利因素冲击下，A 股出现了快速的下跌，全年 A 股市场整体是存量资金的博弈，结构性行情表现更为突出。12 月份，本基金由于权益整体仓位较高，行业和个股并非全偏防御，所以在 12 月份的下落出现较大的回撤，未能达到追求绝对收益的投资目标。

债券市场方面，货币政策从 2014 年开始放松，名义利率和实际利率都大幅下行。财政政策在 2015 年 5 月转向积极，标志性的事件是地方债务置换的开启。地方债开始发行后，M2 增速和广义社融增速在 15 年下半年开始企稳。2016 年产出缺口明显收窄，广义价格上涨，名义 GDP 从 2015 年四季度的 6.4% 升至 2016 年四季度的 9.6%。前三季度，债市震荡为主。第四季度债券市场波动加大，债券收益率在最后两个月大幅上行，尤其是在 2016 年 11 月底开始，受央行去杠杆操作、

全球再通胀与美债收益率快速上行、人民币贬值、债券代持风波等因素的叠加影响，债券市场开始出现杀跌，10 年期国债一度跌至 3.40% 的收益率水平，最后，在监管机构对流动性和代持风波的干预下，债券市场在 12 月底出现一定反弹。全年来看，中债综合指数上涨 1.8%，中债企业债总指数涨 2.45%。本基金由于在 11 月底时债券整体久期相对较长，所以在下跌时受到的冲击要大一些。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 类净值增长率为-0.68%，C 类净值增长率为-1.55%，期间业绩比较基准收益率为 4.59%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们认为经济增长较为平稳，物价水平也会保持小幅的回升，政策面总体维持稳定，2017 年年初的资金面也会相对宽松，2016 年 12 月份召开的中央经济工作会议的改革内容也开始进入落实初期，市场对此将充满期待，2017 年第 1 季度市场的反弹有望延续。在经济复苏没有证伪之前，我们更看好业绩增长确定的大消费、受益通胀的行业以及国企改革预期较强的行业个股。

债券市场方面，考虑到目前的收益率进入配置价值区间、去杠杆监管政策将更有针对性、通胀预期温和以及流动性紧张态势有可能逐步缓和等因素的影响，债券市场有望进入短期均衡状态，3.10%至 3.40%区间有可能是短期 10 年期国债收益率的合理水平，而收益率曲线平坦化和不均衡的利差水平将为市场带来交易型机会。投资策略方面，以有效防范市场波动风险为前提，关注央行公开市场操作、信用违约风险对市场预期的变化，警惕通胀和经济增长趋势的变化，力争把握市场震荡过程中的波段交易机会和市场过度反应的纠偏机会。

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、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**

无。

#### **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**

本报告期内，本基金曾出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形，以及出现了连续 20 个工作日基金持有人数低于 200 人的情形。

## **§ 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**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核

算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成景穗灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	31,805,436.37	44,448,047.19
结算备付金	1,135,282.38	51,246,346.53
存出保证金	107,193.46	1,004,905.47
交易性金融资产	523,533,048.01	327,428,319.09
其中：股票投资	47,916,056.01	24,114,319.09
基金投资	-	-

债券投资	475,616,992.00	303,314,000.00
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	195,989,673.57	148,000,165.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	10,549,551.23	6,791,062.49
应收股利	-	-
应收申购款	-	5,467.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	763,120,185.02	578,924,312.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>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	24,877,532.13	37,983,615.08
应付赎回款	20.40	2,051.95
应付管理人报酬	570,024.14	528,757.32
应付托管费	97,417.02	88,126.22
应付销售服务费	35,110.13	-
应付交易费用	310,045.75	697,969.63
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,000.00	90,001.54
负债合计	26,050,149.57	39,390,521.74
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	723,163,819.08	525,657,054.19
未分配利润	13,906,216.37	13,876,737.04
所有者权益合计	737,070,035.45	539,533,791.23
负债和所有者权益总计	763,120,185.02	578,924,312.97

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，大成景穗灵活混合基金 A 类基金份额净值 1.019 元，大成景穗灵活混合基金 C 类基金份额净值 1.018 元，基金份额总额 723,163,819.08 份，其中大成景穗灵活混合基金 A 类基金份额 675,452,020.24 份，大成景穗灵活混合基金 C 类基金份额 47,711,798.84 份。



## 7.2 利润表

会计主体：大成景穗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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 4 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-5,703,580.19	182,481,865.48
1.利息收入	19,212,688.49	74,529,774.13
其中：存款利息收入	267,588.30	30,987,982.79
债券利息收入	14,983,535.10	36,225,345.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,961,565.09	7,316,445.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,119,030.89	74,835,212.48
其中：股票投资收益	-4,144,287.87	67,676,169.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,090,411.44	6,925,949.52
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	115,668.42	233,093.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,009,715.16	1,870,706.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	212,477.37	31,246,172.01
<b>减：二、费用</b>	7,042,386.69	40,863,276.87
1. 管理人报酬	4,052,814.39	31,032,963.56
2. 托管费	677,882.13	5,172,160.55
3. 销售服务费	128,224.72	-
4. 交易费用	1,317,201.19	3,737,372.96
5. 利息支出	407,711.00	667,520.15
其中：卖出回购金融资产支出	407,711.00	667,520.15
6. 其他费用	458,553.26	253,259.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-12,745,966.88	141,618,588.61
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-12,745,966.88	141,618,588.61

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：大成景穗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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	525,657,054.19	13,876,737.04	539,533,791.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,745,966.88	-12,745,966.88
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）	197,506,764.89	12,775,446.21	210,282,211.10
其中：1. 基金申购款	800,141,910.14	28,101,560.11	828,243,470.25
2. 基金赎回款	-602,635,145.25	-15,326,113.90	-617,961,259.15
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）	723,163,819.08	13,906,216.37	737,070,035.45
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	245,983,927.99	-	245,983,927.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	141,618,588.61	141,618,588.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	279,673,126.20	-127,741,851.57	151,931,274.63

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	11,716,717,573.01	81,919,317.03	11,798,636,890.04
2. 基金赎回款	-11,437,044,446.81	-209,661,168.60	-11,646,705,615.41
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)	525,657,054.19	13,876,737.04	539,533,791.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>周立新</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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相一致。

### 7.4.2 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，股票的股息、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。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东(2016 年 4 月 25 日前)
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：1. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司(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。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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	213,534,163.78	24.55%	70,804,784.02	2.97%

**7.4.4.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至2015年12月31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	1,453,090.00	1.47%	752,330.01	0.04%

**7.4.4.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至2015年12月31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	786,200,000.00	33.25%	596,000,000.00	4.81%

**7.4.4.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.4.1.5 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	194,783.52	0.77%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	63,177.02	2.91%	16,585.11	2.64%

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,052,814.39	31,032,963.56
其中：支付销售机构的客户维护费	6,461.35	8,238.42

注：1. 2016年1月1日到2016年12月25日，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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.90% / 当年天数。

2. 根据《大成基金管理有限公司关于大成景穗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》，2016年12月26日到2016年12月31日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%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×0.60%÷当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	677,882.13	5,172,160.55

注：1. 2016年1月1日到2016年12月25日，支付基金托管人中国农业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：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

2. 根据《大成基金管理有限公司关于大成景穗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》，2016年12月26日到2016年12月31日，支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.12%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 X 0.12% / 当年天数。

#### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景穗灵活配置混合 A	大成景穗灵活配置混合 C	合计
大成基金	-	128,224.72	128,224.72
合计	-	128,224.72	128,224.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景穗灵活配置混合 A	大成景穗灵活配置混合 C	合计
合计	-	-	-

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月4日 (基金合同生效日)至 2015年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	27,052,173.91	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	27,052,173.91	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.74%	-

注：基金管理人大成基金于本会计年度赎回本基金的交易委托大成直销办理，申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

**7.4.4.4.2 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**

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

**7.4.4.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月4日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	31,805,436.37	227,584.42	44,448,047.19	4,935,446.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上一年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上一年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.5.1 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

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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-



		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；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。

#### 7.4.5.2 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
002462	嘉事堂	2016年9月28日	临时停牌	42.53	2017年1月12日	38.98	50,000	1,920,597.00	2,126,500.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	47,916,056.01	6.28
	其中：股票	47,916,056.01	6.28
2	固定收益投资	475,616,992.00	62.33
	其中：债券	475,616,992.00	62.33
	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	195,989,673.57	25.68
	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	32,940,718.75	4.32
7	其他各项资产	10,656,744.69	1.40
8	合计	763,120,185.02	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	3,076,000.00	0.42
C	制造业	21,738,183.78	2.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,644,000.00	0.36
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	2,126,500.00	0.29
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	8,592,000.00	1.17
J	金融业	9,723,780.00	1.32
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	47,916,056.01	6.50

**8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合**

无。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600436	片仔癀	200,000	9,158,000.00	1.24
2	300033	同花顺	50,000	3,439,000.00	0.47
3	600362	江西铜业	200,000	3,346,000.00	0.45
4	000423	东阿阿胶	50,000	2,693,500.00	0.37
5	600085	同仁堂	80,000	2,510,400.00	0.34
6	601628	中国人寿	100,000	2,409,000.00	0.33
7	002065	东华软件	100,000	2,330,000.00	0.32
8	601336	新华保险	50,000	2,189,000.00	0.30
9	002462	嘉事堂	50,000	2,126,500.00	0.29
10	002304	洋河股份	30,000	2,118,000.00	0.29

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站 (<http://www.dcfund.com.cn>) 的年度报告正文。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600362	江西铜业	22,473,543.00	4.17
2	600497	驰宏锌锗	19,684,171.96	3.65
3	000878	云南铜业	17,209,426.00	3.19
4	601601	中国太保	12,516,540.20	2.32
5	600809	山西汾酒	11,846,604.86	2.20
6	601628	中国人寿	10,826,238.89	2.01
7	300033	同花顺	10,195,063.80	1.89
8	600436	片仔癀	9,692,316.52	1.80
9	300059	东方财富	9,678,690.00	1.79
10	600016	民生银行	9,310,000.00	1.73
11	601336	新华保险	9,262,070.00	1.72

12	002304	洋河股份	9,092,831.60	1.69
13	601318	中国平安	9,008,117.00	1.67
14	601699	潞安环能	8,453,492.00	1.57
15	600519	贵州茅台	8,066,552.61	1.50
16	601688	华泰证券	8,045,029.00	1.49
17	000568	泸州老窖	7,964,691.28	1.48
18	000776	广发证券	7,351,467.48	1.36
19	600999	招商证券	6,864,646.53	1.27
20	000423	东阿阿胶	6,823,996.11	1.26

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。

#### 8.4.2 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	600497	驰宏锌锗	18,765,965.96	3.48
2	600362	江西铜业	18,575,769.90	3.44
3	000878	云南铜业	16,858,223.00	3.12
4	601601	中国太保	11,482,672.90	2.13
5	600809	山西汾酒	11,407,650.11	2.11
6	000901	航天科技	9,516,905.43	1.76
7	600016	民生银行	9,159,400.00	1.70
8	601628	中国人寿	8,811,206.11	1.63
9	601699	潞安环能	8,681,242.59	1.61
10	600519	贵州茅台	8,409,864.90	1.56
11	000568	泸州老窖	8,123,531.90	1.51
12	300059	东方财富	7,440,682.80	1.38
13	601688	华泰证券	7,367,572.49	1.37
14	000776	广发证券	7,346,967.00	1.36
15	601336	新华保险	7,091,211.54	1.31
16	601318	中国平安	7,053,919.00	1.31
17	002304	洋河股份	6,940,597.94	1.29
18	601988	中国银行	6,815,000.00	1.26
19	300033	同花顺	6,504,891.04	1.21
20	600999	招商证券	6,156,763.31	1.14

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。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	448,793,932.81
卖出股票收入（成交）总额	422,543,016.98

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。

**8.5 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	4,063,710.30	0.55
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	40,124,000.00	5.44
	其中：政策性金融债	40,124,000.00	5.44
4	企业债券	351,836,000.00	47.73
5	企业短期融资券	39,919,000.00	5.42
6	中期票据	38,378,000.00	5.21
7	可转债（可交换债）	1,296,281.70	0.18
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	475,616,992.00	64.53

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

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	1680422	16 韶关债	500,000	46,950,000.00	6.37
2	1280328	12 韶关债	600,000	37,698,000.00	5.11
3	1480123	14 西安保障债 01	300,000	31,254,000.00	4.24
4	1480349	14 合肥滨投债	300,000	31,044,000.00	4.21
5	140208	14 国开 08	300,000	30,180,000.00	4.09

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 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。

**8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.2 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。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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：**

本基金投资的前十名证券之一同花顺，于 2016 年 11 月 26 日收到证监会处罚，因违反了《证券法》第 122 条规定，构成非法经营证券业务。依据《证券法》第 197 条规定，证监会决定没收同花顺公司违法所得约 217 万元，并处以约 653 万元罚款。本基金投资的前十名证券之一中国人寿，于 2016 年 6 月 28 日因采取退保金直接冲减退保年度保费收入的方式处理长期险非正常退保业务，违反了《中华人民共和国保险法》相关规定，被中国保监会罚款 40 万元。本基金认为，对同花顺和中国人寿的处罚及调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

**8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。**

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	107,193.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,549,551.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,656,744.69

#### 8.12.4 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	113008	电气转债	535,532.40	0.07
2	127003	海印转债	760,749.30	0.10

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002462	嘉事堂	2,126,500.00	0.29	重大事项

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
大成景穗灵活	209	3,231,827.85	674,205,749.54	99.82%	1,246,270.70	0.18%

配置混合 A						
大成景穗灵活配置混合 C	1	47,711,798.84	47,711,798.84	100.00%	-	0.00%
合计	210	3,443,637.23	721,917,548.38	99.83%	1,246,270.70	0.17%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 9.2 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	大成景穗灵活配置混合 A	8,623.21	0.0013%
	大成景穗灵活配置混合 C	-	0.0000%
	合计	8,623.21	0.0012%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成景穗灵活配置混合 A	0
	大成景穗灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景穗灵活配置混合 A	0
	大成景穗灵活配置混合 C	0
	合计	0



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景穗灵活配置混合 A	大成景穗灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 4 日）基金份额总额	245,983,927.99	-
本报告期期初基金份额总额	525,657,054.19	-
本报告期基金总申购份额	703,430,111.30	96,711,798.84
减:本报告期基金总赎回份额	553,635,145.25	49,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	675,452,020.24	47,711,798.84

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于 2016 年 11 月 24 日起至 2016 年 12 月 23 日以通讯方式召开，本次基金份额持有人大会于 2016 年 12 月 26 日表决通过了《关于大成景穗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》，将管理费费率调整为 0.60%，托管费率调整为 0.12%，正式实施日为 2016 年 12 月 26 日，具体详见 2016 年 12 月 27 日公告。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2016 年 6 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

#### 二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付的审计费用为 6 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	213,534,163.78	24.55%	194,783.52	24.57%	-
平安证券	1	113,825,718.36	13.09%	103,726.56	13.08%	-
国金证券	2	73,840,787.27	8.49%	67,289.54	8.49%	-
海通证券	1	51,411,438.95	5.91%	46,852.06	5.91%	-
中信建投	2	46,863,480.41	5.39%	42,706.25	5.39%	-
川财证券	2	46,145,540.91	5.31%	42,051.20	5.30%	-
上海证券	1	45,659,278.11	5.25%	41,607.64	5.25%	-
中银国际	2	43,021,813.39	4.95%	39,206.91	4.95%	-
兴业证券	2	39,127,163.64	4.50%	35,656.13	4.50%	-

民生证券	1	36,650,391.76	4.21%	33,399.92	4.21%	-
华泰证券	1	36,345,763.05	4.18%	33,122.54	4.18%	-
山西证券	1	29,787,400.11	3.43%	27,145.21	3.42%	-
方正证券	1	27,142,456.01	3.12%	24,733.98	3.12%	-
银河证券	4	26,862,092.75	3.09%	24,479.65	3.09%	-
第一创业	1	13,422,545.24	1.54%	12,232.64	1.54%	-
齐鲁证券	1	11,789,589.03	1.36%	10,771.73	1.36%	-
中信证券	2	4,107,600.00	0.47%	3,743.17	0.47%	-
北京高华	1	3,271,790.70	0.38%	2,981.60	0.38%	-
中金公司	3	2,779,491.00	0.32%	2,532.86	0.32%	-
华创证券	1	2,590,956.00	0.30%	2,361.19	0.30%	-
浙商证券	1	834,173.00	0.10%	760.35	0.10%	-
安信证券	1	344,625.00	0.04%	314.11	0.04%	-
东北证券	2	244,375.00	0.03%	222.68	0.03%	-
东方证券	1	67,985.50	0.01%	61.95	0.01%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加基金交易单元：爱建证券、东方证券、中原证券、中金公司、广发证券、东吴证券、万和证券。本报告期内本基金退租席位：无。

### 11.7.2 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
光大证券	1,453,090.00	1.47%	786,200,000.00	33.25%	-	0.00%
平安证券	1,500,199.20	1.52%	58,500,000.00	2.47%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	5,000,000.00	0.21%	-	0.00%
中信建投	-	0.00%	56,000,000.00	2.37%	-	0.00%
川财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	-	0.00%	367,000,000.00	15.52%	-	0.00%
中银国际	3,201,344.38	3.25%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	27,000,000.00	1.14%	-	0.00%
华泰证券	748,073.07	0.76%	-	0.00%	-	0.00%

山西证券	79,177.00	0.08%	120,000,000.00	5.08%	-	0.00%
方正证券	1,787,537.40	1.81%	621,300,000.00	26.28%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
第一创业	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	2,881,102.20	2.92%	118,500,000.00	5.01%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
北京高华	111,491.00	0.11%	45,000,000.00	1.90%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	3,118,557.00	3.16%	160,000,000.00	6.77%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	693,882.21	0.70%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
爱建证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
宏源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	83,045,567.41	84.21%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万和证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中原证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。

3、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

大成基金管理有限公司  
2017 年 3 月 25 日