

大成睿景灵活配置混合型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要

2017 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：广发证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成睿景灵活配置混合	
基金主代码	001300	
交易代码	001300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 26 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,047,314,047.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成睿景灵活配置混合 A	大成睿景灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	001300	001301
报告期末下属分级基金的份额总额	1,366,240,007.46 份	681,074,039.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济转型期的成长股投资机会，本基金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，在控制风险前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*60%+ 中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	崔瑞娟
	联系电话	0755-83183388	020-87555888
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4008885558	95575
传真		0755-83199588	020-87555129

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	大成睿景灵活配置混合 A	大成睿景灵活配置混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-22,384,835.77	-12,114,520.46
本期利润	8,249,110.92	2,992,096.73
加权平均基金份额本期利润	0.0054	0.0041
本期基金份额净值增长率	1.24%	0.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.3347	-0.3473
期末基金资产净值	1,004,987,195.16	492,108,652.29
期末基金份额净值	0.736	0.723

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。

3.2 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

大成睿景灵活配置混合 A

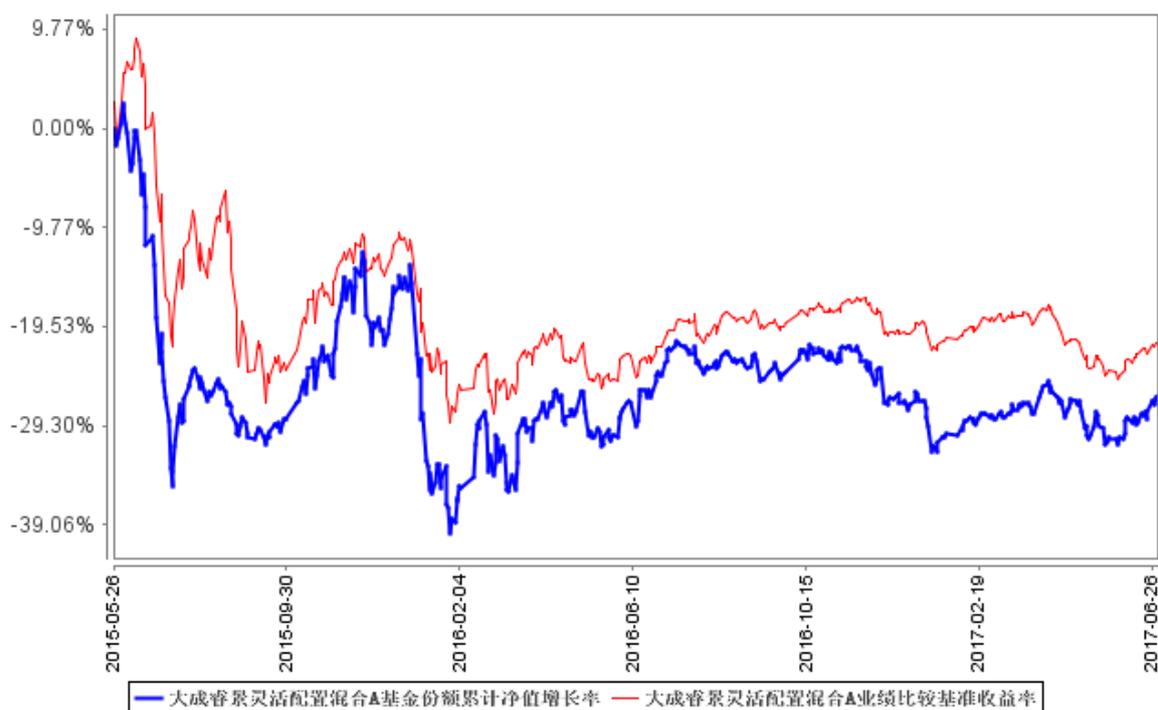
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.05%	0.80%	3.73%	0.56%	2.32%	0.24%
过去三个月	2.51%	0.97%	-2.34%	0.63%	4.85%	0.34%
过去六个月	1.24%	0.86%	-1.14%	0.55%	2.38%	0.31%
过去一年	-2.77%	0.83%	0.44%	0.55%	-3.21%	0.28%
自基金合同生效起至今	-26.40%	1.63%	-21.09%	1.36%	-5.31%	0.27%

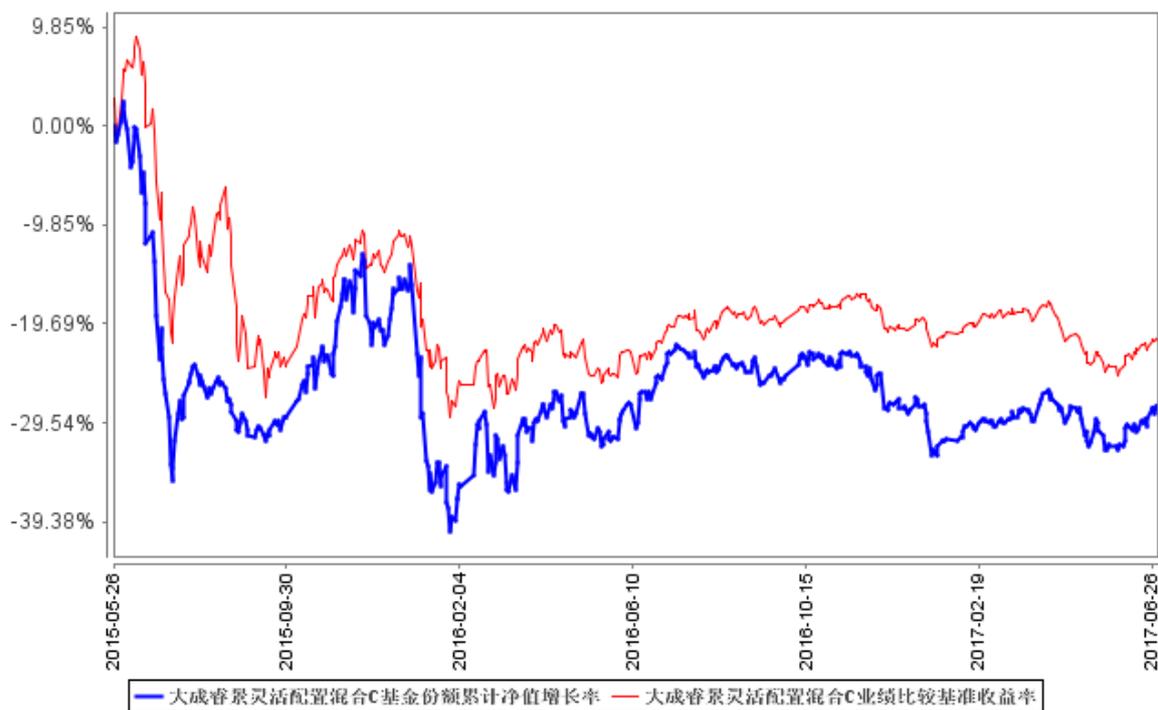
大成睿景灵活配置混合 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	6.01%	0.80%	3.73%	0.56%	2.28%	0.24%
过去三个月	2.41%	0.97%	-2.34%	0.63%	4.75%	0.34%
过去六个月	0.84%	0.86%	-1.14%	0.55%	1.98%	0.31%
过去一年	-3.60%	0.84%	0.44%	0.55%	-4.04%	0.29%
自基金合同生效起至今	-27.70%	1.63%	-21.09%	1.36%	-6.61%	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：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效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。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金，4 只 QDII 基金及 74 只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李本刚先生	本基金基金经理、股票投资部总监	2015 年 9 月 18 日	-	16 年	管理学硕士。2001 年至 2010 年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。2010 年 8 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012 年 9 月 4 日至 2015 年 7 月 1 日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 2 日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2014 年 4 月 16 日至 2015 年 7 月 2 日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月

					3 日起至 2015 年 10 月 21 日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理。2014 年 5 月 14 日至 2015 年 5 月 25 日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 9 月 18 日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 13 日起任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部总监。具有基金从业资格。国籍：中国
谢家乐先生	本基金基金经理助理	2017 年 2 月 20 日	-	4 年	华中科技大学硕士研究生。2014 年 6 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员。自 2017 年 2 月 20 日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国
陈龙先生	本基金基金经理助理	2015 年 12 月 1 日	2017 年 5 月 9 日	5 年	经济学硕士。2012 年 7 月至 2015 年 1 月任大成基金管理有限公司研究部助理研究员。2015 年 2 月至 2015 年 3 月任南方基金管理有限公司固定收益部研究员。2015 年 4 月至 2015 年 12 月任交银施罗德基金管理有限公司研究部高级研究员。2015 年 12 月加入大成基金管理有限公司，任股票投资部专职助理。2015 年 12 月 1 日至 2017 年 5 月 9 日担任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起担任大成国家安全主题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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 6 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 开年以来，制造业、基建、地产投资及出口均有明显向好趋势，一季度 GDP 增长录得 6.9%，实现近年新高，叠加微观层面企业利润明显改善，盈利取代流动性成为推动市场走强的核心驱动因素，周期股、一带一路主题在 1-2 月份均有较好表现。3 月份下旬及二季度，随着市场对于经济复苏的充分预期，叠加政策利率抬升、金融监管持续走强等因素，流动性取代盈利成为市场核心变量，追求确定性成为优先选择，以家电和白酒龙头为代表的的一线蓝筹成为上涨主力，并在后

期由一线蓝筹向估值盈利匹配的二线蓝筹扩散。基于此判断，我们提前对低估值的二线蓝筹有所布局，同时开始储备部分中报业绩有超预期可能的成长性品种

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿景灵活配置混合 A 基金份额净值为 0.736 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.24%；截至本报告期末大成睿景灵活配置混合 C 基金份额净值为 0.723 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.84%；同期业绩比较基准收益率为-1.14%。

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，我们认为业绩与估值的匹配程度是投资标的选择的首要因素，也将按此思路操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间

同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人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，本基金托管人在对大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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

本报告期内，大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成睿景灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成睿景灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	297,822,328.17	283,454,442.50
结算备付金	2,922,506.89	2,866,854.36
存出保证金	1,514,045.11	2,764,054.27
交易性金融资产	1,200,350,982.29	1,485,247,297.33
其中：股票投资	1,200,350,982.29	1,485,247,297.33
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	54,687.91	64,503.21
应收股利	-	-
应收申购款	13,466.10	45,693.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,502,678,016.47	1,774,442,845.38
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	40,943,237.99
应付赎回款	1,599,694.25	965,006.46
应付管理人报酬	1,823,273.05	2,256,831.24
应付托管费	303,878.85	376,138.55
应付销售服务费	316,867.71	377,093.40
应付交易费用	1,322,347.55	1,041,708.07

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	216,107.61	235,234.38
负债合计	5,582,169.02	46,195,250.09
所有者权益：		
实收基金	2,047,314,047.03	2,387,227,741.97
未分配利润	-550,218,199.58	-658,980,146.68
所有者权益合计	1,497,095,847.45	1,728,247,595.29
负债和所有者权益总计	1,502,678,016.47	1,774,442,845.38

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，大成睿景灵活配置混合基金 A 类基金份额净值 0.736 元，大成睿景灵活配置混合基金 C 类基金份额净值 0.723 元；基金份额总额 2,047,314,047.03 份，其中大成睿景灵活配置混合基金 A 类基金份额 1,366,240,007.46 份，大成睿景灵活配置混合基金 C 类基金份额 681,074,039.57 份。

6.2 利润表

会计主体：大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	32,391,006.30	-215,298,693.62
1.利息收入	1,615,571.85	1,848,720.89
其中：存款利息收入	1,148,471.78	1,848,720.89
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	467,100.07	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-14,998,875.85	-166,289,323.92
其中：股票投资收益	-30,405,936.91	-173,363,219.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	15,407,061.06	7,073,896.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	45,740,563.88	-51,306,956.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填	-	-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	33,746.42	448,866.18
减：二、费用	21,149,798.65	36,802,639.70
1. 管理人报酬	11,913,702.34	15,057,062.74
2. 托管费	1,985,617.08	2,509,510.41
3. 销售服务费	2,019,410.08	2,487,298.50
4. 交易费用	5,014,998.78	16,532,099.23
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	216,070.37	216,668.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	11,241,207.65	-252,101,333.32
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	11,241,207.65	-252,101,333.32

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,387,227,741.97	-658,980,146.68	1,728,247,595.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,241,207.65	11,241,207.65
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）	-339,913,694.94	97,520,739.45	-242,392,955.49
其中：1.基金申购款	28,393,619.26	-8,276,628.56	20,116,990.70
2. 基金赎回款	-368,307,314.20	105,797,368.01	-262,509,946.19
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)	2,047,314,047.03	-550,218,199.58	1,497,095,847.45
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,854,029,834.24	-440,463,520.95	2,413,566,313.29
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-252,101,333.32	-252,101,333.32
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)	-106,353,383.01	19,105,463.53	-87,247,919.48
其中：1.基金申购款	294,178,526.77	-96,371,398.87	197,807,127.90
2.基金赎回款	-400,531,909.78	115,476,862.40	-285,055,047.38
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)	2,747,676,451.23	-673,459,390.74	2,074,217,060.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于

实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

6.4.3 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	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
大成国际资产管理有限公司（“大成国	基金管理人的子公司

际”)	
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
广发证券	3,241,914,320.66	100.00%	10,926,641,205.23	100.00%

6.4.4.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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
广发证券	720,000,000.00	100.00%	-	0.00%

6.4.4.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	2,954,417.75	100.00%	1,322,347.55	100.00%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	9,957,600.56	100.00%	2,595,864.57	100.00%

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	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	11,913,702.34	15,057,062.74
其中：支付销售机构的客户维护费	5,075,224.11	6,180,558.52

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	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	1,985,617.08	2,509,510.41

注：支付基金托管人广发证券的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.4.2.3 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
	2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	大成睿景灵活配置 混合 A	大成睿景灵活配置 混合 C	合计
大成基金	-	23,284.06	23,284.06
广发证券	-	1,424,879.12	1,424,879.12
光大证券	-	501.25	501.25
合计	-	1,448,664.43	1,448,664.43
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿景灵活配置 混合 A	大成睿景灵活配置 混合 C	合计
大成基金	-	30,880.28	30,880.28
广发证券	-	1,769,584.12	1,769,584.12
光大证券	-	759.21	759.21
合计	-	1,801,223.61	1,801,223.61

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：
大成睿景灵活配置混合 C 日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.80% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	297,822,328.17	1,104,598.78	383,261,052.68	1,710,394.46

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 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。

6.4.5 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	

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。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300291	华录百纳	2017年4月19日	临时停牌	20.02	-	-	500,000	10,195,898.63	10,010,000.00	-
002127	南极电商	2017年6月29日	临时停牌	12.08	2017年7月6日	12.61	304,534	3,719,010.38	3,678,770.72	-
002856	美芝股份	2017年6月19日	临时停牌	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-

注：本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

§ 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	1,200,350,982.29	79.88
	其中：股票	1,200,350,982.29	79.88
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	300,744,835.06	20.01
7	其他各项资产	1,582,199.12	0.11
8	合计	1,502,678,016.47	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	40,867,078.62	2.73
C	制造业	561,520,138.29	37.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	142,612,836.72	9.53
F	批发和零售业	229,761.31	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	60,979,974.52	4.07
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	305,604.63	0.02
J	金融业	104,634,222.87	6.99
K	房地产业	242,535,434.26	16.20
L	租赁和商务服务业	3,720,617.84	0.25
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	2,809,490.63	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	30,072,000.00	2.01
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	10,063,822.60	0.67
S	综合	-	0.00
	合计	1,200,350,982.29	80.18

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600477	杭萧钢构	9,335,103	142,453,671.78	9.52
2	000858	五粮液	1,304,936	72,632,737.76	4.85
3	600985	雷鸣科化	5,610,792	72,547,540.56	4.85
4	601939	建设银行	10,000,000	61,500,000.00	4.11
5	300124	汇川技术	2,372,377	60,590,508.58	4.05
6	000718	苏宁环球	9,202,278	53,925,349.08	3.60
7	600029	南方航空	6,042,041	52,565,756.70	3.51
8	002050	三花智控	3,157,553	51,531,264.96	3.44
9	000402	金融街	4,295,927	50,348,264.44	3.36
10	002244	滨江集团	7,209,571	49,890,231.32	3.33

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。

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	600985	雷鸣科化	89,752,308.59	5.19
2	600029	南方航空	66,701,617.74	3.86
3	000858	五粮液	65,149,767.38	3.77
4	601601	中国太保	60,221,384.81	3.48
5	601939	建设银行	57,723,199.00	3.34

6	002244	滨江集团	54,847,935.38	3.17
7	300124	汇川技术	53,399,195.45	3.09
8	000402	金融街	52,270,119.87	3.02
9	000597	东北制药	51,435,090.23	2.98
10	600198	大唐电信	50,933,706.10	2.95
11	600176	中国巨石	50,219,356.75	2.91
12	000671	阳光城	49,498,585.21	2.86
13	603377	东方时尚	39,606,714.82	2.29
14	601669	中国电建	37,608,489.00	2.18
15	002738	中矿资源	35,374,224.19	2.05
16	000786	北新建材	33,037,105.07	1.91
17	002430	杭氧股份	32,841,448.00	1.90
18	600310	桂东电力	32,193,360.61	1.86
19	000018	神州长城	30,960,714.60	1.79
20	600011	华能国际	30,405,738.40	1.76

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	601789	宁波建工	87,902,939.44	5.09
2	600110	诺德股份	75,869,039.83	4.39
3	300408	三环集团	72,112,780.55	4.17
4	002738	中矿资源	69,711,597.40	4.03
5	601899	紫金矿业	62,902,786.20	3.64
6	002550	千红制药	57,585,700.87	3.33
7	300241	瑞丰光电	52,002,308.59	3.01
8	300210	森远股份	48,731,833.20	2.82
9	002050	三花智控	47,627,670.21	2.76
10	601669	中国电建	37,074,940.81	2.15
11	601611	中国核建	34,605,863.51	2.00
12	002355	兴民智通	33,913,382.98	1.96
13	300447	全信股份	33,516,692.77	1.94
14	000630	铜陵有色	32,725,048.40	1.89
15	600797	浙大网新	32,265,092.70	1.87
16	600011	华能国际	31,848,788.35	1.84

17	002482	广田集团	31,242,027.40	1.81
18	002581	未名医药	31,213,111.28	1.81
19	300059	东方财富	30,066,412.09	1.74
20	000786	北新建材	29,399,899.07	1.70

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	1,472,738,228.60
卖出股票收入（成交）总额	1,772,969,170.61

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

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投资。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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本期未出现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	1,514,045.11

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,687.91
5	应收申购款	13,466.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,582,199.12

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券。

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

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
大成睿景灵活配置混合 A	19,147	71,355.30	-	0.00%	1,366,240,007.46	100.00%
大成睿景灵活配置混合 C	10,924	62,346.58	1,477,140.41	0.22%	679,596,899.16	99.78%
合计	30,071	68,082.67	1,477,140.41	0.07%	2,045,836,906.62	99.93%

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	大成睿景灵活配置混合 A	412,485.99	0.0302%
	大成睿景灵活配置混合 C	25,114.90	0.0037%
	合计	437,600.89	0.0214%

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）。

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成睿景灵活配置混合 A	10~50
	大成睿景灵活配置混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成睿景灵活配置混合 A	0
	大成睿景灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成睿景灵活配置混合 A	大成睿景灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 26 日）基金份额总额	2,702,699,750.93	1,532,807,589.94
本报告期期初基金份额总额	1,630,710,059.09	756,517,682.88
本报告期基金总申购份额	8,763,307.81	19,630,311.45
减：本报告期基金总赎回份额	273,233,359.44	95,073,954.76
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	1,366,240,007.46	681,074,039.57

§ 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 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，杜鹃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。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履职的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

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。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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	
广发证券		23,241,914,320.66	100.00%	2,954,417.75	100.00%	-

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，无新增或退租交易单元。

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
广发证券	-	0.00%	720,000,000.00	100.00%	-	0.00%

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日