

大成景益平稳收益混合型证券投资基金  
2016 年半年度报告摘要  
2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成景益平稳收益混合
基金主代码	000695
交易代码	000695
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,311,413.77 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将有采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-19,157,505.53
本期利润	-20,723,436.70
加权平均基金份额本期利润	-0.4181
本期基金份额净值增长率	-4.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1597
期末基金资产净值	26,057,178.99
期末基金份额净值	1.423

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

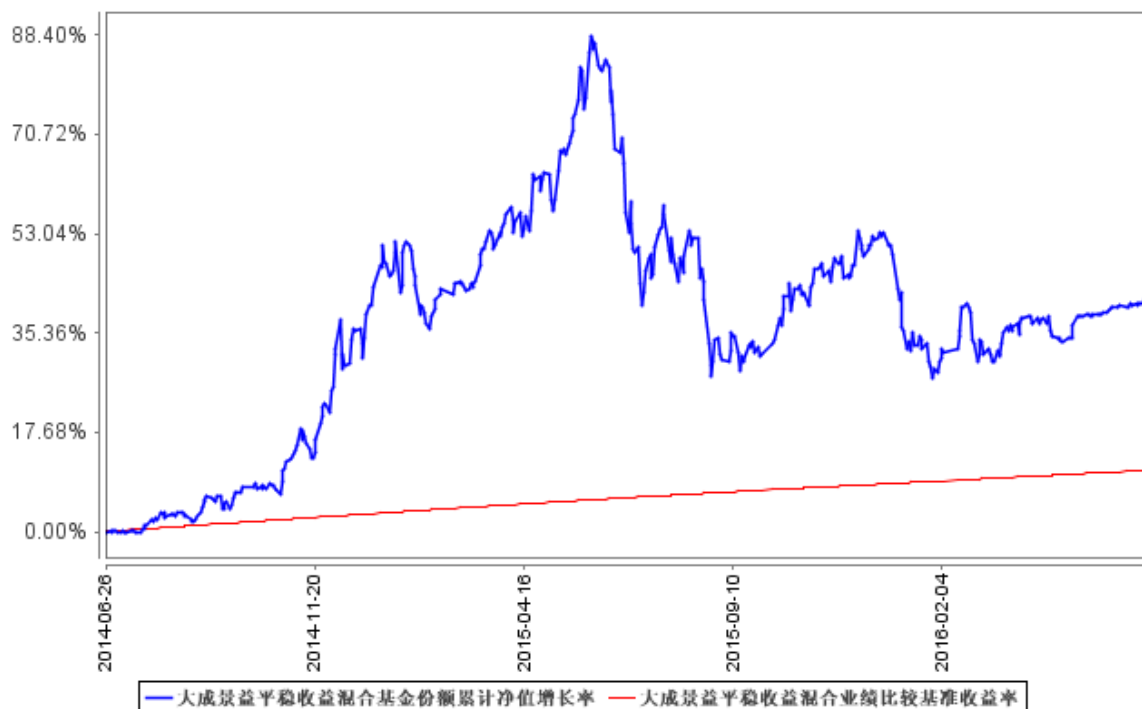
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 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	2.08%	0.27%	0.35%	0.01%	1.73%	0.26%
过去三个月	3.04%	0.47%	1.08%	0.01%	1.96%	0.46%
过去六个月	-4.75%	1.10%	2.18%	0.01%	-6.93%	1.09%
过去一年	-10.39%	1.43%	4.60%	0.01%	-14.99%	1.42%
自基金合同生效起至今	42.30%	1.46%	10.94%	0.02%	31.36%	1.44%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于 2014 年 6 月 26 日生效。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。截至 2016 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：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、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金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证

券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

#### 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		
赵世宏先生	本基金基金经理	2016 年 3 月 26 日	-	5 年	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

	理				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。自 2016 年 3 月 26 日起担任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景恒保本混合型证券投资基金、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。具有基金从业资格。国籍：中国
王磊先生	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 日	2016 年 3 月 25 日	12 年	经济学硕士。2003 年 5 月至 2012 年 10 月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 15 日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 16 日到 2016 年 3 月 25 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 7 月 17 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013 年 11 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014 年 6 月 26 到 2016 年 3 月 25 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 3 日至 2016 年 3 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2014 年 12 月 9 日到 2016 年 3 月 25 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015 年 12 月 14 日起任大成行业轮动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
袁杰先生	本基金基金经理助理	2016 年 6 月 22 日	-	4 年	工程硕士。2012 年-2014 年就职于鹏华基金固定收益部任研究员；2014 年 6 月起加入大成基金管理有限公司，现任固定收益部研究员兼基金经理助理。2016 年 5 月 9 日起任大成景丰债券型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2016 年 6 月 22 日起任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经

					理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
黄海峰 先生	本基金 基金经 理助理	2014 年 6 月 26 日	-	12 年	南开大学经济学学士，2013 年 7 月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013 年 10 月 14 日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013 年 10 月 28 日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014 年 3 月 18 日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014 年 3 月 18 日至 2014 年 12 月 23 日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 23 日至 2014 年 12 月 23 日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理。2014 年 6 月 26 日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014 年 12 月 24 日起，任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015 年 3 月 21 日起，任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月 27 日起，任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 29 日起，任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 4 日起，任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 15 日起，任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成景益平稳收益混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。



### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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分析及相应交易情形的分析结果表明：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。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

### 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

一季度，在经济下行压力下，政府加大了稳增长力度，大宗商品持续走强，信贷迭创新高。以“权威”人士谈话作为分界线，二季度国内经济政策出现转向，供给侧改革重回政策主线。临近季末，英国“脱欧”公投又给资本市场带来极大的扰动，全球货币政策宽松预期再起。

各类资产表现方面，供需缺口带来金属、能源等大宗商品的持续上涨。权益市场震荡向上，周期股走势较强。信贷需求猛增导致以 10 年国开债为标志的无风险利率大幅上行 50 个 BP，信用利差则在债转股的政策传闻下直接大幅走阔。但在 5 月初“权威”人士谈话后，大宗能源价格迅速回落，债券市场重回牛市，信用利差迅速缩窄，权益市场重回存量博弈的格局。

操作上，上半年本基金维持了中性偏低的权益仓位，主要配置于估值偏低的成长型个股。债券部分主要以资质较好的信用债作为主要配置，并适当参与利率品种的波段性机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.423 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.75%，同期业绩比较基准收益率为 2.18%，低于业绩比较基准的表现。

#### 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，国内货币政策环境依然会相对宽松。一方面，供给侧改革的基调应不会改变，需求端的刺激相对有限。另一方面，通胀数据在高基数的影响下，三季度仍将处低位。与此同时，英国“脱欧”带来较大的不确定，全球货币宽松格局还将延续，G20 会议将加强全球主要经济体间经济政策的协调，人民币汇率风险明显降低。

在此背景下，我们认为债券收益率上行空间有限。而考虑到季末资金面平稳度过，债券市场或将重新加杠杆，信用利差可能会继续缩窄。权益市场存量博弈可能成为新的常态，投资机会更多体现于个股和高景气板块而非市场整体。

权益类操作将继续注重自下而上挖掘投资机会，关注估值偏低、符合转型升级方向的成长个股以及高景气行业。债券投资操作继续以资质较好的信用债作为主要配置，同时通过对利率债的波段操作增强组合收益。

#### 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、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

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

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，

对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将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，曾于 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指

标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现  
有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成景益平稳收益混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,126,736.02	5,541,238.19
结算备付金	182,026.80	11,224,477.09
存出保证金	110,513.93	737,742.64
交易性金融资产	20,498,711.09	426,699,194.07
其中：股票投资	2,027,394.00	88,069,483.87
基金投资	-	-
债券投资	18,471,317.09	338,629,710.20
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	2,000,000.00	-
应收证券清算款	8,001,893.34	5,000,000.00
应收利息	455,499.68	6,240,514.81
应收股利	-	-
应收申购款	2,233.53	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	32,377,614.39	455,443,166.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	154,999,805.00
应付证券清算款	-	20,436.60
应付赎回款	7,078.29	-
应付管理人报酬	17,044.65	204,990.55
应付托管费	5,326.45	64,059.55
应付销售服务费	-	-

应付交易费用	39,053.18	351,029.57
应交税费	-	-
应付利息	2,913.18	16,549.80
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	249,019.65	170,000.20
负债合计	6,320,435.40	155,826,871.27
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	18,311,413.77	200,482,637.77
未分配利润	7,745,765.22	99,133,657.76
所有者权益合计	26,057,178.99	299,616,295.53
负债和所有者权益总计	32,377,614.39	455,443,166.80

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.423 元，基金份额总额 18,311,413.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景益平稳收益混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-19,596,276.37	204,698,389.13
1. 利息收入	1,473,192.69	20,239,320.03
其中：存款利息收入	54,374.49	661,581.79
债券利息收入	1,405,904.98	19,569,113.72
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	12,913.22	8,624.52
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-19,969,723.37	438,325,766.47
其中：股票投资收益	-11,254,676.34	175,486,122.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,717,455.18	260,972,899.63
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	2,408.15	1,866,744.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,565,931.17	-255,150,478.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	466,185.48	1,283,781.49
<b>减：二、费用</b>	1,127,160.33	19,798,883.34
1. 管理人报酬	277,568.83	5,990,810.45
2. 托管费	86,740.20	1,872,128.28

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	311,231.96	5,425,644.56
5. 利息支出	247,266.45	6,290,419.59
其中：卖出回购金融资产支出	247,266.45	6,290,419.59
6. 其他费用	204,352.89	219,880.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-20,723,436.70</b>	<b>184,899,505.79</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-20,723,436.70</b>	<b>184,899,505.79</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景益平稳收益混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,482,637.77	99,133,657.76	299,616,295.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,723,436.70	-20,723,436.70
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）	-182,171,224.00	-70,664,455.84	-252,835,679.84
其中：1. 基金申购款	1,344,881.79	496,482.45	1,841,364.24
2. 基金赎回款	-183,516,105.79	-71,160,938.29	-254,677,044.08
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）	18,311,413.77	7,745,765.22	26,057,178.99
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,097,696,187.40	477,714,595.22	1,575,410,782.62



(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。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.3 关联方关系

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

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2% 股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------



	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	78,713,753.56	43.60%	-	0.00%

## 6.4.4.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	168,303,507.43	40.98%	-	0.00%

## 6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	802,800,000.00	35.80%	-	0.00%

## 6.4.4.1.4 权证交易

无。

## 6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	71,784.66	43.62%	8,548.67	22.08%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	0.00	-	0.00

## 6.4.4.2 关联方报酬

## 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月
----	------------------	------------------------------

	2016 年 6 月 30 日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	277,568.83	5,990,810.45
其中：支付销售机构的客户维护费	7,808.23	63,458.47

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.80% / 当年天数。

#### 6.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,740.20	1,872,128.28

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	31,935,219.86	-	-	-	-	-

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 6 月 26 日）持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00

期间申购/买入总份额	40.20	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,040.20	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	54.61%	1.29%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准严格按照法律法规相关规定计算并支付。

#### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末本基金未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
中国农业银行	1,126,736.02	16,151.82	13,352,143.33	436,249.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.5 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项停牌	50.62	-	-	27,500	1,512,481.00	1,392,050.00	-
300142	沃森生物	2016年5月4日	重大事项停牌	7.19	-	-	36,700	393,349.00	263,873.00	-

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,000,000.00 元。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,027,394.00	6.26
	其中：股票	2,027,394.00	6.26
2	固定收益投资	18,471,317.09	57.05
	其中：债券	18,471,317.09	57.05
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	2,000,000.00	6.18
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	1,308,762.82	4.04
7	其他各项资产	8,570,140.48	26.47
8	合计	32,377,614.39	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	31,526.00	0.12
C	制造业	1,851,958.00	7.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,910.00	0.55
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	2,027,394.00	7.78

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300038	梅泰诺	27,500	1,392,050.00	5.34
2	300142	沃森生物	36,700	263,873.00	1.01
3	002405	四维图新	5,850	143,910.00	0.55
4	300367	东方网力	5,400	134,082.00	0.51
5	000338	潍柴动力	6,700	52,327.00	0.20
6	601020	华钰矿业	1,100	31,526.00	0.12
7	603601	再升科技	200	9,626.00	0.04

注：投资者欲了解本报告期末基金指数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.defund.com.cn>)的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例 (%)
1	002224	三力士	3,073,233.00	1.03
2	300367	东方网力	2,506,383.00	0.84
3	002624	完美环球	2,169,153.00	0.72
4	300496	中科创达	1,925,027.00	0.64
5	600547	山东黄金	1,627,659.00	0.54
6	300327	中颖电子	1,548,168.00	0.52
7	300383	光环新网	1,526,142.00	0.51
8	002450	康得新	1,514,275.00	0.51
9	002657	中科金财	1,476,314.00	0.49
10	600745	中茵股份	1,413,922.00	0.47
11	600259	广晟有色	1,352,064.49	0.45
12	300101	振芯科技	1,154,818.00	0.39
13	002335	科华恒盛	1,143,945.20	0.38
14	600376	首开股份	1,140,960.98	0.38
15	601377	兴业证券	1,129,867.00	0.38
16	002146	荣盛发展	1,098,537.42	0.37
17	300046	台基股份	1,035,047.00	0.35
18	600048	保利地产	818,448.00	0.27
19	300078	思创医惠	817,087.77	0.27
20	000014	沙河股份	809,937.00	0.27

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，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	600990	四创电子	8,413,471.30	2.81
2	002224	三力士	8,314,989.71	2.78
3	002292	奥飞娱乐	7,765,900.71	2.59
4	300327	中颖电子	7,200,090.60	2.40
5	000901	航天科技	7,136,834.35	2.38
6	300367	东方网力	5,466,076.66	1.82
7	002460	赣锋锂业	4,027,811.98	1.34
8	000977	浪潮信息	3,507,860.00	1.17

9	001979	招商蛇口	3,364,743.08	1.12
10	000032	深桑达 A	2,917,616.00	0.97
11	002387	黑牛食品	2,672,520.00	0.89
12	002414	高德红外	2,650,141.00	0.88
13	000938	紫光股份	2,565,570.00	0.86
14	300113	顺网科技	2,533,819.40	0.85
15	300085	银之杰	2,531,343.00	0.84
16	000687	华讯方舟	2,525,389.00	0.84
17	000796	凯撒旅游	2,041,046.00	0.68
18	002624	完美环球	1,894,585.05	0.63
19	002707	众信旅游	1,826,211.00	0.61
20	600547	山东黄金	1,793,782.00	0.60

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	54,370,362.50
卖出股票收入（成交）总额	126,257,544.89

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	8,682,620.20	33.32
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	3,241,200.00	12.44
	其中：政策性金融债	3,241,200.00	12.44
4	企业债券	6,416,624.80	24.63
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	130,872.09	0.50
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	18,471,317.09	70.89

#### 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	019518	15 国债 18	40,000	3,999,600.00	15.35

2	018002	国开 1302	30,000	3,241,200.00	12.44
3	010107	21 国债(7)	29,690	3,208,895.20	12.31
4	124422	13 崇明债	30,000	3,156,900.00	12.12
5	122553	12 虞交通	30,000	2,484,900.00	9.54

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，无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	110,513.93
2	应收证券清算款	8,001,893.34
3	应收股利	-
4	应收利息	455,499.68
5	应收申购款	2,233.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,570,140.48

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128009	歌尔转债	128.79	0.00

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300038	梅泰诺	1,392,050.00	5.34	重大事项停牌
2	300142	沃森生物	263,873.00	1.01	重大事项停牌

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
586	31,248.15	10,097,876.32	55.15%	8,213,537.45	44.85%

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	275,565.74	1.50%

## 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

单位：份

基金合同生效日（2014年6月26日）基金份额总额	695,878,758.69
本报告期期初基金份额总额	200,482,637.77
本报告期基金总申购份额	1,344,881.79
减：本报告期基金总赎回份额	183,516,105.79
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	18,311,413.77

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

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

#### 二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

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

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	742,610.00	0.41%	691.58	0.42%	-
北京高华	1	154,088.39	0.09%	140.40	0.09%	-
光大证券	2	78,713,753.56	43.60%	71,784.66	43.62%	-
国泰君安	2	1,744,946.50	0.97%	1,589.96	0.97%	-
海通证券	1	16,230,920.63	8.99%	14,791.45	8.99%	-
华泰证券	1	7,684,112.61	4.26%	7,002.66	4.25%	-
平安证券	1	2,016,953.31	1.12%	1,838.03	1.12%	-
瑞银证券	1	2,412,145.00	1.34%	2,198.19	1.34%	-
上海证券	1	1,174,951.98	0.65%	1,070.76	0.65%	-
万和证券	1	9,408,116.44	5.21%	8,573.76	5.21%	-
银河证券	4	3,667,440.42	2.03%	3,342.16	2.03%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	24,330,214.34	13.48%	22,172.23	13.47%	-
中金公司	2	5,551,096.60	3.07%	5,058.41	3.07%	-
中泰证券	1	11,298,413.67	6.26%	10,296.07	6.26%	-
中信建投	2	15,259,408.66	8.45%	13,907.97	8.45%	-

中信证券	2	134,700.00	0.07%	122.66	0.07%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1. 本报告期内本基金退租交易单元：无，新增交易单元：爱建证券、东方证券、万和证券。

## 2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(6) 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
安信证券	2,235,435.80	0.54%	163,200,000.00	7.28%	-	0.00%
光大证券	168,303,507.43	40.98%	802,800,000.00	35.80%	-	0.00%
国泰君安	107,536.45	0.03%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	8,051,799.63	1.96%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	1,517,813.15	0.37%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	21,616,274.59	5.26%	1,400,000.00	0.06%	-	0.00%
瑞银证券	37,347,333.27	9.09%	201,100,000.00	8.97%	-	0.00%
上海证券	15,608,297.59	3.80%	335,100,000.00	14.94%	-	0.00%
万和证券	8,582,824.17	2.09%	7,000,000.00	0.31%	-	0.00%
银河证券	1,363,993.06	0.33%	1,500,000.00	0.07%	-	0.00%
招商证券	69,300,926.46	16.87%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	4,751,407.44	1.16%	2,537,000.00	0.11%	-	0.00%
中金公司	11,471,214.60	2.79%	118,900,000.00	5.30%	-	0.00%
中泰证券	29,809,573.13	7.26%	329,100,000.00	14.67%	-	0.00%
中信建投	12,803,764.50	3.12%	256,100,000.00	11.42%	-	0.00%
中信证券	17,809,498.18	4.34%	24,000,000.00	1.07%	-	0.00%

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

大成基金管理有限公司  
2016 年 8 月 25 日