

大成睿景灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 29 日

重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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。

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

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

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 | |
| 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 | 1,401,540,577.80 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 | 901,004,696.19 份 | 500,535,881.61 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 | 赵冰 | 崔瑞娟 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 020-66338888 |

| | | | |
|--|--------|----------------------|-----------------|
| | 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 | 2.4 | 2.4 |
| | 2.4 | 2.4 | 2.4 |
| | 2.4 | 2.4 | 2.4 |
| | 2.4 | 2.4 | 2.4 |

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018 年 | | 2017 年 | | 2016 年 | |
|---------------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| | 大成睿景灵活配置混合 A | 大成睿景灵活配置混合 C | 大成睿景灵活配置混合 A | 大成睿景灵活配置混合 C | 大成睿景灵活配置混合 A | 大成睿景灵活配置混合 C |
| 本期已实现收益 | -118,531,190.24 | -65,703,163.60 | -11,461,784.20 | -8,832,076.35 | -60,042,460.58 | -37,207,490.13 |
| 本期利润 | -213,728,218.00 | -116,156,755.14 | -79,033,855.21 | -36,923,369.83 | -207,318,961.65 | -114,032,491.60 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2247 | -0.2231 | 0.0582 | 0.0547 | -0.1108 | -0.1337 |
| 本期基金份额净值增长率 | -28.88% | -29.42% | 9.08% | 8.09% | -14.17% | -14.85% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末 | | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| 期末可供 | -0.4565 | -0.4741 | -0.3277 | -0.3435 | -0.3213 | -0.3313 |

| | | | | | | |
|----------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|----------------|
| 分配基金份额利润 | | | | | | |
| 期末基金资产净值 | 507,966,389.95 | 273,875,518.46 | 839,960,187.24 | 453,212,293.46 | 1,185,750,688.01 | 542,496,907.28 |
| 期末基金份额净值 | 0.564 | 0.547 | 0.793 | 0.775 | 0.727 | 0.717 |

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -5.69% | 1.61% | -6.92% | 1.10% | 1.23% | 0.51% |
| 过去六个月 | -17.30% | 1.44% | -10.82% | 0.94% | -6.48% | 0.50% |
| 过去一年 | -28.88% | 1.38% | -18.50% | 0.90% | -10.38% | 0.48% |
| 过去三年 | -33.41% | 1.37% | -26.02% | 0.90% | -7.39% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | -43.60% | 1.48% | -34.80% | 1.16% | -8.80% | 0.32% |

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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -6.01% | 1.63% | -6.92% | 1.10% | 0.91% | 0.53% |
| 过去六个月 | -17.62% | 1.45% | -10.82% | 0.94% | -6.80% | 0.51% |
| 过去一年 | -29.42% | 1.39% | -18.50% | 0.90% | -10.92% | 0.49% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年 | -35.04% | 1.37% | -26.02% | 0.90% | -9.02% | 0.47% |
| 自基金合同 生效起至今 | -45.30% | 1.49% | -34.80% | 1.16% | -10.50% | 0.33% |

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

大成睿景灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



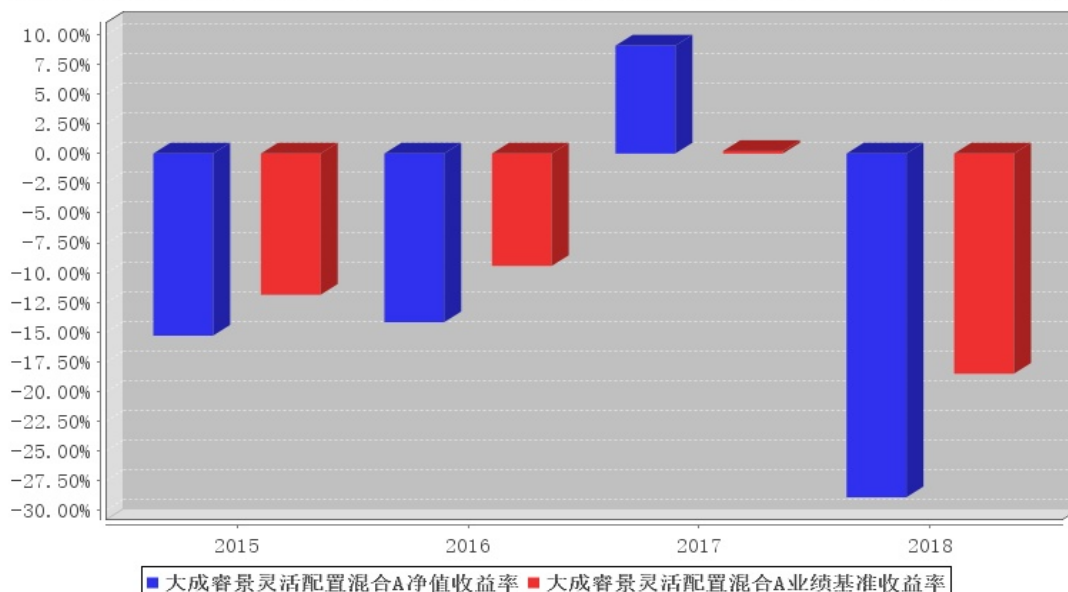
大成睿景灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



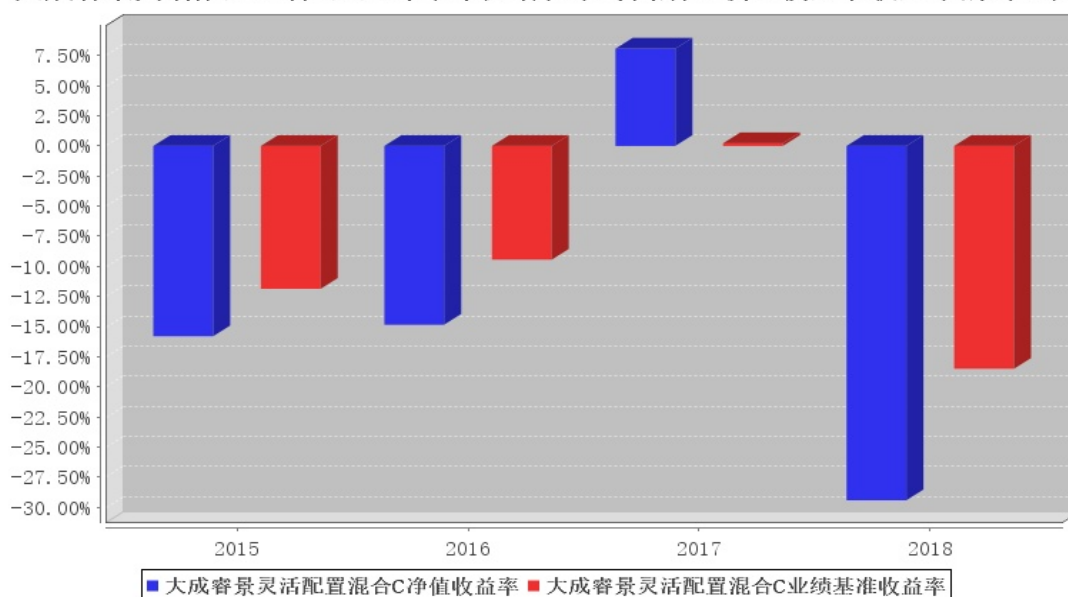
注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

大成睿景灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成睿景灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII以及QFLP等资格。

历经二十年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至2018年12月31日，公司管理公募基金产品数量共81只。

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 | 本基金基金经理，股票投资部总监 | 2015年9月18日 | - | 17 | 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，曾担任研究部高级研究员、行业研究主管，现任股票投资部总监。2012年9月4日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理（更名前 |

| | | | | | |
|-----|-----------|-----------------|---|---|---|
| | | | | | <p>为大成内需增长股票型证券投资基金)。</p> <p>2014 年 4 月 16 日至 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(更名前为大成消费主题股票型证券投资基金)。</p> <p>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，</p> <p>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。</p> <p>2016 年 9 月 13 日至 2018 年 9 月 26 日任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 9 月 12 日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 20 日起担任大成盛世精选灵活配置混合证券投资基金基金经理。</p> <p>2018 年 9 月 7 日起担任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基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p> |
| 谢家乐 | 本基金基金经理助理 | 2017 年 2 月 20 日 | - | 6 | <p>工学硕士。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。</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 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 |
|--|--|--|--|--|---|

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交

易存在 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 3 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

回顾 2018 年，经济和股票市场的困难程度是年初很难预计的。主要表现在以下方面：社融和货币增速创历史新低。2018 年以来随着非标融资受限叠加经济周期下行，社融增量大幅下滑，社融增速、M1、M2 增速均创历史新低。2018 年广义流动性明显收缩，在非标萎缩以及银行理财增长放缓的情况下，老口径社融的增量明显低于 2017 年，导致企业流动性大幅收缩。也导致 A 股市场估值中枢在 2018 年大幅调低。房地产融资量和融资占比创新高，房地产挤出其他消费和其他投资。房地产和非房地产经济的关系从过去的共振效应转变为挤出效应。2018 年广义流动性蛋糕明显收缩，但房地产无论是销售端还是投资端来看，其实都很好，居民加杠杆买房的需求和开发商融资拿地的需求都处于历史高峰，导致房地产相关的融资需求占社融的比例升至 60%，创历史新高。房地产切到了太大的蛋糕之后，其实就是在挤占其他行业的蛋糕。这导致汽车等其他可选消费属性的板块受到很大股价冲击。中美贸易摩擦持续压制经济和金融市场情绪。中美贸易摩擦发酵之后，由于出口抢运等因素，中国对美顺差反而逆势上升，然而，由于中国进口转向其他新兴市场以及资源型国家，对新兴市场的顺差大幅收窄至 0 附近，因此今年我国经常账户顺差降至近 10 年来的低点。3 月受贸易摩擦影响，标普 500 一度下调近 7%；在两次关税落地时点，A 股大幅下跌。金融监管政策转向最快的一年。18 年初，资管新规以及系列防范金融风险具体措施逐步落地，市场普遍认为 2018 年仍然会持续双紧的局面，市场情绪悲观。但在经济下行压力明显的情况下，年中的国常会从顶层设计层面及时调整，提出六个稳作为短期任务要求，作为“三大攻坚战”的中期目标的重要补充。随后便是金融监管和货币政策有所转向，从史无前例的“双紧”迅速有所调整，使得 2018 成为政策转向最快的一年。全球央行流动性迎来拐点，全球以美元计价大类资产全部下跌。全球三大央行同时收缩流动性，全球流动性迎来拐点，直接影响到全球大类资产表现。过去各类资产的高额回报，都是来自央行向市场投放的流动性。一旦央行开始缩表收回流动性、银行开始收缩流动性投放，除了会推动利率上行外，也会对风险资产施压。所以 18 年看到以美元计价的大类资产全部下跌。

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 的基金份额净值为 0.564 元，本报告期基金份额净值增长率为-28.88%；截至本报告期末大成睿景灵活配置混合 C 的基金份额净值为 0.547 元，本报告期基金份额净值增长率为-29.42%；同期业绩比较基准收益率为-18.50%。

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 2019 年，中国 2019 年增长在国际周期及国内因素共同作用下可能继续下行。虽然 2018 年下半年至今市场预期已经在调低，但考虑到增长下行风险仍未体现充分，2019 年 A 股市场仍可能承受一定压力。中国市场盈利增长可能下滑至零附近。我们预计中国股票市场在 2017/2018 实现一定的业绩增长之后，受上游行业高基数及中下游行业需求放缓、利润率缩窄等因素影响，2019 年盈利将无实质性增长。A 股可能迎来低振幅一年。2018 年市场“杀估值”进行得较为充分，但 2019 年盈利难以提供较强支持。在流动性相对宽松但增长有压力的背景下，市场整体估值可能上下两难。股指振幅相比 2018 年将明显缩小，预计上证指数 2019 年度高点低点振幅将在 600 点左右或以内。A 股市场成长风格赢价值风格。在增长相对低迷的环境中仍能够实现一定增长或者有增长预期支持的板块将获得市场追捧。消费、科技、医药、教育、文化与服务、军工等可能仍是寻找成长机会的领域，这些板块里可能有 2019 年表现相对居前的板块。

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、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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 2018 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 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计, 注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容, 应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 249,577,735.92 | 118,222,960.65 |
| 结算备付金 | 2,012,707.41 | 1,124,091.82 |
| 存出保证金 | 1,679,136.70 | 1,118,118.88 |
| 交易性金融资产 | 571,420,777.04 | 1,168,848,292.72 |
| 其中：股票投资 | 569,394,577.04 | 1,168,848,292.72 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 2,026,200.00 | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 8,771,696.70 |
| 应收利息 | 56,217.17 | 25,848.31 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 23,577.08 | 56,066.58 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 824,770,151.32 | 1,298,167,075.66 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 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 | 39,608,214.57 | - |
| 应付赎回款 | 331,925.05 | 1,551,569.83 |
| 应付管理人报酬 | 1,024,541.78 | 1,634,081.45 |
| 应付托管费 | 170,756.96 | 272,346.90 |
| 应付销售服务费 | 190,622.60 | 305,056.72 |
| 应付交易费用 | 1,282,139.57 | 896,540.06 |
| 应交税费 | 13.10 | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 320,029.28 | 335,000.00 |
| 负债合计 | 42,928,242.91 | 4,994,594.96 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,401,540,577.80 | 1,644,063,626.35 |
| 未分配利润 | -619,698,669.39 | -350,891,145.65 |
| 所有者权益合计 | 781,841,908.41 | 1,293,172,480.70 |
| 负债和所有者权益总计 | 824,770,151.32 | 1,298,167,075.66 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，大成睿景灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 0.564 元，大成睿景灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 0.547 元。大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 1,401,540,577.80 份，其中 A 类基金份额 901,004,696.19 份，C 类基金份额 500,535,881.61 份。

7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-------------------|---|--|
| 一、收入 | -301,120,638.65 | 155,586,475.73 |
| 1. 利息收入 | 1,228,146.09 | 2,253,996.84 |
| 其中：存款利息收入 | 1,227,758.10 | 1,786,896.77 |
| 债券利息收入 | 387.99 | - |
| 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） | -156,712,631.13 | 17,030,159.26 |
| 其中：股票投资收益 | -161,977,705.26 | 644,949.89 |

| | | |
|------------------------|-----------------|----------------|
| 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 | 5,265,074.13 | 16,385,209.37 |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -145,650,619.30 | 136,251,085.59 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 14,465.69 | 51,234.04 |
| 减：二、费用 | 28,764,334.49 | 39,629,250.69 |
| 1. 管理人报酬 | 14,995,624.34 | 22,463,535.59 |
| 2. 托管费 | 2,499,270.76 | 3,743,922.58 |
| 3. 销售服务费 | 2,783,300.69 | 3,930,685.79 |
| 4. 交易费用 | 8,047,777.30 | 9,048,246.73 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 税金及附加 | 1.40 | - |
| 7. 其他费用 | 438,360.00 | 442,860.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -329,884,973.14 | 115,957,225.04 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -329,884,973.14 | 115,957,225.04 |

7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | |
|-----------------------------------|--|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,644,063,626.35 | -350,891,145.65 | 1,293,172,480.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -329,884,973.14 | -329,884,973.14 |
| 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） | -242,523,048.55 | 61,077,449.40 | -181,445,599.15 |

| | | | |
|--|----------------------------------|-----------------|------------------|
| 其中：1. 基金申购款 | 37,536,471.26 | -11,676,172.57 | 25,860,298.69 |
| 2. 基金赎回款 | -280,059,519.81 | 72,753,621.97 | -207,305,897.84 |
| 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） | 1,401,540,577.80 | -619,698,669.39 | 781,841,908.41 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 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） | - | 115,957,225.04 | 115,957,225.04 |
| 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） | -743,164,115.62 | 192,131,775.99 | -551,032,339.63 |
| 其中：1. 基金申购款 | 44,133,579.92 | -11,965,974.04 | 32,167,605.88 |
| 2. 基金赎回款 | -787,297,695.54 | 204,097,750.03 | -583,199,945.51 |
| 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） | 1,644,063,626.35 | -350,891,145.65 | 1,293,172,480.70 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.3

| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| 7.4.3 | 7.4.3 | | |
|-------|-------|-------|-------|
| | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | | |
| | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | |
| | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | |
| | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | | |
|-------|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | | | |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3

| | | |
|-------|-------|-------|
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |
| 7.4.3 | 7.4.3 | 7.4.3 |

7.4.3 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 大成基金管理有限公司（“大成基金”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 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（“大成国际”） | 基金管理人的子公司 |
| 大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”） | 基金管理人的合营企业 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月 31日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|-------|---------------------------------|-------------------------|----------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) |
| 广发证券 | 5,260,956,300.15 | 100.00 | 5,878,572,260.30 | 100.00 |

7.4.4.1.2 债券交易

无。

7.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月 31日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|-------|---------------------------------|---------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 广发证券 | - | - | 720,000,000.00 | 100.00 |

7.4.4.1.4 权证交易

无。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 广发证券 | 4,794,257.15 | 100.00 | 1,282,139.57 | 100.00 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 广发证券 | 5,357,239.64 | 100.00 | 896,540.06 | 100.00 |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 14,995,624.34 | 22,463,535.59 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,439,582.06 | 9,634,251.26 |

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 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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,499,270.76 | 3,743,922.58 |

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。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------------------|--------------|--------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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 | 大成睿景灵活配置混合 | 合计 |
| | A | C | |
| 大成基金 | - | 34,884.03 | 34,884.03 |
| 光大证券 | - | 816.38 | 816.38 |
| 广发证券 | - | 1,983,745.44 | 1,983,745.44 |

| 合计 | - | 2,019,445.85 | 2,019,445.85 |
|----------------|----------------------------------|-----------------|--------------|
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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 | - | 45,743.28 | 45,743.28 |
| 光大证券 | - | 1,029.52 | 1,029.52 |
| 广发证券 | - | 2,783,702.30 | 2,783,702.30 |
| 合计 | - | 2,830,475.10 | 2,830,475.10 |

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 0.80% 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：

C 类基金日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|------------|--------|--------|--------|--------------|---------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 601138 | 工业富联 | 2018-05-28 | 2019-06-10 | 新股流通受限 | 13.77 | 10.97 | 820,245 | 11,294,773.65 | 8,998,087.65 | - |
| 601860 | 紫金银行 | 2018-12-20 | 2019-01-03 | 新股流通受限 | 3.14 | 3.14 | 15,970 | 50,145.80 | 50,145.80 | - |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 128051 | 光华转债 | 2018年12月14日 | 2019-01-09 | 新债流通受限 | 100.00 | 100.00 | 20,262 | 2,026,200.00 | 2,026,200.00 | - |

注：基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§ 8

| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |

| | | | | | |
|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |

§ 8

| § 8 | § 8 | | § 8 | |
|-----|-----|-----|-----|-----|
| | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |

§ 8

| | | | |
|-----|-----|-----|-----|
| § 8 | § 8 | | |
| | § 8 | § 8 | |
| § 8 | | § 8 | § 8 |
| § 8 | § 8 | § 8 | § 8 |

| | | |
|-----|-----|-----|
| § 8 | § 8 | § 8 |
|-----|-----|-----|

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 569,394,577.04 | 69.04 |
| | 其中：股票 | 569,394,577.04 | 69.04 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,026,200.00 | 0.25 |
| | 其中：债券 | 2,026,200.00 | 0.25 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 251,590,443.33 | 30.50 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,758,930.95 | 0.21 |
| 9 | 合计 | 824,770,151.32 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 360,962,551.19 | 46.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 60,727.90 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 20,759,358.70 | 2.66 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,760,417.93 | 1.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 43,024,826.50 | 5.50 |
| J | 金融业 | 27,185,715.80 | 3.48 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 75,807,727.02 | 9.70 |
| 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 | 32,833,252.00 | 4.20 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 569,394,577.04 | 72.83 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 300001 | 特锐德 | 3,639,321 | 63,797,297.13 | 8.16 |
| 2 | 000002 | 万科A | 2,158,290 | 51,410,467.80 | 6.58 |
| 3 | 002741 | 光华科技 | 3,041,840 | 48,213,164.00 | 6.17 |
| 4 | 300420 | 五洋停车 | 8,132,251 | 40,498,609.98 | 5.18 |
| 5 | 300199 | 翰宇药业 | 3,505,665 | 32,742,911.10 | 4.19 |
| 6 | 300144 | 宋城演艺 | 1,360,800 | 29,053,080.00 | 3.72 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 483,700 | 27,135,570.00 | 3.47 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 2,069,318 | 24,397,259.22 | 3.12 |
| 9 | 002421 | 达实智能 | 6,170,100 | 24,186,792.00 | 3.09 |
| 10 | 300601 | 康泰生物 | 652,284 | 23,338,721.52 | 2.99 |

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 600029 | 南方航空 | 94,613,754.93 | 7.32 |
| 2 | 601111 | 中国国航 | 93,628,551.08 | 7.24 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 3 | 601398 | 工商银行 | 92,326,603.98 | 7.14 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 86,464,768.88 | 6.69 |
| 5 | 600115 | 东方航空 | 76,080,595.78 | 5.88 |
| 6 | 000960 | 锡业股份 | 75,160,343.90 | 5.81 |
| 7 | 000002 | 万科A | 72,693,877.25 | 5.62 |
| 8 | 300319 | 麦捷科技 | 67,224,195.71 | 5.20 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 60,675,773.72 | 4.69 |
| 10 | 300601 | 康泰生物 | 60,369,608.03 | 4.67 |
| 11 | 300001 | 特锐德 | 60,321,600.56 | 4.66 |
| 12 | 300377 | 赢时胜 | 59,405,248.33 | 4.59 |
| 13 | 600570 | 恒生电子 | 58,103,206.98 | 4.49 |
| 14 | 002741 | 光华科技 | 55,692,332.29 | 4.31 |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗 | 47,573,822.98 | 3.68 |
| 16 | 603978 | 深圳新星 | 45,692,200.89 | 3.53 |
| 17 | 300420 | 五洋停车 | 43,743,516.76 | 3.38 |
| 18 | 601288 | 农业银行 | 39,071,247.49 | 3.02 |
| 19 | 002439 | 启明星辰 | 38,405,054.98 | 2.97 |
| 20 | 300144 | 宋城演艺 | 37,656,412.83 | 2.91 |
| 21 | 300199 | 翰宇药业 | 37,413,134.70 | 2.89 |
| 22 | 300059 | 东方财富 | 36,298,449.60 | 2.81 |
| 23 | 300322 | 硕贝德 | 35,416,030.02 | 2.74 |
| 24 | 002669 | 康达新材 | 34,925,895.69 | 2.70 |
| 25 | 000661 | 长春高新 | 34,898,300.82 | 2.70 |
| 26 | 601888 | 中国国旅 | 34,699,107.96 | 2.68 |
| 27 | 002421 | 达实智能 | 32,107,865.26 | 2.48 |
| 28 | 600702 | 舍得酒业 | 30,149,492.44 | 2.33 |
| 29 | 600588 | 用友网络 | 30,075,951.52 | 2.33 |
| 30 | 600028 | 中国石化 | 29,723,079.00 | 2.30 |
| 31 | 600026 | 中远海能 | 27,853,859.00 | 2.15 |

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 600477 | 杭萧钢构 | 86,196,203.93 | 6.67 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 84,253,430.76 | 6.52 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 79,211,381.24 | 6.13 |
| 4 | 600029 | 南方航空 | 72,185,424.94 | 5.58 |
| 5 | 600985 | 淮北矿业 | 68,814,628.52 | 5.32 |
| 6 | 601111 | 中国国航 | 68,534,804.74 | 5.30 |
| 7 | 601939 | 建设银行 | 67,475,672.37 | 5.22 |
| 8 | 600115 | 东方航空 | 62,542,071.32 | 4.84 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9 | 600570 | 恒生电子 | 60,120,432.02 | 4.65 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 58,114,239.76 | 4.49 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 57,995,548.71 | 4.48 |
| 12 | 300377 | 赢时胜 | 52,516,156.01 | 4.06 |
| 13 | 000960 | 锡业股份 | 50,701,976.11 | 3.92 |
| 14 | 000786 | 北新建材 | 50,654,184.74 | 3.92 |
| 15 | 600196 | 复星医药 | 49,468,720.16 | 3.83 |
| 16 | 601766 | 中国中车 | 49,271,382.00 | 3.81 |
| 17 | 300760 | 迈瑞医疗 | 49,054,936.28 | 3.79 |
| 18 | 000402 | 金融街 | 47,452,248.92 | 3.67 |
| 19 | 002430 | 杭氧股份 | 46,883,764.25 | 3.63 |
| 20 | 002244 | 滨江集团 | 45,861,303.92 | 3.55 |
| 21 | 300319 | 麦捷科技 | 44,178,255.04 | 3.42 |
| 22 | 603008 | 喜临门 | 42,349,246.24 | 3.27 |
| 23 | 002439 | 启明星辰 | 41,334,431.68 | 3.20 |
| 24 | 600872 | 中炬高新 | 39,662,507.06 | 3.07 |
| 25 | 601288 | 农业银行 | 39,241,605.00 | 3.03 |
| 26 | 300059 | 东方财富 | 37,867,667.40 | 2.93 |
| 27 | 601888 | 中国国旅 | 33,207,902.60 | 2.57 |
| 28 | 600584 | 长电科技 | 32,821,059.36 | 2.54 |
| 29 | 002050 | 三花智控 | 32,755,904.64 | 2.53 |
| 30 | 600048 | 保利地产 | 32,208,448.39 | 2.49 |
| 31 | 300601 | 康泰生物 | 32,119,004.50 | 2.48 |
| 32 | 601336 | 新华保险 | 30,405,158.17 | 2.35 |
| 33 | 002008 | 大族激光 | 30,242,387.08 | 2.34 |
| 34 | 600588 | 用友网络 | 30,210,016.23 | 2.34 |
| 35 | 603978 | 深圳新星 | 29,525,395.17 | 2.28 |
| 36 | 002027 | 分众传媒 | 29,393,168.55 | 2.27 |
| 37 | 600026 | 中远海能 | 28,848,936.69 | 2.23 |
| 38 | 000001 | 平安银行 | 27,324,537.01 | 2.11 |
| 39 | 600028 | 中国石化 | 26,866,404.25 | 2.08 |
| 40 | 002517 | 恺英网络 | 26,404,202.08 | 2.04 |

注:本期累计卖出金额指卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本(成交)总额 | 2,494,701,536.36 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 2,786,526,927.48 |

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 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） | 2,026,200.00 | 0.26 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,026,200.00 | 0.26 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 128051 | 光华转债 | 20,262 | 2,026,200.00 | 0.26 |

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

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

无。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,679,136.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 56,217.17 |
| 5 | 应收申购款 | 23,577.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,758,930.95 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|----------|-----------|--------------|------------|------------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 大成睿景灵活配置混合 A | 14,540 | 61,967.31 | 0.00 | 0.00 | 901,004,696.19 | 100.00 |
| 大成睿景灵活配置混合 C | 8,447 | 59,256.05 | 1,284,487.18 | 0.26 | 499,251,394.43 | 99.74 |
| 合计 | 22,987 | 60,971.01 | 1,284,487.18 | 0.09 | 1,400,256,090.62 | 99.91 |

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|--------------|------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 大成睿景灵活配置混合 A | 378,873.90 | 0.0421 |
| | 大成睿景灵活配置混合 C | 25,106.59 | 0.0050 |
| | 合计 | 403,980.49 | 0.0288 |

注：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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 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 |

§ 10 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 | 1,059,645,088.22 | 584,418,538.13 |
| 本报告期基金总申购份额 | 10,205,638.77 | 27,330,832.49 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 168,846,030.80 | 111,213,489.01 |
| 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 | 901,004,696.19 | 500,535,881.61 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 12 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 广发证券 | 2 | 5,260,956,300.15 | 100.00% | 4,794,257.15 | 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,本基金无新增交易单元和退租交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

大成基金管理有限公司

2019 年 03 月 29 日