

大成景荣债券型证券投资基金（原大成景  
荣保本混合型证券投资基金转型）  
2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 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。

根据《大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金由大成景荣保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。大成景荣保本混合型证券投资基金于 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 5 月 20 日进行募集，并于 2016 年 5 月 25 日正式成立，保本周期为 2 年，第一个保本期自 2016 年 5 月 25 日至 2018 年 5 月 25 日。大成景荣保本混合型证券投资基金第一个保本期于 2018 年 5 月 25 日到期，由于在第一个保本周期届满后不再符合保本基金存续条件，按照《大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“大成景荣债券型证券投资基金”。大成景荣保本混合型证券投资基金的第一个保本到期操作期间为保本期到期日，即 2018 年 5 月 25 日。自 2018 年 5 月 26 日起，大成景荣保本混合型证券投资基金正式转型为大成景荣债券型证券投资基金，转型后的《大成景荣债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

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。

自 2018 年 5 月 26 日原大成景荣保本混合型证券投资基金名称变更为大成景荣债券型证券投资基金。原大成景荣保本混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 5 月 25 日止，大成景荣债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 5 月 26 日至 6 月 30 日止。

## 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>23</b>
6.1 资产负债表.....	23
6.2 利润表.....	24
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
6.4 报表附注.....	26
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>42</b>
6.1 资产负债表.....	42
6.2 利润表.....	43
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	44
6.4 报表附注.....	45
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>64</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	64
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	64
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68

7.5 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.....	69
7.6 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.....	69
7.7 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.....	69
7.8 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.....	69
7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.10 投资组合报告附注.....	70
<b>§7 投资组合报告（转型前）.....</b>	<b>71</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	71
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	71
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.....	72
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	76
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
7.12 投资组合报告附注.....	76
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后）.....</b>	<b>78</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前）.....</b>	<b>80</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
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.....	80
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>82</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>83</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>84</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84
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.....	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
10.4 基金投资策略的改变.....	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
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.....	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	86
10.9 其他重大事件（转型后）.....	87
10.9 其他重大事件（转型前）.....	87
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>90</b>
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.....	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>91</b>
12.1 备查文件目录.....	91

12.2 存放地点.....	91
12.3 查阅方式.....	91

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	大成景荣债券型证券投资基金	
基金简称	大成景荣债券	
基金主代码	002644	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	89,472,335.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成景荣债券 A	大成景荣债券 C
下属分级基金的交易代码	002644	002645
报告期末下属分级基金的份额总额	89,472,333.73 份	1.80 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	大成景荣保本混合型证券投资基金	
基金简称	大成景荣保本混合	
基金主代码	002644	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 5 月 25 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,526,449,480.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成景荣保本混合 A	大成景荣保本混合 C
下属分级基金的交易代码	002644	002645
报告期末下属分级基金的份额总额	1,526,449,478.90 份	1.80 份

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，在严格控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为者提供长期稳定回报。
投资策略	本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。

业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是债券型基金，预期收益及风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资采用 CPPI 恒定比例组合保险原理，将基金资产优化分配在安全资产和风险资产上；并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与安全资产在投资组合中的比重，在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上，积极参与分享市场可能出现的风险收益，从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。本基金投资的安全资产主要投资于国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换公司债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、同业存单、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等固定收益品种及国债期货。风险资产主要投资于股票、权证等权益类品种及股指期货。
业绩比较基准	人民银行公布的两年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金是保本混合型基金，属于证券市场中的低风险品种。

## 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	石立平
	联系电话	0755-83183388	010-63639180
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83199588	010-63639132
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		518040	100033

法定代表人	刘卓	李晓鹏
-------	----	-----

## 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 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国 光大中心

## 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、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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	大成景荣债券 A	大成景荣债券 C
本期已实现收益	5,571,247.51	0.05
本期利润	-2,061,605.72	-0.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0122	-0.0167
本期加权平均净值利润率	-1.18%	-1.62%
本期基金份额净值增长率	-1.25%	-1.53%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日	
期末可供分配利润	2,636,303.67	0.05
期末可供分配基金份额利润	0.0295	0.0278
期末基金资产净值	92,108,637.40	1.85
期末基金份额净值	1.0290	1.0280
3.1.3 累计期末指标	2018年6月30日	
基金份额累计净值增长率	-1.25%	-1.53%

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

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年5月25日	
	大成景荣保本混合 A	大成景荣保本混合 C
本期已实现收益	19,040,095.33	-
本期利润	22,960,545.28	0.03
加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0167
本期加权平均净值利润率	1.35%	1.62%
本期基金份额净值增长率	1.36%	1.56%
3.1.2 期末数据和指标	2018年5月25日	
期末可供分配利润	57,480,326.64	0.03
期末可供分配基金份额利润	0.0377	0.0167
期末基金资产净值	1,590,421,812.62	1.88
期末基金份额净值	1.042	1.044
3.1.3 累计期末指标	2018年5月25日	
基金份额累计净值增长率	4.20%	2.45%

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（转型后）

#### 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

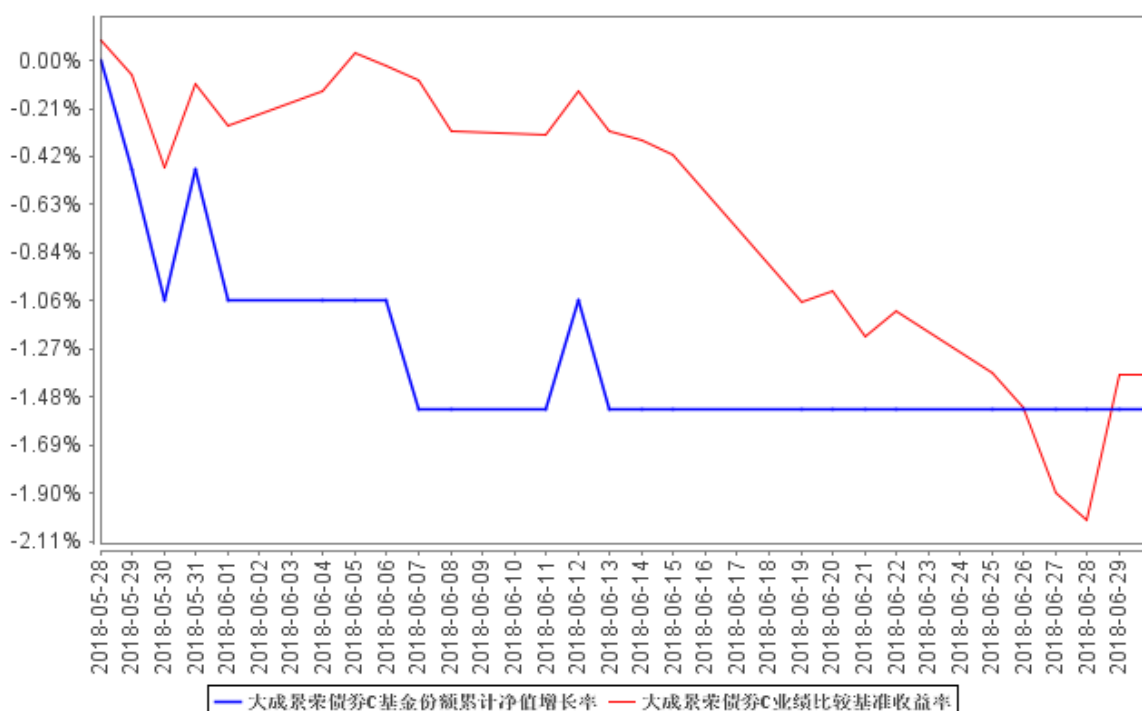
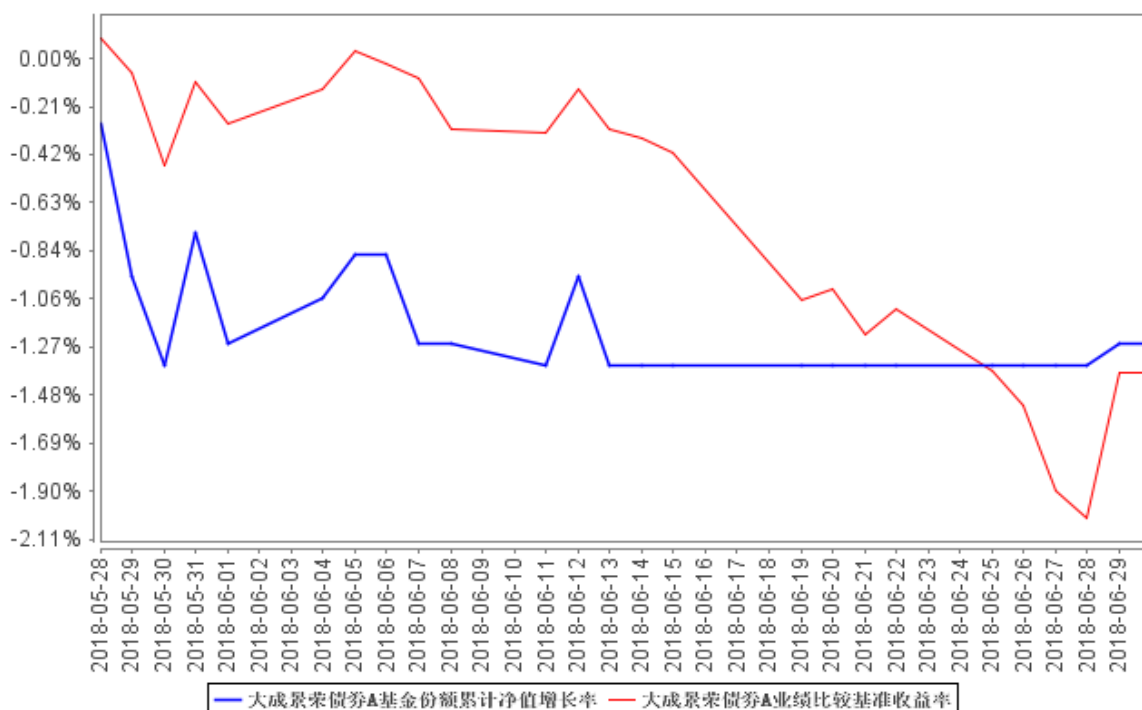
大成景荣债券 A

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	-0.48%	0.20%	-1.28%	0.25%	0.80%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.25%	0.27%	-1.38%	0.26%	0.13%	0.01%

大成景荣债券 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	-1.06%	0.22%	-1.28%	0.25%	0.22%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-1.53%	0.28%	-1.38%	0.26%	-0.15%	0.02%

### 3.2.2 自基金转型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：本基金合同于2018年5月26日生效，截至报告期末本基金合同转型未满一年。本基金合同规定，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。截至报告期末，本基金仍处于建仓期。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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

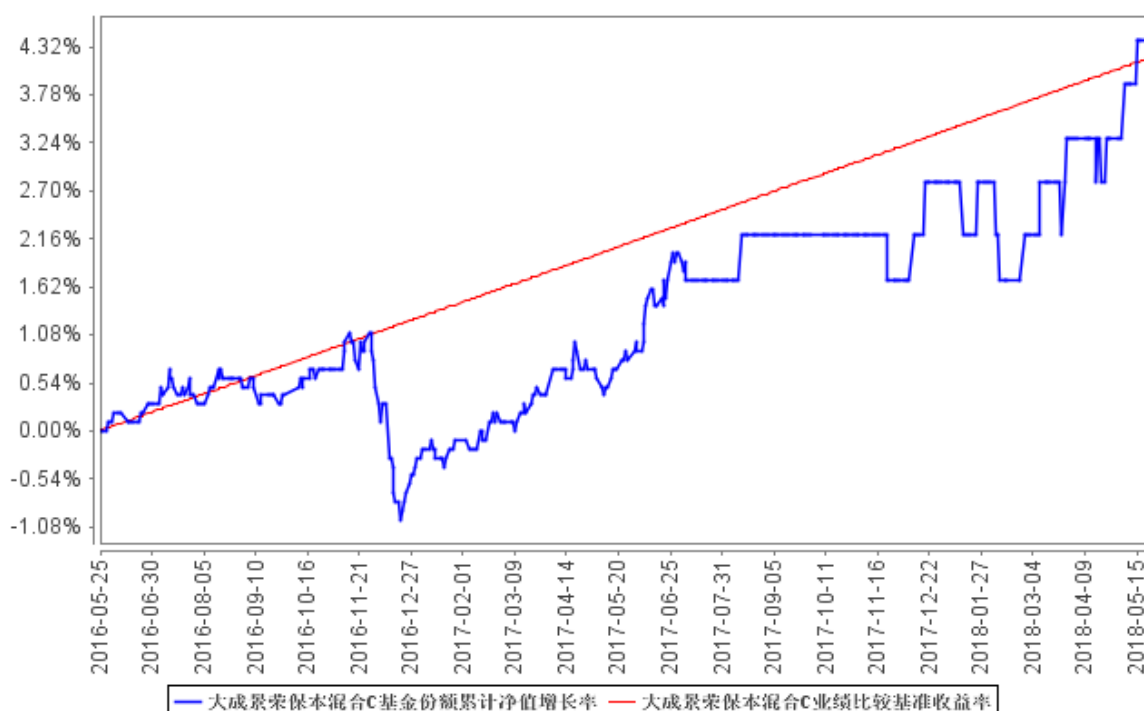
大成景荣保本混合 A

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	0.19%	0.16%	0.17%	0.01%	0.02%	0.15%
过去三个月	1.17%	0.19%	0.50%	0.01%	0.67%	0.18%
过去六个月	1.56%	0.19%	1.02%	0.01%	0.54%	0.18%
过去一年	3.27%	0.16%	2.06%	0.01%	1.21%	0.15%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.13%	4.20%	0.01%	0.00%	0.12%

大成景荣保本混合 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	③ ③	④ ④
过去一个月	1.06%	0.16%	0.17%	0.01%	0.89%	0.15%
过去三个月	2.65%	0.22%	0.50%	0.01%	2.15%	0.21%
过去六个月	2.65%	0.20%	1.02%	0.01%	1.63%	0.19%
自基金合同生效起至今	2.45%	0.16%	1.82%	0.01%	0.63%	0.15%

### 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。截止本基金转型前，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%)。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2018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，5只QDII基金及75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（转型后）

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	2016年5月25日	-	22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日至2018年5月25日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。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。2018年5月26日起任大成景荣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
孙丹女士	本基金基金经理	2017年5月8日	-	10年	经济学硕士。2008年至2012年就职于景顺长城产品开发部任产品经理；2012年至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。2017年5月8日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017年5月8日至2018年5月25日任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2017年5月31日起担任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月2日起

				担任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金、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。2017年6月6日起担任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月12日起任大成策略回报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）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2018年3月14日起担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景沛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基金经理。2018年5月26日起任大成景荣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
--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	2016年5月25日	-	22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



					<p>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日至2018年5月25日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。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。2018年5月26日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
孙丹女士	本基金基金经理	2017年5月8日	-	10年	<p>经济学硕士。2008年至2012年就职于景顺长城产品开发部任产品经理；2012年至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</p>

				<p>员。2017 年 5 月 8 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2018 年 5 月 25 日任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 31 日起担任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日起担任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金、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。2017 年 6 月 6 日起担任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报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）、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理。2018 年 3 月 14 日起担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景沛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基金经理。2018 年 5 月 26 日起任大成景荣债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	---

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变动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变动导致个别组合间的成交价格存在一定差异，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 1 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

2018 年上半年，金融监管加强，加上财政政策紧缩，国内去杠杆的进一步推进和信用风险事件的频繁出现，叠加 5 月份之后中美贸易战愈演愈烈，整体证券市场波动加大。2018 年上半

年，上证指数跌 13.90%，中小板综指跌 16.30%，创业板综指跌 11.92%，大小风格指数一起下跌。从行业板块来看，根据 WIND 资讯的行业算术平均，无一行业上涨，跌幅相对较小的计算机、医药生物和食品饮料跌幅在 7% 以内，综合、采掘、建材、非银、有色等板块跌幅都在 20% 以上，整个市场的悲观气氛浓重。

本基金在 2018 年 5 月 25 日转型为二级债券型基金，大部分客户由于产品性质的改变而开始赎回，在二季度末，本基金的规模大幅下降。操作上，在 5 月 25 日之前，考虑到客户可能要大比例赎回，加上对权益市场的谨慎，我们对权益仓位进行了全面的减持，回避了一段下跌。在 6 月底，分析大盘经过大幅的下跌，权益市场存在反弹的机会，开始加仓股票。

债券市场方面，由于 5 月 25 日保本周期结束，所以债券组合基本是非常短的久期，未能享受到本轮利率债的上涨。本基金转型后，由于规模较小，固定收益部分基本是以存款和逆回购为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本基金转型前，本基金 A 基金份额净值为 1.042 元，A 基金份额净值增长率为 1.56%，C 基金份额净值为 1.044 元，C 基金份额净值增长率为 2.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.02%。转型后至本报告期末，本基金 A 份额净值为 1.0290 元，A 基金份额净值增长率为-1.25%，C 基金份额净值为 1.028 元，C 基金份额净值增长率为-1.53%，同期业绩比较基准收益率为-1.38%。

#### 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 2018 年下半年，我们认为宏观经济存在继续微调的可能，总体有利于 A 股市场的短期反弹，但贸易争端是否会进一步恶化依然存在不确定性，这将在很大程度上制约 A 股的上行，所以本基金将适度控制好权益仓位，行业选择上重点配置景气度向上的计算机、业绩相对平稳的医药、食品饮料、家电为主。债券市场方面将继续坚持中高等级和中等久期的配置。

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

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在大成基金管理有限公司（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——大成基金管理有限公司编制的“大成景荣债券型证券投资基金 2018 年半年度报告”进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成景荣债券型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.3.1	53,708,802.38
结算备付金		831,189.72
存出保证金		220,394.65
交易性金融资产	6.4.3.2	18,395,767.20
其中：股票投资		14,226,400.00
基金投资		-
债券投资		4,169,367.20
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.3.3	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	34,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.3.5	127,627.36
应收股利		-
应收申购款		99.80
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.3.6	-
资产总计		107,283,881.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.3.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		14,070,940.87
应付赎回款		452,125.66
应付管理人报酬		61,130.14
应付托管费		17,465.76
应付销售服务费		-

应付交易费用	6.4.3.7	370,024.17
应交税费		241.58
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.3.8	203,313.68
负债合计		15,175,241.86
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.3.9	89,472,335.53
未分配利润	6.4.3.10	2,636,303.72
所有者权益合计		92,108,639.25
负债和所有者权益总计		107,283,881.11

注：1、报告截止日2018年6月30日，大成景荣债券A类基金份额净值1.029元，大成景荣债券C类基金份额净值1.028元，基金份额总额89,472,335.53份，其中大成景荣债券A类基金份额89,472,333.73份，大成景荣债券C类基金份额1.80份。

2、本基金合同生效日为2018年5月26日，本报告期自2018年5月26日至2018年6月30日止。截至报告日，本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据，下同。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景荣债券型证券投资基金

本报告期：2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年5月26日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
<b>一、收入</b>		-1,457,575.64
1. 利息收入		394,606.53
其中：存款利息收入	6.4.3.11	106,332.68
债券利息收入		138,650.73
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		149,623.12
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,780,657.93
其中：股票投资收益	6.4.3.12	5,835,749.35
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.3.13	-33,848.30
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-



衍生工具收益	6.4.3.15	-
股利收益	6.4.3.16	-21,243.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-7,632,853.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	13.21
<b>减：二、费用</b>		604,030.11
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	163,278.98
2. 托管费	6.4.6.2.2	46,651.14
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-
4. 交易费用	6.4.3.19	334,475.26
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		76.39
7. 其他费用	6.4.3.20	59,548.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,061,605.75
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,061,605.75

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景荣债券型证券投资基金

本报告期：2018年5月26日（基金合同生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年5月26日（基金合同生效日）至2018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）	1,526,449,480.70	63,972,333.80	1,590,421,814.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,061,605.75	-2,061,605.75
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）	-1,436,977,145.17	-59,274,424.33	-1,496,251,569.50
其中：1. 基金申购款	26,130.09	734.35	26,864.44
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,437,003,275.26	-59,275,158.68	-1,496,278,433.94
四、本期向基金份额持有人分	-	-	0.00

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）	89,472,335.53	2,636,303.72	92,108,639.25

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 基金基本情况

大成景荣债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由原大成景荣保本混合型证券投资基金转型而来。根据《大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同》，原大成景荣保本混合型证券投资基金为契约型开放式，存续期为不定期，每两年为 1 个保本期间。自 2016 年 5 月 25 日大成景荣保本混合型证券投资基金成立以后，已经经过一个保本期间运作。鉴于本基金的第一个保本周期到期后，本基金管理人无法为本基金转入下一保本期间确定保本担保人或保本义务人，本基金不符合保本基金存续的条件。按照《大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金转型为大成景荣债券型证券投资基金。自 2018 年 5 月 26 日（转型后首日）起，原大成景荣保本混合型证券投资基金，更名为大成景荣债券型证券投资基金，《大成景荣债券型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

原大成景荣保本混合型证券投资基金于 2018 年 5 月 25 日经基金管理人大成基金管理有限公司计算并经基金托管人中国光大银行股份有限公司确认的资产净值为 1,590,421,814.50 元，已于 2018 年 5 月 26 日全部转为本基金的基金资产净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成景荣债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金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）、债券、权证（含各类期权）、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；

现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金业绩比较基准为中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 5 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与转型前最近一期年度报告一致。

## 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	53,708,802.38
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	53,708,802.38

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	14,091,173.69	14,226,400.00	135,226.31
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,183,548.80	4,169,367.20
	银行间市场	-	-
	合计	4,183,548.80	4,169,367.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,274,722.49	18,395,767.20	121,044.71

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券	34,000,000.00	-

合计	34,000,000.00	-
----	---------------	---

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	9,600.96
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	336.60
应收债券利息	119,318.59
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,718.07
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	89.28
合计	127,627.36

#### 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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	354,607.35
银行间市场应付交易费用	15,416.82
合计	370,024.17

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	203,313.68
合计	203,313.68

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景荣债券 A		
项目	本期 2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	1, 526, 449, 478. 90	1, 526, 449, 478. 90
本期申购	26, 130. 09	26, 130. 09
本期赎回(以“-”号填列)	-1, 437, 003, 275. 26	-1, 437, 003, 275. 26
- 基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算变动份额		
本期申购		
本期赎回(以“-”号填列)		
本期末	89, 472, 333. 73	89, 472, 333. 73

金额单位：人民币元

大成景荣债券 C		
项目	本期 2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	1. 80	1. 80
本期申购	0. 00	0. 00
本期赎回(以“-”号填列)	0. 00	0. 00
- 基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算变动份额		
本期申购		
本期赎回(以“-”号填列)		
本期末	1. 80	1. 80

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

金额单位：人民币元

大成景荣债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	57, 480, 326. 64	6, 492, 007. 08	63, 972, 333. 72
本期利润	5, 571, 247. 51	-7, 632, 853. 23	-2, 061, 605. 72

本期基金份额交易产生的变动数	-57,279,832.01	-1,994,592.32	-59,274,424.33
其中：基金申购款	1,656.23	-921.88	734.35
基金赎回款	-57,281,488.24	-1,993,670.44	-59,275,158.68
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	5,771,742.14	-3,135,438.47	2,636,303.67

金额单位：人民币元

大成景荣债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	0.03	0.05	0.08
本期利润	0.05	-0.08	-0.03
本期基金份额交易产生的变动数	0.00	0.00	0.00
其中：基金申购款	0.00	0.00	0.00
基金赎回款	0.00	0.00	0.00
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	0.08	-0.03	0.05

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
	2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
活期存款利息收入	104,534.92
定期存款利息收入	
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	1,465.42
其他	332.34
合计	106,332.68

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
卖出股票成交总额	154,219,154.80
减：卖出股票成本总额	148,383,405.45
买卖股票差价收入	5,835,749.35



### 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 2018年5月26日至2018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	-33,848.30
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	-33,848.30

#### 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 2018年5月26日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	330,706,478.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	325,922,600.00
减：应收利息总额	4,817,726.98
买卖债券差价收入	-33,848.30

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

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

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 2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	-21,243.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	-21,243.12

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,632,853.31
——股票投资	-7,584,344.41
——债券投资	-48,508.90
——资产支持证券投资	0.00
——贵金属投资	
——其他	0.00
2. 衍生工具	0.00
——权证投资	0.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	-7,632,853.31

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13.21
合计	13.21

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	334,250.26
银行间市场交易费用	225.00
合计	334,475.26

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	10,849.32
信息披露费	29,588.76
其他	-
上清所债券托管帐户维护费	-
银行划款手续费	19,110.26
中债登债券托管帐户维护费	-
合计	59,548.34

#### 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，本基金并无须作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

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。

##### 6.4.9.2 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（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	57,266,428.52	31.81%

#### 6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	211,600,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	52,185.36	31.81%	106,936.58	30.16%

#### 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 2018年5月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	163,278.98
其中：支付销售机构的客户维护费	60,509.26

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0.70%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 0.70% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	46,651.14

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

本基金本报告期内未发生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之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	
	2018 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行-活期存款	53,708,802.38	104,534.92

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，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（2018 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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

### 6.4.12.18 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

本基金是债券型基金，预期收益及风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。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（合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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，将风险控制在可承受的范围内。

### 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光大银行；定期存款存放在具有基金托管资格的，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2018年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	3,872,387.20
合计	3,872,387.20

注：未评级部分为国债。

#### 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 2018年6月30日
AAA	-
AAA 以下	296,980.00

未评级	-
合计	296,980.00

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018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	53,708,802.38	-	-	-	53,708,802.38
结算备付金	831,189.72	-	-	-	831,189.72
存出保证金	220,394.65	-	-	-	220,394.65
交易性金融资产	3,872,387.20	296,980.00	-	-14,226,400.00	18,395,767.20
买入返售金融资产	34,000,000.00	-	-	-	34,000,000.00
应收利息	-	-	-	127,627.36	127,627.36
应收申购款	-	-	-	99.80	99.80
资产总计	92,632,773.95	296,980.00	-	-14,354,127.16	107,283,881.11
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-14,070,940.87	14,070,940.87
应付赎回款	-	-	-	452,125.66	452,125.66
应付管理人报酬	-	-	-	61,130.14	61,130.14
应付托管费	-	-	-	17,465.76	17,465.76
应付交易费用	-	-	-	370,024.17	370,024.17
应交税费	-	-	-	241.58	241.58
其他负债	-	-	-	203,313.68	203,313.68
负债总计	-	-	-	-15,175,241.86	15,175,241.86
利率敏感度缺口	92,632,773.95	296,980.00	-	-821,114.70	92,108,639.25

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.53%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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，采用“自上而下”的策略，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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金风险资产占基金资产的比例不高于 40%；安全资产占基金资产的比例不低于 60%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金持有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 5%。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 2018 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	14,226,400.00	15.45
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	14,226,400.00	15.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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(2018年6月30日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5	520,000.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5	-520,000.00	

#### 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。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成景荣保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年5月25日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年5月25日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	532,555,348.47	4,857,823.62
结算备付金		1,095,360.67	335,325.17
存出保证金		165,661.35	163,842.43
交易性金融资产	6.4.3.2	474,536,665.27	1,820,968,106.55
其中：股票投资		144,396,189.17	163,866,704.95
基金投资			-
债券投资		330,140,476.10	1,657,101,401.60
资产支持证券投资			-
贵金属投资			-
衍生金融资产	6.4.3.3		-
买入返售金融资产	6.4.3.4	594,279,000.17	78,500,357.75
应收证券清算款		0.00	17,232,443.40
应收利息	6.4.3.5	4,961,851.87	19,246,542.13
应收股利			-
应收申购款		98.81	9.99
递延所得税资产			-
其他资产	6.4.3.6		-
资产总计		1,607,593,986.61	1,941,304,451.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年5月25日</b>	<b>上年度末 2017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	6.4.3.3		-
卖出回购金融资产款		0.00	190,060,539.51
应付证券清算款			-
应付赎回款		15,136,950.01	2,428,778.02
应付管理人报酬		1,358,451.10	1,795,924.01
应付托管费		226,408.50	299,320.66
应付销售服务费			-
应付交易费用	6.4.3.7	205,627.59	357,220.95
应交税费		81,859.31	-

应付利息		0.00	286,546.37
应付利润			-
递延所得税负债			-
其他负债	6.4.3.8	162,875.60	315,481.19
负债合计		17,172,172.11	195,543,810.71
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	1,526,449,480.70	1,697,972,358.96
未分配利润	6.4.3.10	63,972,333.80	47,788,281.37
所有者权益合计		1,590,421,814.50	1,745,760,640.33
负债和所有者权益总计		1,607,593,986.61	1,941,304,451.04

注：报告截止日2018年5月25日，大成景荣债券A类基金份额净值1.042元，大成景荣债券C类基金份额净值1.044元，基金份额总额1,526,449,480.70份，其中大成景荣债券A类基金份额1,526,449,478.90份，大成景荣债券C类基金份额1.80份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景荣保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年5月25日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年5月25日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
<b>一、收入</b>		33,933,154.22	66,183,935.21
1. 利息收入		30,359,494.19	40,267,680.90
其中：存款利息收入	6.4.3.11	90,554.60	5,485,808.34
债券利息收入		27,765,760.66	32,232,598.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,503,178.93	2,549,273.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-455,794.68	942,475.17
其中：股票投资收益	6.4.3.12	7,477,825.99	7,809,536.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-8,304,553.73	-8,297,520.51
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14		-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	370,933.06	1,430,458.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	3,920,449.98	24,828,415.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号		-	-

填列)			
5. 其他收入（损失以“-”号填列)	6.4.3.18	109,004.73	145,363.74
<b>减：二、费用</b>		10,972,608.91	18,521,158.68
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	8,123,943.62	12,367,014.43
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,353,990.56	2,061,169.06
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	0.00	-
4. 交易费用	6.4.3.19	873,391.58	1,152,013.82
5. 利息支出		403,688.74	2,719,047.69
其中：卖出回购金融资产支出		403,688.74	2,719,047.69
6. 税金及附加		36,118.81	-
7. 其他费用	6.4.3.20	181,475.60	221,913.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)</b>		22,960,545.31	47,662,776.53
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列)</b>		22,960,545.31	47,662,776.53

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景荣保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年5月25日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25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)	1,697,972,358.96	47,788,281.37	1,745,760,640.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润)	-	22,960,545.31	22,960,545.31
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)	-171,522,878.26	-6,776,492.88	-178,299,371.14
其中：1. 基金申购款	80,718.10	3,026.77	83,744.87
2. 基金赎回款	-171,603,596.36	-6,779,519.65	-178,383,116.01
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）	1,526,449,480.70	63,972,333.80	1,590,421,814.50
项目	上年度可比期间 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）	2,119,489,578.77	-7,316,327.31	2,112,173,251.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,662,776.53	47,662,776.53
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）	-143,600,053.03	-1,090,951.32	-144,691,004.35
其中：1. 基金申购款	34,396.31	188.35	34,584.66
2. 基金赎回款	-143,634,449.34	-1,091,139.67	-144,725,589.01
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）	1,975,889,525.74	39,255,497.90	2,015,145,023.64

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一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 6.4.2 税项

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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

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该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

(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。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 5 月 25 日
活期存款	532,555,348.47
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	532,555,348.47

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 5 月 25 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	136,676,618.45	144,396,189.17	7,719,570.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,766,476.10	121,927.30
	银行间市场	325,461,600.00	-87,600.00
	合计	330,106,148.80	34,327.30
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	466,782,767.25	474,536,665.27	7,753,898.02
项目	上年度末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

#### 6.4.3.3 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。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年5月25日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券_银行 间	594,279,000.17	-
合计	594,279,000.17	-

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年5月25日
应收活期存款利息	63,322.77
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	4,659.02
应收债券利息	4,797,758.26

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	95,624.16
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	487.66
合计	4,961,851.87

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年5月25日
交易所市场应付交易费用	190,570.02
银行间市场应付交易费用	15,057.57
合计	205,627.59

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年5月25日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	162,875.60
合计	162,875.60

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景荣保本混合 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,697,972,357.16	1,697,972,357.16
本期申购	80,718.10	80,718.10
本期赎回(以“-”号填列)	-171,603,596.36	-171,603,596.36
- 基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购		
本期赎回(以“-”号填列)		
本期末	1,526,449,478.90	1,526,449,478.90

金额单位：人民币元

大成景荣保本混合 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 25 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1.80	1.80
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1.80	1.80

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

金额单位：人民币元

大成景荣保本混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,456,191.51	3,332,089.81	47,788,281.32
本期利润	19,040,095.33	3,920,449.95	22,960,545.28
本期基金份额交易产生的变动数	-6,015,960.20	-760,532.68	-6,776,492.88
其中：基金申购款	2,639.75	387.02	3,026.77
基金赎回款	-6,018,599.95	-760,919.70	-6,779,519.65
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	57,480,326.64	6,492,007.08	63,972,333.72

金额单位：人民币元

大成景荣保本混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.03	0.02	0.05
本期利润	0.00	0.03	0.03
本期基金份额交易产生的变动数	0.00	0.00	0.00
其中：基金申购款	0.00	0.00	0.00
基金赎回款	0.00	0.00	0.00
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	0.03	0.05	0.08

**6.4.3.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日
活期存款利息收入	79,011.87
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	10,416.55
其他	1,126.18
合计	90,554.60

**6.4.3.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日
卖出股票成交总额	294,466,021.21
减：卖出股票成本总额	286,988,195.22
买卖股票差价收入	7,477,825.99

**6.4.3.13 债券投资收益****6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25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	-8,304,553.73
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	-8,304,553.73

**6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	3,655,325,759.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,600,304,382.48
减：应收利息总额	63,325,931.02

买卖债券差价收入	-8,304,553.73
----------	---------------

#### 6.4.3.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日
股票投资产生的股利收益	370,933.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	370,933.06

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日
1. 交易性金融资产	3,920,449.98
——股票投资	-4,080,123.36
——债券投资	8,000,573.34
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,920,449.98

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年5月25日
基金赎回费收入	108,447.70
转换费收入 002644	557.03
合计	109,004.73

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年5月25日
交易所市场交易费用	858,879.08
银行间市场交易费用	14,512.50
合计	873,391.58

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年5月25日
审计费用	43,698.65
信息披露费	119,176.95
其他	600.00
上清所债券托管帐户维护费	9,000.00
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	181,475.60

### 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

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作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

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。

**6.4.9.2 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（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

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****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
光大证券	265,624,884.44	47.08%	86,031,255.95	10.79%

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
光大证券	146,272,985.48	97.56%	-	-

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例



光大证券	521,700,000.00	61.52%	41,300,000.00	2.20%
------	----------------	--------	---------------	-------

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年5月25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	242,053.59	47.08%	54,751.22	28.73%
关联方名称	上年度可比期间 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
光大证券	78,401.26	10.79%	74,696.53	27.11%

#### 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 2018年1月1日至2018年5月25日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	8,123,943.62
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	1,333,122.63	2,295,755.62

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1.20%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 × 1.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年5月25日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	1,353,990.56

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

#### 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

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年5月25日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国光大银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国光大银行	-	10,091,089.18	-	-	-	-

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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之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 2018年1月1日至2018年5月25日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	532,555,348.47	79,011.87	6,369,712.58	1,273,370.11

#### **6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2018 年 5 月 25 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**

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

本基金截至本报告期末未持有暂时停牌的股票。

##### **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，属于中低收益风险特征的基金。本基金通过灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货等工具对冲市场风险，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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（合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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光大银行；定期存款存放在具有基金托管资格的，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2018 年 5 月 25 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	80,161,000.00
A-1 以下	-	-

未评级	33,899,484.80	143,465,960.00
合计	33,899,484.80	223,626,960.00

注：未评级部分为超短期融资券、国债及政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 5 月 25 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	295,350,000.00	1,083,405,000.00
合计	295,350,000.00	1,083,405,000.00

#### 6.4.13.2.3 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 2018 年 5 月 25 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	258,897,000.00
AAA 以下	890,991.30	21,464,441.60
未评级		69,708,000.00
合计	890,991.30	350,069,441.60

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回

需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018年5月25 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	532,555,348.47	-	-	-	532,555,348.47
结算备付金	1,095,360.67	-	-	-	1,095,360.67

存出保证金	165,661.35	-	-	-	165,661.35
交易性金融资产	329,249,484.80	890,991.30	-	-144,396,189.17	474,536,665.27
买入返售金融资产	594,279,000.17	-	-	-	594,279,000.17
应收利息	-	-	-	4,961,851.87	4,961,851.87
应收申购款	-	-	-	98.81	98.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,457,344,855.46	890,991.30	-	-149,358,139.85	1,607,593,986.61
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	15,136,950.01	15,136,950.01
应付管理人报酬	-	-	-	1,358,451.10	1,358,451.10
应付托管费	-	-	-	226,408.50	226,408.50
应付交易费用	-	-	-	205,627.59	205,627.59
应交税费	-	-	-	81,859.31	81,859.31
其他负债	-	-	-	162,875.60	162,875.60
负债总计	-	-	-	17,172,172.11	17,172,172.11
利率敏感度缺口	1,457,344,855.46	890,991.30	-	-132,185,967.74	1,590,421,814.50
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,857,823.62	-	-	-	4,857,823.62
结算备付金	335,325.17	-	-	-	335,325.17
存出保证金	163,842.43	-	-	-	163,842.43
交易性金融资产	1,586,708,960.00	70,392,441.60	-	-163,866,704.95	1,820,968,106.55
买入返售金融资产	78,500,357.75	-	-	-	78,500,357.75
应收证券清算款	-	-	-	17,232,443.40	17,232,443.40
应收利息	-	-	-	19,246,542.13	19,246,542.13
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,670,566,308.97	70,392,441.60	-	-200,345,700.47	1,941,304,451.04
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	190,060,539.51	-	-	-	190,060,539.51
应付赎回款	-	-	-	2,428,778.02	2,428,778.02
应付管理人报酬	-	-	-	1,795,924.01	1,795,924.01
应付托管费	-	-	-	299,320.66	299,320.66
应付交易费用	-	-	-	357,220.95	357,220.95
应付利息	-	-	-	286,546.37	286,546.37
其他负债	-	-	-	315,481.19	315,481.19
负债总计	190,060,539.51	-	-	5,483,271.20	195,543,810.71
利率敏感度缺口	1,480,505,769.46	70,392,441.60	-	-194,862,429.27	1,745,760,640.33

**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（2018 年 5 月 25 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,370,755.56	1,040,000.00
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,370,336.00	-1,040,000.00

**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，采用“自上而下”的策略，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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金风险资产占基金资产的比例不高于 40%；安全资产占基金资产的比例不低于 60%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金持有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 5%。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 2018年5月25日		上年度末 2017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	144,396,189.17	9.08	163,866,704.95	9.39
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	144,396,189.17	9.08	163,866,704.95	9.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2018年5月25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9.08% (2017年12月31日：9.39%)，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 (2017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（转型后）

### 7.3 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	14,226,400.00	13.26
	其中：股票	14,226,400.00	13.26
2	固定收益投资	4,169,367.20	3.89
	其中：债券	4,169,367.20	3.89
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	34,000,000.00	31.69
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	54,539,992.10	50.84
7	其他各项资产	348,121.81	0.32
8	合计	107,283,881.11	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,505,100.00	11.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	438,000.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	2,977,900.00	3.23

	业		
J	金融业		-
K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业		-
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业	305,400.00	0.33
S	综合		-
	合计	14,226,400.00	15.45

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.2.3 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	000333	美的集团	30,000	1,566,600.00	1.70
2	300170	汉得信息	80,000	1,299,200.00	1.41
3	000538	云南白药	10,000	1,069,600.00	1.16
4	002456	欧菲科技	50,000	806,500.00	0.88
5	002008	大族激光	15,000	797,850.00	0.87
6	600332	白云山	20,000	761,000.00	0.83
7	002415	海康威视	20,000	742,600.00	0.81
8	300059	东方财富	50,000	659,000.00	0.72
9	600809	山西汾酒	10,000	628,900.00	0.68
10	000938	紫光股份	10,000	626,000.00	0.68
11	300661	圣邦股份	5,000	615,750.00	0.67
12	600570	恒生电子	10,000	529,500.00	0.57
13	600535	天士力	20,000	516,400.00	0.56
14	600588	用友网络	20,000	490,200.00	0.53
15	000651	格力电器	10,000	471,500.00	0.51
16	603019	中科曙光	10,000	458,700.00	0.50
17	603808	歌力思	20,000	450,200.00	0.49
18	002419	天虹股份	30,000	438,000.00	0.48

19	600690	青岛海尔	20,000	385,200.00	0.42
20	300251	光线传媒	30,000	305,400.00	0.33
21	000568	泸州老窖	5,000	304,300.00	0.33
22	000858	五粮液	4,000	304,000.00	0.33

### 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000538	云南白药	24,522,462.43	26.62
2	000938	紫光股份	12,502,786.08	13.57
3	002146	荣盛发展	9,463,136.00	10.27
4	002439	启明星辰	9,268,523.00	10.06
5	300058	蓝色光标	9,265,828.00	10.06
6	000776	广发证券	8,560,916.00	9.29
7	600518	康美药业	8,054,213.33	8.74
8	600340	华夏幸福	7,927,668.00	8.61
9	000977	浪潮信息	7,572,864.00	8.22
10	600030	中信证券	7,514,634.00	8.16
11	300170	汉得信息	7,220,219.21	7.84
12	601688	华泰证券	7,134,041.00	7.75
13	600999	招商证券	7,070,341.83	7.68
14	601668	中国建筑	6,038,400.00	6.56
15	600581	八一钢铁	5,928,029.35	6.44
16	603019	中科曙光	5,751,672.89	6.24
17	300024	机器人	5,498,533.20	5.97
18	600048	保利地产	5,147,873.83	5.59
19	002456	欧菲科技	5,128,325.75	5.57
20	002415	海康威视	5,053,531.00	5.49
21	002475	立讯精密	4,793,322.00	5.20
22	600801	华新水泥	4,791,774.69	5.20
23	600332	白云山	4,705,951.00	5.11
24	000069	华侨城A	4,538,747.12	4.93

25	000960	锡业股份	4,418,042.00	4.80
26	600028	中国石化	4,262,114.00	4.63
27	002901	大博医疗	4,142,422.00	4.50
28	002279	久其软件	4,141,120.96	4.50
29	300271	华宇软件	4,123,095.03	4.48
30	002294	信立泰	3,999,223.00	4.34
31	603808	歌力思	3,889,291.30	4.22
32	601166	兴业银行	3,726,239.00	4.05
33	600085	同仁堂	3,630,132.00	3.94
34	002343	慈文传媒	3,554,044.86	3.86
35	600446	金证股份	3,453,600.00	3.75
36	600977	中国电影	3,400,545.00	3.69
37	300059	东方财富	3,315,314.12	3.60
38	600383	金地集团	3,312,376.00	3.60
39	600585	海螺水泥	3,273,828.00	3.55
40	002555	三七互娱	3,076,459.00	3.34
41	002236	大华股份	2,914,647.63	3.16
42	300433	蓝思科技	2,838,198.33	3.08
43	300633	开立医疗	2,751,814.71	2.99
44	600111	北方稀土	2,627,875.00	2.85
45	000333	美的集团	2,601,374.00	2.82
46	600690	青岛海尔	2,585,216.00	2.81
47	601857	中国石油	2,580,117.00	2.80
48	300188	美亚柏科	2,448,040.00	2.66
49	600837	海通证券	2,346,908.00	2.55
50	600498	烽火通信	2,257,653.17	2.45
51	300498	温氏股份	2,173,968.00	2.36
52	000933	神火股份	2,081,000.00	2.26
53	000786	北新建材	1,941,600.00	2.11
54	600809	山西汾酒	1,872,871.00	2.03
55	300253	卫宁健康	1,849,066.14	2.01

### 7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000538	云南白药	19,985,042.50	21.70
2	300059	东方财富	11,227,895.81	12.19
3	600570	恒生电子	10,524,821.49	11.43
4	000938	紫光股份	9,504,560.10	10.32
5	600588	用友网络	8,452,200.54	9.18
6	002439	启明星辰	7,496,308.90	8.14
7	000977	浪潮信息	6,331,133.20	6.87
8	300251	光线传媒	5,765,474.80	6.26
9	603496	恒为科技	5,760,679.20	6.25
10	600518	康美药业	4,959,078.00	5.38
11	300170	汉得信息	4,905,681.00	5.33
12	603019	中科曙光	4,837,447.70	5.25
13	300133	华策影视	4,820,030.12	5.23
14	300027	华谊兄弟	4,772,293.12	5.18
15	300024	机器人	4,406,718.80	4.78
16	600332	白云山	4,304,138.00	4.67
17	002294	信立泰	4,056,948.00	4.40
18	002901	大博医疗	3,769,891.00	4.09
19	000960	锡业股份	3,327,373.33	3.61
20	300271	华宇软件	3,212,292.00	3.49
21	002279	久其软件	3,114,844.80	3.38
22	600446	金证股份	2,658,198.00	2.89
23	300188	美亚柏科	2,128,753.00	2.31
24	300496	中科创达	2,117,750.54	2.30

### 7.3.3 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	25,784,190.69
卖出股票收入（成交）总额	154,219,154.80

### 7.4 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	3,872,387.20	4.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	296,980.00	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,169,367.20	4.53

## 7.5 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	019571	17 国债 17	38,720	3,872,387.20	4.20
2	132012	17 巨化 EB	3,100	296,980.00	0.32

## 7.6 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投资。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1 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	220,394.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	127,627.36
5	应收申购款	99.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	348,121.81

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.10.4 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。



## §7 投资组合报告（转型前）

### 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	144,396,189.17	8.98
	其中：股票	144,396,189.17	8.98
2	固定收益投资	330,140,476.10	20.54
	其中：债券	330,140,476.10	20.54
	资产支持证券	0.00	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	594,279,000.17	36.97
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	533,650,709.14	33.20
7	其他资产	5,127,612.03	0.32
8	合计	1,607,593,986.61	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,763,637.75	4.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,786,822.04	3.51
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	527,746.38	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,317,983.00	0.96
S	综合	-	-
	合计	144,396,189.17	9.08

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股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	180,017	21,054,788.32	1.32
2	300059	东方财富	805,196	11,417,679.28	0.72
3	600570	恒生电子	173,732	10,926,005.48	0.69
4	000938	紫光股份	138,200	9,734,808.00	0.61
5	600588	用友网络	303,220	7,865,526.80	0.49
6	002439	启明星辰	276,300	6,703,038.00	0.42
7	000977	浪潮信息	276,400	6,453,940.00	0.41
8	300251	光线传媒	527,900	5,664,367.00	0.36
9	603496	恒为科技	152,442	5,556,510.90	0.35
10	603019	中科曙光	104,900	5,002,681.00	0.31
11	300133	华策影视	433,140	4,829,511.00	0.30
12	300027	华谊兄弟	557,700	4,824,105.00	0.30
13	300024	机器人	230,200	4,500,410.00	0.28
14	600332	白云山	100,000	4,283,000.00	0.27
15	002294	信立泰	92,400	4,136,748.00	0.26
16	300170	汉得信息	276,400	4,134,944.00	0.26
17	002901	大博医疗	92,200	3,907,436.00	0.25
18	600518	康美药业	134,400	3,682,560.00	0.23
19	300271	华宇软件	184,300	3,223,407.00	0.20

20	002279	久其软件	276,300	3,216,132.00	0.20
21	000960	锡业股份	213,603	3,065,203.05	0.19
22	600446	金证股份	184,200	2,728,002.00	0.17
23	300496	中科创达	69,900	2,394,774.00	0.15
24	300188	美亚柏科	117,920	2,063,600.00	0.13
25	600085	同仁堂	30,000	1,233,300.00	0.08
26	300253	卫宁健康	74,800	978,384.00	0.06
27	603259	药明康德	4,741	508,993.76	0.03
28	300454	深信服	1,604	135,329.48	0.01
29	603013	亚普股份	2,573	125,768.24	0.01
30	300745	欣锐科技	1,304	26,484.24	0.00
31	300746	汉嘉设计	2,318	18,752.62	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	000538	云南白药	23,455,138.43	1.34
2	000938	紫光股份	11,878,312.08	0.68
3	002146	荣盛发展	9,463,136.00	0.54
4	300058	蓝色光标	9,265,828.00	0.53
5	000776	广发证券	8,560,916.00	0.49
6	002439	启明星辰	8,320,996.00	0.48
7	600518	康美药业	8,054,213.33	0.46
8	600340	华夏幸福	7,927,668.00	0.45
9	000977	浪潮信息	7,572,864.00	0.43
10	600030	中信证券	7,514,634.00	0.43
11	601688	华泰证券	7,134,041.00	0.41
12	600999	招商证券	7,070,341.83	0.41
13	601668	中国建筑	6,038,400.00	0.35
14	600581	八一钢铁	5,928,029.35	0.34
15	300024	机器人	5,498,533.20	0.31
16	603019	中科曙光	5,301,718.00	0.30
17	300170	汉得信息	5,154,927.00	0.30

18	600048	保利地产	5,147,873.83	0.29
19	002475	立讯精密	4,793,322.00	0.27
20	600801	华新水泥	4,791,774.69	0.27

#### 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	000538	云南白药	20,126,924.66	1.15
2	600436	片仔癀	13,763,261.65	0.79
3	601336	新华保险	12,253,165.24	0.70
4	002415	海康威视	10,310,976.71	0.59
5	002146	荣盛发展	8,807,122.00	0.50
6	000776	广发证券	8,259,195.54	0.47
7	300058	蓝色光标	8,045,693.00	0.46
8	300059	东方财富	7,900,098.42	0.45
9	600340	华夏幸福	7,610,633.20	0.44
10	600030	中信证券	7,419,245.22	0.42
11	601688	华泰证券	6,946,363.84	0.40
12	002294	信立泰	6,784,944.00	0.39
13	300633	开立医疗	6,408,948.00	0.37
14	600999	招商证券	6,333,379.00	0.36
15	603993	洛阳钼业	6,245,032.11	0.36
16	002555	三七互娱	5,878,839.94	0.34
17	600332	白云山	5,810,183.00	0.33
18	600581	八一钢铁	5,710,135.00	0.33
19	601668	中国建筑	5,511,842.00	0.32
20	000069	华侨城A	4,866,520.42	0.28

#### 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	271,597,802.80
卖出股票收入（成交）总额	294,466,021.21

## 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	3,875,484.80	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,024,000.00	1.89
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	890,991.30	0.06
8	同业存单	295,350,000.00	18.57
9	其他	-	-
10	合计	330,140,476.10	20.76

## 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	111811061	18 平安银行 CD061	2,000,000	197,740,000.00	12.43
2	111711507	17 平安银行 CD507	1,000,000	97,610,000.00	6.14
3	011800692	18 深能源 SCP004	300,000	30,024,000.00	1.89
4	019571	17 国债 17	38,720	3,875,484.80	0.24
5	123006	东财转债	4,610	578,232.30	0.04

## 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投资。

## 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

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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	165,661.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,961,851.87
5	应收申购款	98.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,127,612.03

### **7.12.2 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。

### **7.12.3 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（转型后）

### 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
大成景荣债券 A	1,304	68,613.75	-	0.00%	89,472,333.73	100.00%
大成景荣债券 C	1	1.80	-	0.00%	1.80	100.00%
合计	1,305	68,561.18	-	0.00%	89,472,335.53	100.00%

### 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	大成景荣债券 A	10.96	0.0000%
	大成景荣债券 C	1.80	100.0000%
	合计	12.76	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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	大成景荣债券 A	0
	大成景荣债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景荣债券 A	0
	大成景荣债券 C	0
	合计	0





## §8 基金份额持有人信息（转型前）

### 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
大成景荣保本混合 A	4,850	314,731.85	910,241,000.00	59.63%	616,208,478.90	40.37%
大成景荣保本混合 C	1	1.80	0.00	0.00%	1.80	100.00%
合计	4,851	314,666.97	910,241,000.00	59.63%	616,208,480.70	40.37%

### 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	大成景荣保本混合 A	10.96	0.0000%
	大成景荣保本混合 C	1.80	100.0000%
	合计	12.76	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成景荣保本混合 A	0
	大成景荣保本混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	大成景荣保本混合 A	0
	大成景荣保本混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	大成景荣债券 A	大成景荣债券 C
基金合同生效日基金份额总额	1,526,449,478.90	1.80
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	26,130.09	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,437,003,275.26	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	89,472,333.73	1.80

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	大成景荣保本混合 A	大成景荣保本混合 C
基金合同生效日基金份额总额	2,199,514,129.48	30,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,697,972,357.16	1.80
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	80,718.10	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	171,603,596.36	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,526,449,478.90	1.80

## §10 重大事件揭示

### 10.5 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。

### 10.6 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

无。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2018 年 5 月 7 日，中国光大银行股份有限公司聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务。

### 10.7 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。

### 10.8 基金投资策略的改变

大成景荣债券型证券投资基金是根据原大成景荣保本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合同》的约定，由大成景荣保本混合型证券投资基金转型而来。转型前基金投资策略见 2.2 基金产品说明（转型前）；转型后基金投资策略见 2.2 基金产品说明（转型后）。

### 10.9 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。

### 10.10 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.11 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

## 10.11.1 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	
招商证券		193,666,623.52	52.04%	85,359.73	52.04%	-
光大证券		157,266,428.52	31.81%	52,185.36	31.81%	-
中信建投		129,070,293.45	16.15%	26,492.24	16.15%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-

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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内新增交易单元：无。本报告期内退租交易单元：无。

## 10.11.2 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
招商证券	558,278.68	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	211,600,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
光大证券	1	265,624,884.44	47.08%	242,053.59	47.08%	-
中信建投	1	118,824,538.29	21.06%	108,284.91	21.06%	-
中银国际	1	68,483,093.68	12.14%	62,411.17	12.14%	-
招商证券	1	66,719,387.15	11.83%	60,807.78	11.83%	-
财达证券	1	44,461,197.93	7.88%	40,515.73	7.88%	-
金元证券	1	48,267.43	0.01%	44.01	0.01%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内新增交易单元：无。本报告期内退租交易单元：无。

### 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
光大证券	146,272,985.48	97.56%	521,700,000.00	61.52%	-	-
中信建投	-	-	5,000,000.00	0.59%	-	-
中银国际	3,657,122.80	2.44%	87,800,000.00	10.35%	-	-
招商证券	-	-	192,900,000.00	22.75%	-	-
财达证券	-	-	31,431,000.00	3.71%	-	-
金元证券	-	-	9,200,000.00	1.08%	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月22日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月16日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月9日

**10.9 其他重大事件（转型前）**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成景荣保本混合型证券投资基金保本周期到期转型为大成景荣债券型证券投资基金的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 24 日
2	关于大成景荣债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 24 日
3	关于大成景荣保本混合型证券投资基金保本周期到期转型为大成景荣债券型证券投资基金的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 23 日
4	大成景荣债券型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 22 日
5	大成景荣债券型证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 22 日
6	大成景荣债券型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 22 日
7	大成景荣债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 22 日
8	关于大成景荣保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景荣债券型证券投资基金后相关业务规则的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 22 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 17 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 5 月 4 日
11	大成景荣保本混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 20 日
12	关于大成基金管理有限公司南京分公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 3 日
13	大成景荣保本混合型证券投资基金 2017 年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 31 日
14	《大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
15	大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
16	大成景荣保本混合型证券投资	中国证监会指定报	2018 年 3 月 27 日

	基金托管协议	刊及本公司网站	
17	关于调整公司旗下证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
18	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开通直销平台基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 10 日
20	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	2018 年 1 月 30 日
21	大成景荣保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 20 日
22	大成景荣保本混合型证券投资基金更新招募说明书（2017 年 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 9 日
23	大成景荣保本混合型证券投资基金更新招募说明书-摘要（2017 年 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 9 日
24	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 5 日

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180527	900,242,000.00	-	900,242,000.00	-	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

2、基金管理人于 2018 年 5 月 22 日发布了《关于大成景荣保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景荣债券型证券投资基金后相关业务规则的公告》，大成景荣保本混合型证券投资基金保本周期于 2018 年 5 月 25 日到期，随后转型为大成景荣债券型证券投资基金，《大成景荣债券型证券投资基金基金合同》及《大成景荣债券型证券投资基金托管协议》自 2018 年 5 月 26 日起生效，具体详见相关公告。

## §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荣保本混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景荣保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景荣保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《关于大成景荣保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景荣债券型证券投资基金后相关业务规则的公告》；
- 5、《大成景荣债券型证券投资基金基金合同》；
- 6、《大成景荣债券型证券投资基金托管协议》；
- 7、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 8、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。

大成基金管理有限公司

2018 年 8 月 29 日