

大成景恒混合型证券投资基金  
(原大成景恒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。

大成景恒混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）为根据《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型而来。大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期为 3 年，第一个保本周期自 2012 年 6 月 15 日至 2015 年 6 月 15 日，第二个保本周期自 2015 年 6 月 24 日至 2018 年 6 月 25 日（2018 年 6 月 24 日为非工作日）。大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期于 2018 年 6 月 25 日到期，由于在第二个保本周期到期后不再符合保本基金存续条件，按照《大成景恒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股票型基金，基金名称相应变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”。按照《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，变更后的大成景恒稳健增长股票型证券投资基金中“股票资产占基金资产的比例为 60%—95%”，而根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于基金类别的规定，“股票资产占基金资产的比例为 60%—95%”的基金应为混合基金，经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型的基金名称由“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”修改为“大成景恒混合型证券投资基金”，此修改仅为对转型后的基金名称的修改，《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》中其他关于转型后的基金的约定，包括但不限于投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等条款均不因此改变。

大成景恒保本混合型证券投资基金的第二个保本周期到期期间为保本周期到期日，即 2018 年 6 月 25 日。自 2018 年 6 月 26 日起，大成景恒保本混合型证券投资基金正式转型为大成景恒混合型证券投资基金，转型后的《大成景恒混合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 6 月 26 日原大成景恒保本混合型证券投资基金名称变更为大成景恒混合型证券投资基金。原大成景恒保本混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 25 日止，大成景恒混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 6 月 26 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 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.....	4
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>7</b>
2.1 基金基本情况 (转型后) .....	7
2.1 基金基本情况 (转型前) .....	7
2.2 基金产品说明 (转型后) .....	7
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.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现 (转型后) .....	11
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遵规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型后)</b> .....	<b>21</b>
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	22
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	23
6.4 报表附注.....	24
<b>§6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型前)</b> .....	<b>40</b>
6.1 资产负债表.....	40
6.2 利润表.....	41
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	42
6.4 报表附注.....	43
<b>§7 投资组合报告 (转型后)</b> .....	<b>59</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	59
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60

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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.11 投资组合报告附注.....	61
<b>§7 投资组合报告(转型前) .....</b>	<b>62</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	62
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	62
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.....	62
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
<b>§8 基金份额持有人信息(转型后) .....</b>	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
<b>§8 基金份额持有人信息(转型前) .....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	69
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>70</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>71</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>72</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后) .....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前) .....	73
10.9 其他重大事件(转型后) .....	74
10.9 其他重大事件(转型前) .....	75
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>78</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 .....	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>79</b>

12.1 备查文件目录.....	79
12.2 存放地点.....	79
12.3 查阅方式.....	79

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	大成景恒混合型证券投资基金	
基金简称	大成景恒混合	
基金主代码	090019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	19,874,157.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成景恒混合 A	大成景恒混合 C
下属分级基金的交易代码	090019	006038
报告期末下属分级基金的份额总额	19,874,157.22 份	0.00 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	大成景恒保本混合型证券投资基金
基金简称	大成景恒保本混合
基金主代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 15 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,277,687.33 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本混合型基金将秉承价值投资的基本理念，依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期，自上而下稳健配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，力争实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金以经风险调整后的收益最大化为目标，在合理运用金融工程技术的基础上，因时制宜，把握宏观经济和投资市场的长期变化趋势，根据经济周期和市场预期动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，谋求基金资产长期稳定的增长。
业绩比较基准	基金业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证综合债券指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金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增值。
投资策略	本基金投资采用 VPPI 可变组合保险策略 (Variable Proportion Portfolio Insurance)。VPPI 策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制，将基金资产动态优化分配在保本资产和风险资产上；并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本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。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产，其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具；风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率 (税后)。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率 (按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位，单位为百分数) 计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	陈四清

### 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	基金管理人及基金托管人住所
-------------	---------------

## 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 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	大成景恒混合 A	大成景恒混合 C
本期已实现收益	-16,082.99	-
本期利润	-1,415.49	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0001	-
本期加权平均净值利润率	-0.01%	-
本期基金份额净值增长率	1.40%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 6 月 30 日	
期末可供分配利润	5,239,632.09	-
期末可供分配基金份额利润	0.2636	-
期末基金资产净值	20,143,522.08	-
期末基金份额净值	1.0140	-
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	0.00%	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、根据我司 2018 年 6 月 19 日《关于大成景恒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恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设 C 类基金份额的公告》，自 2018 年 6 月 26 日起，大成景恒混合型证券投资基金增加收取销售服务费的 C 类份额。截止本报告期末，景恒 C 类份额未发生申购业务，本报告期无景恒 C 类份额的相关财务指标及净值表现的数据。

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 6 月 25 日	
本期已实现收益	235,531.99	
本期利润	289,581.21	
加权平均基金份额本期利润	0.0117	
本期加权平均净值利润率	1.16%	

本期基金份额净值增长率	1.20%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018 年 6 月 25 日
期末可供分配利润	5,890,186.62
期末可供分配基金份额利润	0.2644
期末基金资产净值	22,581,762.85
期末基金份额净值	1.014
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018 年 6 月 25 日
基金份额累计净值增长率	35.75%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括持有人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)

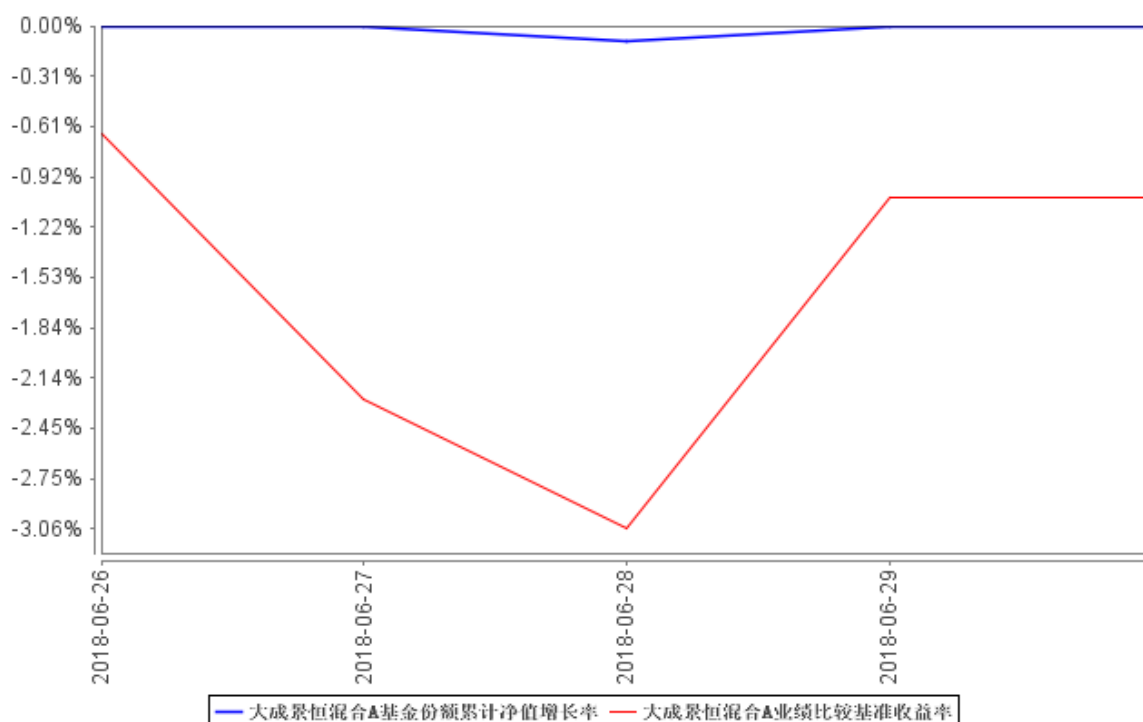
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成景恒混合 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
自基金合同生效起至今	0.00%	0.07%	-1.05%	1.40%	1.05%	-1.33%

注：本基金合同生效日为 2018 年 6 月 26 日。

### 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



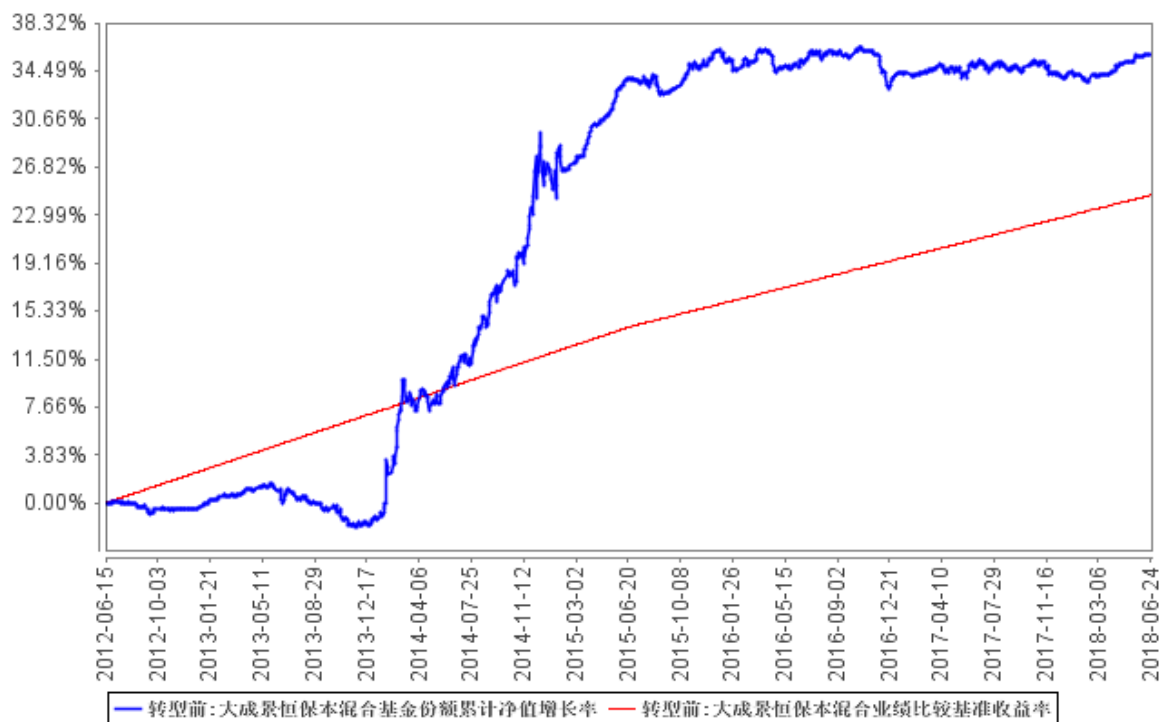
注：按基金合同规定，本基金自 2018 年 6 月 26 日起 6 个月（内）的时间区间为“大成景恒混合型证券投资基金”的投资转型期。截至报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

## 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

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	0.10%	0.02%	0.19%	0.01%	-0.09%	0.01%
过去三个月	1.10%	0.06%	0.67%	0.01%	0.43%	0.05%
过去六个月	1.20%	0.07%	1.37%	0.01%	-0.17%	0.06%
过去一年	0.30%	0.09%	2.85%	0.01%	-2.55%	0.08%
过去三年	1.40%	0.11%	9.16%	0.01%	-7.76%	0.10%
自基金合同生效起至今	35.74%	0.23%	24.58%	0.01%	11.16%	0.22%

### 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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至本基金转型前，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

## §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		
苏秉毅先生	本基金基金经理	2018 年 6 月 26 日	-	14 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基

					<p>金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起担任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。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。

#### 4.1.2 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		
赵世宏先生	本基金基金经理	2016 年 3 月 26 日	2018 年 6 月 25 日	7 年	<p>经济学硕士，2011 年 3 月至 2012 年 9 月任中银基金管理有限公司研究员。2012 年 9 月至 2015 年 9 月任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2015 年 9 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2016 年 3 月 26 日至 2018 年 7 月 20 日担任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景利混合型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券</p>

				<p>投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金和大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 26 日至 2018 年 6 月 25 日担任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 8 日至 2018 年 7 月 20 日担任大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 2 月 16 日至 2018 年 7 月 20 日任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 18 日至 2018 年 7 月 20 日担任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 15 日至 2018 年 7 月 20 日担任大成惠裕定期开放纯债债券型基金基金经理。2017 年 6 月 6 日至 2018 年 7 月 20 日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。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间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率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，随着金融监管统一及资管新规发布，对银行理财、通道业、打破刚兑、控制杠杆务等均做出了明确规范，将对资本市场和大资管行业都带来深远影响。资管新规带来的信用收缩，使得实体经济也承受一定压力，企业盈利存在下行风险。此外，主要经济体之间的贸易摩擦对市场情绪产生较多扰动，同时为进出口带来较大不确定性。与此同时，货币政策则维持总量宽松。受这些因素影响，权益市场持续调整，而债券走势则相对较好。

组合操作上，本基金根据市场变化灵活调整了权益仓位，有效规避了系统风险。债券操作方面，精选匹配于保本期的利率债和存单品种。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，大成景恒混合 A 的份额资产净值为 1.014。本报告期转型前（2018.1.1-2018.6.25）大成景恒保本的基金份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；转型后（2018.6.26-2018.6.30）大成景恒混合 A 的份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为-1.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，外部环境和经济政策均面临较大的不确定性。经济基本面短期内不会发生较大变化。中美贸易摩擦并没有缓和的迹象，人民币汇率也不稳定，这无疑加大了政策制定的难度。

“既要又要”式的复合目标越来越难实现，政府很难兼顾多方面的均衡。在内外多重压力下，货币政策和财政政策保持宽松是必然选择。当内外环境稳定后，为了经济可持续发展，去杠杆、调结构的大趋势仍然不会变。

对于股票市场，下半年的形势更加错综复杂。经济基本面的调整有可能会令去杠杆节奏有所

放缓。这对刚经历过波动的股市来说，基本面变化已经在一定程度上反映在股价里，综合来看反而造成边际改善的短期利好。在货币政策保持宽松的情况下，市场流动性并不紧缺，只要投资者风险偏好提升，即有可能带来一波反弹。

预计下半年市场总体走势应好于上半年。反弹行情若如期出现，其性质仍属于悲观预期修复所带来的超跌反弹。总体而言，之前成长股超跌程度更甚于价值股，部分质地尚可而被市场错杀沦为小市值的股票有望迎来修复行情。成长板块将先于价值板块反弹，强度也会相对较高。值得注意的是，即使总体环境有所改善，个股风险依然不能忽视，基金经理需要以更高的标准筛选股票。

下半年，本基金将保持相对稳健风格，伺机买入质地尚可而在系统性下跌中被错杀的股票，力争在超跌反弹行情中获取收益。

#### 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、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三名投资组合经理。

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；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人

已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

## §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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成景恒混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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：大成景恒混合型证券投资基金

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	6.4.6.1	12,296,321.81
结算备付金		138,265.05
存出保证金		7,390.07
交易性金融资产	6.4.6.2	1,000,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,000,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.6.3	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	7,200,000.00
应收证券清算款		104,920.00
应收利息	6.4.6.5	35,766.45
应收股利		-
应收申购款		297.15
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.6.6	-
资产总计		20,782,960.53
<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	6.4.6.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		359,184.16
应付管理人报酬		23,488.76
应付托管费		3,914.77
应付销售服务费		-

应付交易费用	6.4.6.7	5,092.40
应交税费		188,252.80
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.6.8	59,505.56
负债合计		639,438.45
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.6.9	14,845,611.93
未分配利润	6.4.6.10	5,297,910.15
所有者权益合计		20,143,522.08
负债和所有者权益总计		20,782,960.53

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，大成景恒混合 A 基金份额净值 1.014 元，大成景恒混合 C 基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 19,874,157.22 份，其中大成景恒混合 A 基金份额 19,874,157.22 份，大成景恒混合 C 基金份额 0.00 份。

2、本基金合同生效日为 2018 年 6 月 26 日，本报告期自 2018 年 6 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：大成景恒混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 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 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		5,509.37
1. 利息收入		5,634.84
其中：存款利息收入	6.4.6.11	1,871.28
债券利息收入		483.56
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,280.00
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,800.50
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.13	-14,800.50
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-

股利收益	6.4.6.16	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.6.17	14,667.50
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.6.18	7.53
<b>减: 二、费用</b>		6,924.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,340.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	723.47
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.6.19	-
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.6.20	1,860.52
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-1,415.49
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-1,415.49

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 大成景恒混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 6 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 6 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)	16,641,518.38	5,940,244.47	22,581,762.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-1,415.49	-1,415.49
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)	-1,795,906.45	-640,918.83	-2,436,825.28
其中: 1. 基金申购款	1,826.47	651.77	2,478.24
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-1,797,732.92	-641,570.60	-2,439,303.52
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)	14,845,611.93	5,297,910.15	20,143,522.08

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成景恒混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由原景恒保本混合型证券投资基金转型而来。根据《景恒保本混合型证券投资基金招募说明书》，原景恒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，每三年为 1 个保本期间。自 2012 年 6 月 15 日景恒保本混合型证券投资基金成立以后，已经经过两个保本期间运作。鉴于本基金的第二个保本周期到期后，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《大成景恒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恒混合型证券投资基金。自 2018 年 6 月 26 日(转型后首日)起，原大成景恒保本混合型证券投资基金，更名为大成景恒混合型证券投资基金，《大成景恒混合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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

原景恒保本混合型证券投资基金于 2018 年 6 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银行股份有限公司确认的资产净值为 22,581,762.85 元，已于 2018 年 6 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《大成景恒混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围限于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（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的 5%—40%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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  $80\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+20\% \times$  中证综合债券指数收益率。

本基金选择市场认同度较高的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩比较基准，选择用中证综合债券指数作为本基金债券组合的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### **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 6 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.4.1 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。

##### **6.4.4.2 会计估计变更的说明**

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2017）6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 11 月 27 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

##### **6.4.4.3 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。

## 6.4.5 税项

### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### (2) 增值税及附加、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### (3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 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	12,296,321.81
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：	12,296,321.81

### 6.4.6.2 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	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	998,504.00	1,000,000.00	1,496.00
	合计	998,504.00	1,000,000.00	1,496.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		998,504.00	1,000,000.00	1,496.00

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 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	7,200,000.00	-
合计	7,200,000.00	-

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购取得的债券。

#### 6.4.6.5 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	3,014.62
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	55.98
应收债券利息	34,332.88
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,640.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.97
合计	35,766.45

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 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	217.70
银行间市场应付交易费用	4,874.70
合计	5,092.40

#### 6.4.6.8 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	59,505.56
合计	59,505.56

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景恒混合 A		
项目	本期 2018 年 6 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	21,428,794.49	16,007,172.78
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	2,444.32	1,826.47
本期赎回(以“-”号填列)	-1,557,081.59	-1,163,387.32
本期末	19,874,157.22	14,845,611.93

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.6.10 未分配利润

金额单位：人民币元

大成景恒混合 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	5,890,186.62	50,057.85	5,940,244.47

本期利润	-16,082.99	14,667.50	-1,415.49
本期基金份额交易产生的变动数	-634,471.54	-6,447.29	-640,918.83
其中：基金申购款	644.63	7.14	651.77
基金赎回款	-635,116.17	-6,454.43	-641,570.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,239,632.09	58,278.06	5,297,910.15

#### 6.4.6.11 存款利息收入

项目	本期 2018年6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	1,838.53
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	31.10
其他	1.65
合计	1,871.28

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期内本基金无买卖股票的差价收入。

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年6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	-14,800.50
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	-14,800.50

##### 6.4.6.13.2 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6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	4,500,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	4,401,067.50

成本总额	
减：应收利息总额	113,733.00
买卖债券差价收入	-14,800.50

#### 6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期末本基金无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.6.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.6.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.6.16 股利收益

本基金转型后至本报告期末未产生股利收益。

#### 6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年6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	14,667.50
——股票投资	-
——债券投资	14,667.50
——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	14,667.50

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月26日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
基金赎回费收入	7.53
合计	7.53

#### 6.4.7.19 交易费用

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	410.95
信息披露费	1,232.85
其他	-
上清所债券托管帐户维护费	-
银行划款手续费	216.72
中债登债券托管帐户维护费	-
合计	1,860.52

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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

本基金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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：以下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

无。

##### 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

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的交易。



#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 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 6 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	4,340.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,367.25

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支，由基金管理人支付给担保人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 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	723.47

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 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 6 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
中国银行	12,296,321.81	1,838.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金截至本报告期末持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，

以控制相应的信用风险。

截至 2018 年 6 月 30 日止, 本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 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	1,000,000.00
合计	1,000,000.00

注: 1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为债券期限为一年的政策性金融债。

3. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现而带来的变现困难。

##### 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, 约定在非正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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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。

本基金持有的部分金融资产都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 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	12,296,321.81	-	-	-	12,296,321.81
结算备付金	138,265.05	-	-	-	138,265.05
存出保证金	7,390.07	-	-	-	7,390.07
交易性金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
买入返售金融资产	7,200,000.00	-	-	-	7,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	104,920.00	104,920.00
应收利息	-	-	-	35,766.45	35,766.45

应收申购款	-	-	-	297.15	297.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,641,976.93	-	-	140,983.60	20,782,960.53
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	359,184.16	359,184.16
应付管理人报酬	-	-	-	23,488.76	23,488.76
应付托管费	-	-	-	3,914.77	3,914.77
应付交易费用	-	-	-	5,092.40	5,092.40
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	59,505.56	59,505.56
负债总计	-	-	-	639,438.45	639,438.45
利率敏感度缺口	20,641,976.93	-	-	-498,454.85	20,143,522.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。	
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）
	利率上升 25 个基准点	0.00
	利率下降 25 个基准点	0.00

#### 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的 5%—40%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者

到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### **6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

无。

#### **6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2017 年末交易性权益类投资占净值比为 2.46%），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。

#### **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：大成景恒保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 25 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 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	17,364,256.54	1,116,452.62
结算备付金		138,265.05	136,847.59
存出保证金		7,390.07	14,701.79
交易性金融资产	6.4.3.2	5,386,400.00	15,156,436.40
其中：股票投资		-	684,089.00
基金投资		-	-
债券投资		5,386,400.00	14,472,347.40
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	-	11,500,000.00
应收证券清算款		-	90,143.73
应收利息	6.4.3.5	148,784.61	311,727.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	209.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		23,045,096.27	28,326,519.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		189,774.06	3,942.46
应付管理人报酬		19,147.89	29,346.21
应付托管费		3,191.30	4,891.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	5,092.40	10,217.18
应交税费		188,252.80	188,252.80



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	57,874.97	260,006.01
负债合计		463,333.42	496,655.72
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	16,641,518.38	20,757,040.35
未分配利润	6.4.3.10	5,940,244.47	7,072,823.67
所有者权益合计		22,581,762.85	27,829,864.02
负债和所有者权益总计		23,045,096.27	28,326,519.74

注：报告截止日 2018 年 6 月 25 日(第二个保本期届满日)，基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 22,277,687.33 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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 6 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>		556,070.81	2,684,216.13
1. 利息收入		412,270.78	2,632,513.24
其中：存款利息收入	6.4.3.11	8,404.22	403,170.01
债券利息收入		321,404.65	2,195,496.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		82,461.91	33,846.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		89,511.94	-2,424,749.42
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-132,353.61	-546,650.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	222,026.55	-1,999,797.21
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	-161.00	121,698.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	54,049.22	2,475,707.91
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	238.87	744.40

<b>减：二、费用</b>		266,489.60	1,279,975.90
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	143,887.81	883,536.63
2. 托管费	6.4.6.2.2	23,981.32	147,256.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	17,635.75	44,143.77
5. 利息支出		-	2,864.09
其中：卖出回购金融资产支出		-	2,864.09
6. 税金及附加		0.35	-
7. 其他费用	6.4.3.20	80,984.37	202,175.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		289,581.21	1,404,240.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		289,581.21	1,404,240.23

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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）	20,757,040.35	7,072,823.67	27,829,864.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	289,581.21	289,581.21
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）	-4,115,521.97	-1,422,160.41	-5,537,682.38
其中：1. 基金申购款	160,847.90	55,828.99	216,676.89
2. 基金赎回款	-4,276,369.87	-1,477,989.40	-5,754,359.27
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）	16,641,518.38	5,940,244.47	22,581,762.85
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		



债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### (3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 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 6 月 25 日
活期存款	17,364,256.54
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：	17,364,256.54

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 25 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	5,399,571.50	5,386,400.00
	合计	5,399,571.50	5,386,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,399,571.50	5,386,400.00	-13,171.50

#### 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

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购取得的债券。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 25 日
应收活期存款利息	1,176.09
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	24.88
应收债券利息	147,582.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.32
合计	148,784.61

#### 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 6 月 25 日
交易所市场应付交易费用	217.70
银行间市场应付交易费用	4,874.70
合计	5,092.40

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 25 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.21
预提费用	57,861.76
合计	57,874.97

### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	27,787,237.12	20,757,040.35
本期申购	215,331.63	160,847.90
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,724,881.42	-4,276,369.87
- 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	22,277,687.33	16,641,518.38

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,060,611.53	12,212.14	7,072,823.67
本期利润	235,531.99	54,049.22	289,581.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,405,956.90	-16,203.51	-1,422,160.41
其中：基金申购款	55,106.11	722.88	55,828.99
基金赎回款	-1,461,063.01	-16,926.39	-1,477,989.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,890,186.62	50,057.85	5,940,244.47

### 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 6 月 25 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,375.07
其他	61.36
合计	8,404.22

### 6.4.3.12 股票投资收益

#### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日
卖出股票成交总额	4,962,935.65
减: 卖出股票成本总额	5,095,289.26
买卖股票差价收入	-132,353.61

### 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6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	222,026.55
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	222,026.55

#### 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6月25日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交金额	94,417,486.87
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	92,757,308.29
减: 应收利息总额	1,438,152.03
买卖债券差价收入	222,026.55

#### 6.4.3.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期末本基金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 6 月 25 日
股票投资产生的股利收益	-161.00
基金投资产生的股利收益	-



合计	-161.00
----	---------

#### 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 6 月 25 日
1. 交易性金融资产	54,049.22
——股票投资	57,619.00
——债券投资	-3,569.78
——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	54,049.22

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日
基金赎回费收入	227.17
转换费收入 090019	11.70
合计	238.87

#### 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日
交易所市场交易费用	14,752.75
银行间市场交易费用	2,883.00
合计	17,635.75

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日
审计费用	14,465.44
信息披露费	43,396.32
其他	600.00

上清所债券托管帐户维护费	9,000.00
银行划款手续费	4,522.61
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	80,984.37

#### 6.4.3.21 分部报告

无。

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 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6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	4,547,418.63	48.81%	12,489,401.45	40.74%

##### 6.4.6.1.2 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 6 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	11,337,056.05	34.39%	7,869,123.00	44.31%

#### 6.4.6.1.3 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 6 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	115,300,000.00	86.37%	19,600,000.00	10.56%

#### 6.4.6.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.5 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 6 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	4,143.83	48.79%	-	-
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	11,382.91	40.74%	11,382.91	59.42%

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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	143,887.81	883,536.63

其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	56,721.03	100,373.88
------------------------------	-----------	------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支，由基金管理人支付给担保人。

#### 6.4.6.2.2 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 6 月 25 日	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	23,981.32	147,256.11

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 6.4.6.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.6.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	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
中国银行	17,364,256.54	6,967.79	303,424.56	25,190.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.6.6 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。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配事项。

#### 6.4.8 期末（2018 年 6 月 25 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

#### 6.4.9.2 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,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

截至 2018 年 6 月 25 日止,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.50%。

##### 6.4.9.2.1 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 25 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,386,400.00	10,846,235.40
合计	5,386,400.00	10,846,235.40

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为债券期限为一年以内的政策性金融债、同业存单。

3. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.9.2.2 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 25 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	3,626,112.00
合计	-	3,626,112.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为债券期限大于一年的政策性金融债。

3. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现而带来的变现困难。

##### 6.4.9.3.1 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，约定在非正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。

#### 6.4.9.4 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。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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。

本基金持有的部分金融资产都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 年 6 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	17,364,256.54	-	-	-	17,364,256.54
结算备付金	138,265.05	-	-	-	138,265.05
存出保证金	7,390.07	-	-	-	7,390.07
交易性金融资产	5,386,400.00	-	-	-	5,386,400.00
应收利息	-	-	-	148,784.61	148,784.61
资产总计	22,896,311.66	-	-	148,784.61	23,045,096.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	189,774.06	189,774.06
应付管理人报酬	-	-	-	19,147.89	19,147.89
应付托管费	-	-	-	3,191.30	3,191.30
应付交易费用	-	-	-	5,092.40	5,092.40
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	57,874.97	57,874.97
负债总计	-	-	-	463,333.42	463,333.42
利率敏感度缺口	22,896,311.66	-	-	-314,548.81	22,581,762.85
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	1,116,452.62	-	-	1,116,452.62
结算备付金	136,847.59	-	-	136,847.59
存出保证金	14,701.79	-	-	14,701.79
交易性金融资产	14,472,347.40	-	684,089.00	15,156,436.40
买入返售金融资产	11,500,000.00	-	-	11,500,000.00
应收证券清算款	-	-	90,143.73	90,143.73
应收利息	-	-	311,727.86	311,727.86
应收申购款	-	-	209.75	209.75
资产总计	27,240,349.40	-	1,086,170.34	28,326,519.74
负债				
应付赎回款	-	-	3,942.46	3,942.46
应付管理人报酬	-	-	29,346.21	29,346.21
应付托管费	-	-	4,891.06	4,891.06
应付交易费用	-	-	10,217.18	10,217.18
应交税费	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	260,006.01	260,006.01
负债总计	-	-	496,655.72	496,655.72
利率敏感度缺口	27,240,349.40	-	589,514.62	27,829,864.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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25日）	上年度末（2017年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-10,002.50	-12,600.23
	利率下降 25 个基点	10,004.91	12,622.39

#### 6.4.9.4.2 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为 0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为 60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的 40%。于 2017 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### **6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口**

无。

#### **6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2018 年 6 月 25 日，本基金持有交易性权益类投资占基金资产净值比例为 0.00%，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。

#### **6.4.10 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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	固定收益投资	1,000,000.00	4.81
	其中: 债券	1,000,000.00	4.81
	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	7,200,000.00	34.64
	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	12,434,586.86	59.83
7	其他各项资产	148,373.67	0.71
8	合计	20,782,960.53	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

无。

#### 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

无。

#### 7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,000,000.00	4.96
	其中：政策性金融债	1,000,000.00	4.96
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000,000.00	4.96

## 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	170207	17 国开 07	10,000	1,000,000.00	4.96

## 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。

## 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股指期货交易情况说明

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 7.11.3 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	7,390.07
2	应收证券清算款	104,920.00
3	应收股利	-
4	应收利息	35,766.45
5	应收申购款	297.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,373.67

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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。

## §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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	5,386,400.00	23.37
	其中：债券	5,386,400.00	23.37
	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	-	-
	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	17,502,521.59	75.95
7	其他资产	156,174.68	0.68
8	合计	23,045,096.27	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	600183	生益科技	417,705.00	1.50
2	000012	南玻A	405,504.00	1.46
3	601636	旗滨集团	388,863.00	1.40
4	603708	家家悦	302,249.00	1.09
5	002353	杰瑞股份	276,565.00	0.99

6	601808	中海油服	276,339.00	0.99
7	000910	大亚圣象	265,382.00	0.95
8	002340	格林美	264,707.00	0.95
9	601939	建设银行	256,551.00	0.92
10	000759	中百集团	224,971.00	0.81
11	002271	东方雨虹	138,336.00	0.50
12	600486	扬农化工	137,483.00	0.49
13	600048	保利地产	128,354.26	0.46
14	000725	京东方 A	128,148.00	0.46
15	601336	新华保险	127,774.00	0.46
16	600585	海螺水泥	126,693.00	0.46
17	603799	华友钴业	125,255.00	0.45
18	300595	欧普康视	124,809.00	0.45
19	000960	锡业股份	120,969.00	0.43
20	002179	中航光电	116,924.00	0.42

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300109	新开源	677,455.00	2.43
2	000012	南玻 A	392,496.28	1.41
3	600183	生益科技	383,395.40	1.38
4	601636	旗滨集团	380,693.90	1.37
5	603708	家家悦	293,694.02	1.06
6	002353	杰瑞股份	283,790.00	1.02
7	601808	中海油服	269,895.00	0.97
8	601939	建设银行	265,595.05	0.95
9	002340	格林美	258,458.00	0.93
10	000910	大亚圣象	245,449.00	0.88
11	000759	中百集团	209,222.00	0.75
12	603799	华友钴业	142,987.00	0.51
13	002271	东方雨虹	137,247.00	0.49
14	600486	扬农化工	132,925.00	0.48
15	000725	京东方 A	132,584.00	0.48
16	600048	保利地产	131,965.00	0.47
17	600585	海螺水泥	130,962.00	0.47

18	601336	新华保险	128,040.00	0.46
19	300595	欧普康视	127,224.00	0.46
20	000960	锡业股份	120,418.00	0.43

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,353,581.26
卖出股票收入（成交）总额	4,962,935.65

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	999,800.00	4.43
	其中：政策性金融债	999,800.00	4.43
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）	-	-
8	同业存单	4,386,600.00	19.43
9	其他	-	-
10	合计	5,386,400.00	23.85

### 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	111710677	17 兴业银行 CD677	45,000	4,386,600.00	19.43
2	170207	17 国开 07	10,000	999,800.00	4.43

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。



## 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 本基金投资的前十名证券之一 17 兴业银行 CD677 (111710677) 的发行主体

兴业银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等, 受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监银罚决字 (2018) 1 号)。本基金认为, 对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,390.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,784.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	156,174.68

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5 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
大成景恒混合 A	706	28,150.36	-	-	19,874,157.22	100.00%
大成景恒混合 C	-	-	-	-	-	-
合计	706	28,150.36	-	-	19,874,157.22	100.00%

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成景恒混合 A	2,651.47	0.0133%
	大成景恒混合 C	-	-
	合计	2,651.47	0.0133%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成景恒混合 A	0
	大成景恒混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	大成景恒混合 A	0

开放式基金	大成景恒混合 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

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
748	29,783.00	-	-	22,277,687.33	100.00%

注: 持有人户数为有效户数, 即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,651.47	0.0133%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	大成景恒混合 A	大成景恒混合 C
基金合同生效日基金份额总额	21,428,794.49	-
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	2,444.32	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,557,081.59	-
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	19,874,157.22	-

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位: 份

基金合同生效日基金份额总额	1,071,726,792.02
本报告期期初基金份额总额	27,787,237.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	215,331.63
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	5,724,881.42
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	22,277,687.33

## §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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

大成景恒混合型证券投资基金是根据原大成景恒保本混合型证券投资基金《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由大成景恒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安永华明会计师事务所（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、基金托管人的托管业务部门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

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
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	14,500,000.00	100.00%	-	-



## 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	2	4,547,418.63	48.81%	4,143.83	48.79%	-
中信建投	1	3,550,202.00	38.11%	3,237.84	38.13%	-
长城证券	1	1,218,896.28	13.08%	1,110.71	13.08%	-

注: 1. 本报告期内本基金退租交易单元: 无; 新增交易单元: 太平洋证券 (40984)。

2. 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。

### 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	11,337,056.05	34.39%	115,300,000.00	86.37%	-	-
中信建投	18,432,942.03	55.91%	-	-	-	-
长城证券	3,079,376.24	9.34%	-	-	-	-
长江证券	118,141.50	0.36%	18,200,000.00	13.63%	-	-

### 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	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额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 6 月 30 日
2	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加兴业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 6 月 30 日
3	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加长江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 6 月 30 日
4	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
5	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加中国银河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 6 月 29 日
6	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加部分销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 6 月 28 日
7	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加广州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 6 月 28 日
8	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加国都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 6 月 26 日
9	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加南京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 6 月 26 日

10	关于大成景恒保本混合型证券投资基金到期转型后变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 6 月 26 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	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
2	关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期转型及增设 C 类基金份额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 6 月 21 日
3	关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期转型及增设 C 类基金份额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 6 月 20 日
4	大成景恒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 6 月 19 日
5	大成景恒混合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 6 月 19 日
6	大成景恒混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 6 月 19 日
7	大成景恒混合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 6 月 19 日
8	大成景恒混合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 6 月 19 日
9	关于大成景恒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恒混合型证券投资	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 6 月 19 日

	资基金后相关业务规则及增设 C 类基金份额的公告		
10	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
11	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
12	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
13	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
14	大成景恒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
15	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
16	大成景恒保本混合型证券投资基金 2017 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 31 日
17	《大成景恒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
18	大成景恒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
19	大成景恒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	
20	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
21	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
22	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
23	大成景恒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 30 日
24	大成景恒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 30 日
25	大成景恒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
26	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

无。

### 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 6 月 19 日发布了《关于大成景恒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恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设 C 类基金份额的公告》，大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期于 2018 年 6 月 25 日到期，随后转型为大成景恒混合型证券投资基金，并增加收取销售服务费的 C 类份额，《大成景恒混合型证券投资基金基金合同》及《大成景恒混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 6 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恒混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景恒混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景恒混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在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