

大成景鹏灵活配置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	大成景鹏灵活配置混合	
基金主代码	001333	
交易代码	001333	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 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	9,969,146.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成景鹏灵活配置混合 A	大成景鹏灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	001333	002374
报告期末下属分级基金的份额总额	9,969,146.00 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金将采用“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 年期定存款税后利率+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
-------------	---------------

## 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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	大成景鹏灵活配置混合 A	大成景鹏灵活配置混合 C
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)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	29,873,219.82	-
本期利润	5,600,949.12	-
加权平均基金份额本期利润	0.0160	-
本期基金份额净值增长率	6.28%	-
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	0.0664	-
期末基金资产净值	10,630,758.14	-
期末基金份额净值	1.066	-

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、根据我司 2016 年 1 月 13 日《关于大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并相应修订基金合同的公告》，自 2016 年 1 月 14 日起，大成景鹏灵活配置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，景鹏 C 类份额未发生申购业务，本报告期无景鹏 C 类份额的相关财务指标及净值表现的数据。

### 3.2 基金净值表现

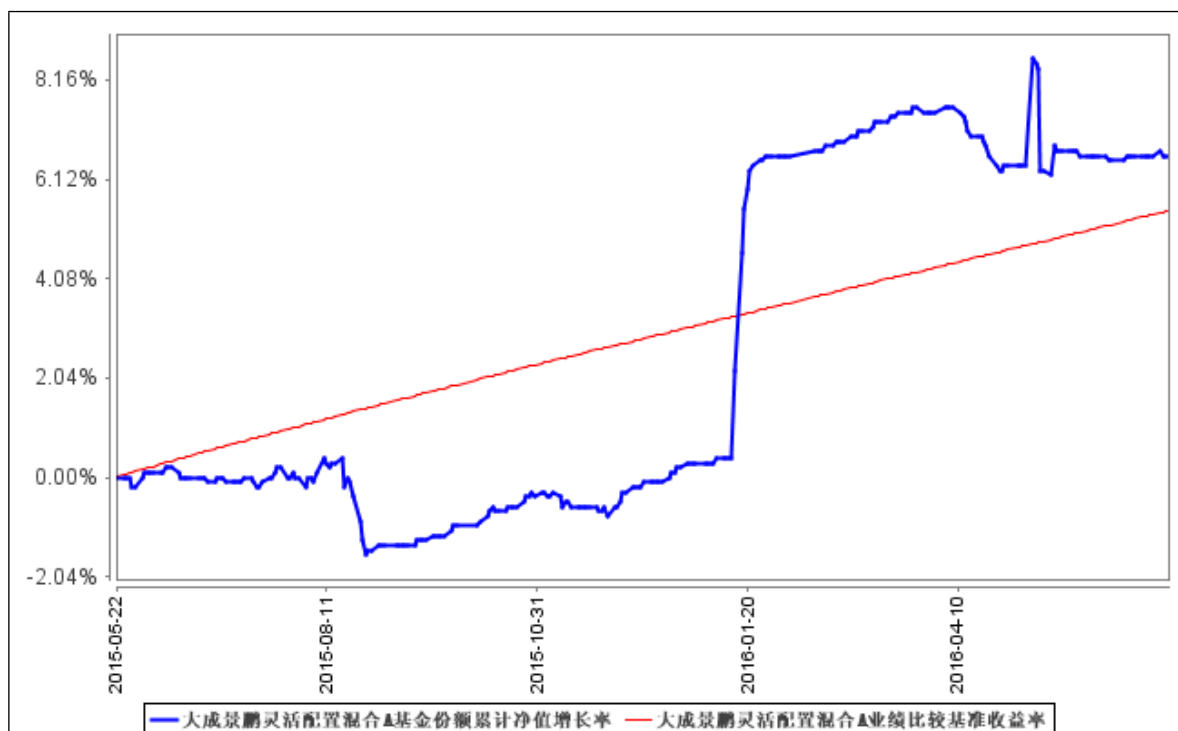
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成景鹏灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

		准差②	率③	④		
过去一个月	0.00%	0.04%	0.37%	0.01%	-0.37%	0.03%
过去三个月	-0.84%	0.38%	1.13%	0.01%	-1.97%	0.37%
过去六个月	6.28%	0.39%	2.29%	0.02%	3.99%	0.37%
过去一年	6.60%	0.29%	4.84%	0.01%	1.76%	0.28%
自基金合同生效起至今	6.60%	0.27%	5.47%	0.01%	1.13%	0.26%

### 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之日起 6 个月内为建仓期。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。

## § 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		
杨雅洁女士	本基金基金经理	2015-5-22	-	7 年	经济学硕士，2009 年 8 月加入大成基金管理有限公司，曾任固定收益部宏观利率研究员。2013 年 1 月 14 日至 2014 年 1 月 10 日任大成债券投资基金基金经理助理。2014 年 1 月 11 日起任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月 21 日起任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 22 日起任大成景鹏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》、《大成景鹏灵活配置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，大成景鹏灵活配置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

2016 年上半年,市场对宏观政策的预期出现较大波动。一季度随着大量信贷投放、基建投资的加快和房地产投资的回升,经济增长出现企稳反弹的迹象。同时,在库存周期、美联储鸽派的表态及对中国增长前景预期改善的共同影响下,大宗商品出现一波强劲反弹,通胀预期迅速升温。二季度权威人士定调宏观政策主线为“供给侧改革”,需求强刺激担忧消退,但货币政策放松的频率和力度也将大大下降。

市场表现来看,上半年债券市场波动较大。年初由于股市大跌,市场风险偏好骤降,叠加充裕的资金面,债券市场收益率明显下行。一季度末二季度初,信用事件和资金面紧张的共同作用带动债券市场收益率上行 60-100bp。随后受资金面宽松、经济数据低迷和英国脱欧等因素影响,市场风险偏好重新下降,债券收益率逐步下行。

上半年中债综合财富指数上涨 1.57%,其中一季度上涨 1.14%,二季度上涨 0.42%。类属资产方面,信用债表现好于利率债,长久期表现好于短久期。具体来看,利率债收益率曲线呈现平等上行,3-10 年上行约 10bp,1 年期品种上行 27bp。各评级短融收益率上行约 10bp,3-5 年中票收益率与去年底大致持平,城投收益率继续创出历史新低。今年以来信用事件明显增多,信用债定价的分化更加明显。

操作上,本基金对利率债进行了灵活操作,在控制组合久期的前期下加大了信用债的配置力



度，并维持了组合适当的杠杆水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，景鹏 A 基金份额资产净值为 1.066 元，本报告期景鹏 A 基金份额净值增长率为 6.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.29%，高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，在资金面厚度较为薄弱的背景下，中央银行维持宽松政策料将持续。但是需关注银行分红、缴税、公开市场操作以及汇率操作等对资金面的冲击。房地产投资下滑的可能性较大，叠加制造业低迷和消费疲软，经济增长维持低迷的概率较大。此外，近期信用债违约的现象不断出现，精选个券仍将是信用债投资的重中之重。2016 年下半年本基金将以信用债作为主要配置，保持一定的杠杆，并维持较低的组合久期。在控制仓位的前提下，积极投资长期利率品种，以期获得较高的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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：大成景鹏灵活配置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	188,019.16	38,119,181.91
结算备付金	48,701.69	7,296,940.41
存出保证金	110,949.63	568,323.07
交易性金融资产	5,918,000.00	2,166,317,062.69
其中：股票投资	-	27,537,560.89
基金投资	-	-
债券投资	5,918,000.00	2,138,779,501.80
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	4,500,000.00	1,273,321,635.83
应收证券清算款	201,013.56	158,919,549.40
应收利息	99,157.16	53,520,061.86
应收股利	-	-
应收申购款	1,988.07	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,067,829.27	3,698,062,755.17
<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	-	148,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	125,762.46	-
应付管理人报酬	8,421.17	2,699,985.09
应付托管费	1,403.50	449,997.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,687.94	560,800.88
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	296,796.06	95,000.00
负债合计	437,071.13	151,805,783.47
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	9,969,146.00	3,535,246,232.51
未分配利润	661,612.14	11,010,739.19
所有者权益合计	10,630,758.14	3,546,256,971.70
负债和所有者权益总计	11,067,829.27	3,698,062,755.17

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.066 元，基金份额总额 9,969,146.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景鹏灵活配置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 5 月 22 日(基金合同 生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	7,915,859.63	1,567,769.25
1. 利息收入	5,115,177.38	3,893,051.63
其中：存款利息收入	334,923.04	3,685,223.98
债券利息收入	3,343,445.34	16,312.04
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,436,809.00	191,515.61
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	25,702,377.54	-3,381,533.86
其中：股票投资收益	5,979,090.68	-3,426,546.36
基金投资收益	-	-
债券投资收益	19,723,286.86	-
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	-	45,012.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-24,272,270.70	1,043,478.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,370,575.41	12,772.82
<b>减：二、费用</b>	2,314,910.51	3,282,359.04
1. 管理人报酬	1,615,335.41	2,618,232.75
2. 托管费	269,222.58	436,372.13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	79,966.04	195,291.16
5. 利息支出	113,393.54	-
其中：卖出回购金融资产支出	113,393.54	-

6. 其他费用	236,992.94	32,463.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,600,949.12	-1,714,589.79
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,600,949.12	-1,714,589.79

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景鹏灵活配置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）	3,535,246,232.51	11,010,739.19	3,546,256,971.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,600,949.12	5,600,949.12
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）	-3,525,277,086.51	-15,950,076.17	-3,541,227,162.68
其中：1. 基金申购款	146,537,583.83	9,174,787.43	155,712,371.26
2. 基金赎回款	-3,671,814,670.34	-25,124,863.60	-3,696,939,533.94
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）	9,969,146.00	661,612.14	10,630,758.14
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 22 日（基金合同生效日）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）	2,066,854,883.62	-	2,066,854,883.62

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,714,589.79	-1,714,589.79
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）	4,458,807,690.48	-110,607.01	4,458,697,083.47
其中：1. 基金申购款	4,460,635,655.05	-109,889.84	4,460,525,765.21
2. 基金赎回款	-1,827,964.57	-717.17	-1,828,681.74
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）	6,525,662,574.10	-1,825,196.80	6,523,837,377.30

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于封闭式基金]/财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于开放式基金]、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月22日(基金合同生效日)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	14,817,776.97	47.91%	-	0.00%

##### 6.4.4.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	13,799.81	48.45%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月22日(基金合同生效日)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
-	-	0.00	-	0.00

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。

##### 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2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年5月22日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,615,335.41	2,618,232.75



其中：支付销售机构的客户维护费	33,345.96	1,115.50
-----------------	-----------	----------

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 0.90% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.90\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 5 月 22 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	269,222.58	436,372.13

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 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.4.2.3 销售服务费

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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 5 月 22 日(基金合同生效日)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	188,019.16	251,263.17	414,051,377.50	600,329.24

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

无。

## 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 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

金额单位：人民币元

6.4.5.1.2 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
127003	海印转债	2016 年 6 月 8 日	2016 年 7 月 1 日	未上市	100.00	100.00	100	10,000.00	10,000.00	-

## 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 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

无。

## 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## § 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	-	0.00
	其中：股票	-	0.00
2	固定收益投资	5,918,000.00	53.47
	其中：债券	5,918,000.00	53.47

	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	4,500,000.00	40.66
	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	236,720.85	2.14
7	其他各项资产	413,108.42	3.73
8	合计	11,067,829.27	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

无。

### 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

无。

## 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

无。

### 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	600050	中国联通	8,774,280.60	0.25
2	001979	招商蛇口	7,793,290.80	0.22
3	603508	思维列控	1,837,807.00	0.05
4	603866	桃李面包	1,407,371.35	0.04
5	002781	奇信股份	1,295,693.00	0.04
6	300496	中科创达	1,259,542.00	0.04
7	603999	读者传媒	1,034,651.70	0.03
8	300495	美尚生态	924,037.50	0.03
9	603996	中新科技	816,379.20	0.02
10	300494	盛天网络	618,849.00	0.02
11	002782	可立克	520,499.20	0.01

12	603778	乾景园林	506,226.00	0.01
13	300493	润欣科技	503,923.34	0.01
14	002786	银宝山新	496,041.30	0.01
15	603299	井神股份	441,061.12	0.01
16	300497	富祥股份	417,096.96	0.01
17	002787	华源包装	408,450.80	0.01
18	002780	三夫户外	391,546.80	0.01
19	002777	久远银海	349,740.82	0.01
20	300491	通合科技	344,839.95	0.01

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	-
卖出股票收入（成交）总额	30,931,082.74

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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	4,737,600.00	44.57
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	1,080,400.00	10.16
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
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）	100,000.00	0.94
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	5,918,000.00	55.67

#### 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	010107	21 国债(7)	25,000	2,702,000.00	25.42

2	018002	国开 1302	10,000	1,080,400.00	10.16
3	010303	03 国债(3)	10,000	1,035,700.00	9.74
4	019518	15 国债 18	10,000	999,900.00	9.41
5	132006	16 皖新 EB	900	90,000.00	0.85

#### 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

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

#### 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

基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

##### 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的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

## 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	110,949.63
2	应收证券清算款	201,013.56
3	应收股利	-
4	应收利息	99,157.16
5	应收申购款	1,988.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	413,108.42

## 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

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大成景鹏灵活配置混合 A	612	16,289.45	-	0.00%	9,969,146.00	100.00%
大成景鹏灵活配置混合 C	-	-	-	0.00%	-	0.00%
合计	612	16,289.45	-	0.00%	9,969,146.00	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	大成景鹏灵活配置混合 A	20,248.69	0.2031%
	大成景鹏灵活配置混合 C	-	0.0000%
	合计	20,248.69	0.2031%

### 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	大成景鹏灵活配置混合 A	0
	大成景鹏灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景鹏灵活配置混合 A	0
	大成景鹏灵活配置混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景鹏灵活配置混合 A	大成景鹏灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日）基金份额总额	2,066,854,883.62	-
本报告期期初基金份额总额	3,535,246,232.51	-
本报告期基金总申购份额	146,537,583.83	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,671,814,670.34	-
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	9,969,146.00	-

## § 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	
东兴证券	1	16,113,305.77	52.09%	14,683.97	51.55%	-
光大证券	2	14,817,776.97	47.91%	13,799.81	48.45%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-



红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	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%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、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。

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：爱建证券、东方证券、万和证券。

本报告期内退租交易单元：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	749,734.80	0.37%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	163,814,106.25	80.48%	8,167,000,000.00	97.07%	-	0.00%
华泰证券	106,440.00	0.05%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	425,532.12	0.21%	-	0.00%	-	0.00%
联讯证券	335,959.19	0.17%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	6,717,800.00	3.30%	7,500,000.00	0.09%	-	0.00%
银河证券	3,082,487.00	1.51%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	4,179,180.00	2.05%	52,000,000.00	0.62%	-	0.00%
中泰证券	15,006,586.40	7.37%	61,000,000.00	0.73%	-	0.00%
方正证券	129,159.10	0.06%	126,000,000.00	1.50%	-	0.00%
北京高华	9,004,200.00	4.42%	-	0.00%	-	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