

大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 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：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	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.....	43
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§ 9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	大成信用增利一年债券	
基金主代码	000426	
交易代码	000426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 1 月 28 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	74,054,279.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成信用增利一年债券 A	大成信用增利一年债券 C
下属分级基金的交易代码:	000426	000427
报告期末下属分级基金的份额总额	45,125,720.14 份	28,928,558.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资业绩，使基金份额持有人资产获得长期稳定的增值。
投资策略	<p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>本基金通过综合分析国内外宏观经济形势、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险和有关政策法规等因素，研判各类属固定收益类资产的预期收益和预期风险，确定各类金融资产的配置比例。本基金将灵活运用久期策略、收益率曲线策略、回购套利策略等多重投资策略，构建以信用债券为主的固定收益类资产组合。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p>
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
		林葛
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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	大成信用增利一年债券 A	大成信用增利一年债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,397,406.34	-2,329,573.85
本期利润	3,153,558.91	1,699,789.45
加权平均基金份额本期利润	0.0113	0.0085
本期加权平均净值利润率	1.07%	0.81%
本期基金份额净值增长率	1.52%	0.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,872,542.42	932,988.39
期末可供分配基金份额利润	0.0415	0.0323
期末基金资产净值	48,127,613.28	30,581,464.24
期末基金份额净值	1.067	1.057
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	26.72%	24.51%

注：1、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）。

2、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

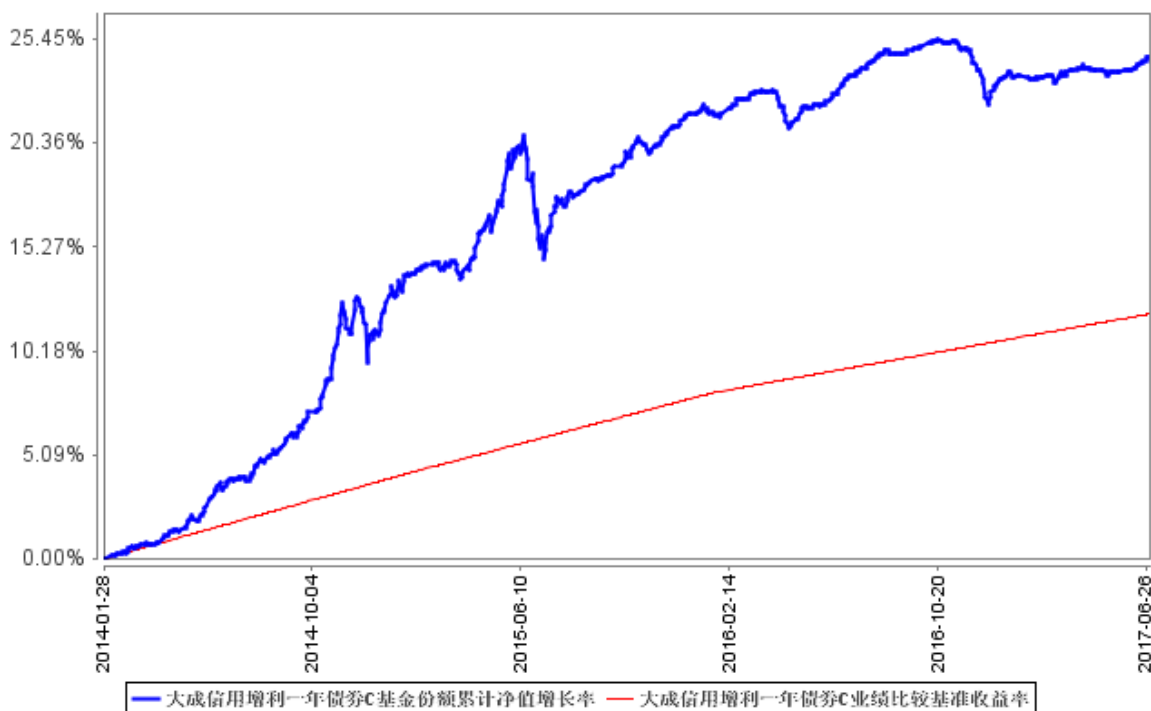
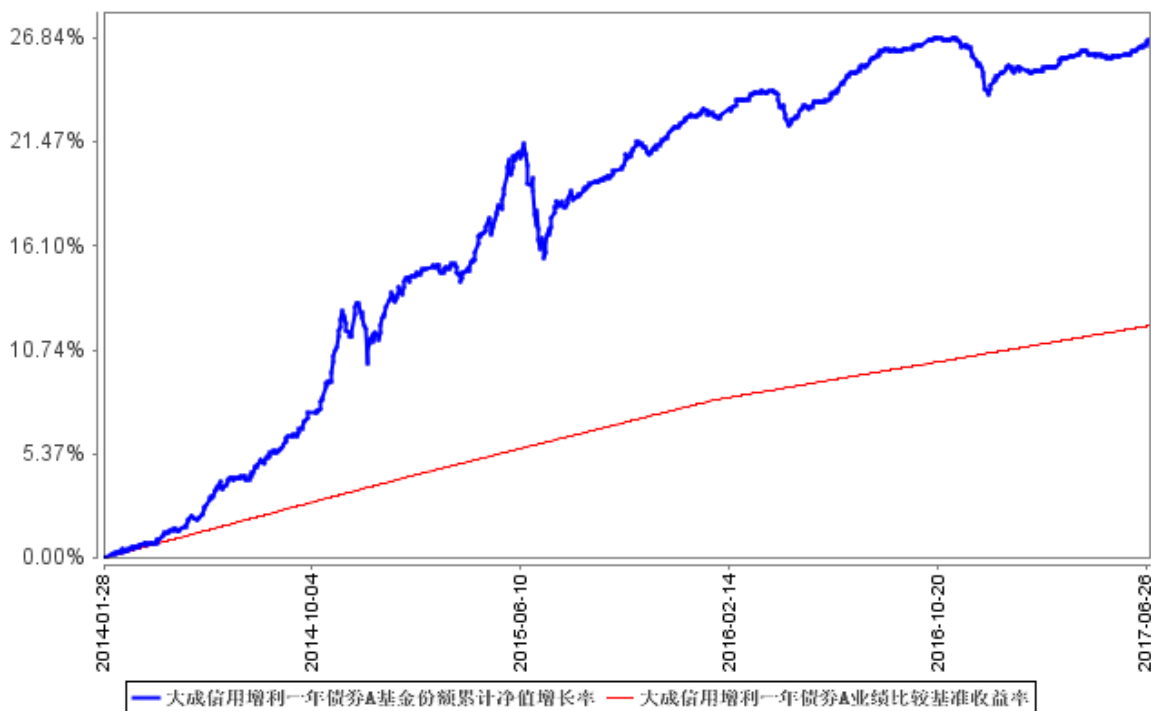
大成信用增利一年债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.57%	0.04%	0.20%	0.01%	0.37%	0.03%
过去三个月	0.66%	0.05%	0.60%	0.01%	0.06%	0.04%
过去六个月	1.52%	0.05%	1.21%	0.01%	0.31%	0.04%
过去一年	1.72%	0.07%	2.47%	0.01%	-0.75%	0.06%
过去三年	21.73%	0.17%	10.04%	0.01%	11.69%	0.16%
自基金合同生效起至今	26.72%	0.16%	11.99%	0.01%	14.73%	0.15%

大成信用增利一年债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.48%	0.04%	0.20%	0.01%	0.28%	0.03%
过去三个月	0.48%	0.04%	0.60%	0.01%	-0.12%	0.03%
过去六个月	0.96%	0.05%	1.21%	0.01%	-0.25%	0.04%
过去一年	0.96%	0.07%	2.47%	0.01%	-1.51%	0.06%
过去三年	19.84%	0.17%	10.04%	0.01%	9.80%	0.16%
自基金合同生效起至今	24.51%	0.16%	11.99%	0.01%	12.52%	0.15%

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



注：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日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%)。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2017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，4只QDII基金及74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

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		
朱哲先生	本基金基金经理	2016年9月6日	-	7年	中国社会科学院工商管理硕士，中国人民大学经济学学士。2009年7月至2010年9月任中国银行金融市场总部助理投资经理。2010年10月至2013年5月任嘉实基金交易部交易员。2013年5月至2015年7月任银华基金固定收益部基金经理。2015年8月加入大成基金管理有限公司，任固定

					<p>收益总部基金经理，自 2016 年 8 月 29 日起担任大成货币市场证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金和大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理，自 2016 年 9 月 6 日起任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金和大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 12 日起任大成添益交易型货币市场基金基金经理。具备基金从业资格。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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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 4 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 6 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

上半年宏观经济表现较好，在强于预期的房地产投资和进出口贸易的带动下，经济走势表现出了很强的韧性。政策方面，监管层采取了严厉的监管政策，导致债券市场大幅调整，而在稳健中性的货币政策下资金面也呈现高波动紧平衡状态。伴随着较强的监管政策，社会融资增速也大幅下降，M2 增速首次跌至个位数。伴随着季度末监管政策的放松，以及货币市场流动性的改善，二季度末债券市场经历了一波幅度不小的反弹。

操作上，在组合净值较少的情况下，主要配置了性价比较高的高等级信用债和存单，在保证组合流动性安全的同时保持了净值的持续增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成信用增利一年债券 A 基金份额净值为 1.067 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.52%；截至本报告期末大成信用增利一年债券 C 基金份额净值为 1.057 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.96%；同期业绩比较基准收益率为 1.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随着房地产调控的加强，以及基建投资高峰的过去，本轮经济的反弹高峰估计已经过去。由于人民币的企稳反弹，外汇占款的情况料将会较之前有所好转，因此国内流动性方面可能会受到一定支撑。政策方面，经过二季度市场大跌对社融影响的冲击，监管政策料将不会更加严厉，而货币政策也将继续保持稳健中性的态度，资金面的总体情况估计会比上半年有所好转。债券市场方面，经过连续三个季度的调整，目前市场收益率已经上行不少，利率债依然维持在高位，但是信用利差目前依然处在低位。因此利率债和高等级信用债依然有比较好的投资价值。

下半年我们将进一步加大市场投研分析，增加组合操作灵活性，提高流动性资产配置，择机参与

利率债波段交易；优选信用债，在降低信用风险前提下增强组合收益。

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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：大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	646,638.48	46,342,610.71
结算备付金		2,737,782.41	21,259,981.23
存出保证金		18,709.84	32,983.22
交易性金融资产	6.4.7.2	104,564,315.49	1,186,105,493.56
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		104,564,315.49	1,186,105,493.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	149,500,464.25
应收证券清算款		980,980.85	-
应收利息	6.4.7.5	1,699,720.49	16,496,592.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		110,648,147.56	1,419,738,125.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		31,699,877.65	140,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		38,688.27	650,008.71
应付托管费		12,896.09	216,669.54
应付销售服务费		10,022.29	181,463.09
应付交易费用	6.4.7.7	11,298.85	18,789.83

应交税费		-	-
应付利息		-7,274.01	29,845.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	173,560.90	150,000.00
负债合计		31,939,070.04	141,246,776.19
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	74,054,279.06	1,218,137,407.26
未分配利润	6.4.7.10	4,654,798.46	60,353,942.09
所有者权益合计		78,709,077.52	1,278,491,349.35
负债和所有者权益总计		110,648,147.56	1,419,738,125.54

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，大成信用增利 A 基金份额净值人民币 1.067 元，大成信用增利 C 基金份额净值人民币 1.057 元，基金份额总额 74,054,279.06 份，其中大成信用增利 A 基金份额 45,125,720.14 份，大成信用增利 C 基金份额 28,928,558.92 份。

6.2 利润表

会计主体：大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		8,376,100.70	19,449,492.94
1. 利息收入		11,005,359.10	24,641,083.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,170,660.75	585,060.19
债券利息收入		8,502,862.46	23,786,864.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,331,835.89	269,159.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,209,586.95	-705,605.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-12,209,586.95	-705,605.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,580,328.55	-4,485,985.00

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		3,522,752.34	8,986,475.02
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	1,564,324.43	2,892,900.48
2. 托管费	6.4.9.2.2	521,441.49	964,300.23
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	433,083.06	857,710.13
4. 交易费用	6.4.7.19	14,567.57	24,280.56
5. 利息支出		785,136.79	4,037,225.66
其中：卖出回购金融资产支出		785,136.79	4,037,225.66
6. 其他费用	6.4.7.20	204,199.00	210,057.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,853,348.36	10,463,017.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,853,348.36	10,463,017.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,218,137,407.26	60,353,942.09	1,278,491,349.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,853,348.36	4,853,348.36
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）	-1,144,083,128.20	-60,552,491.99	-1,204,635,620.19
其中：1. 基金申购款	1,250,296.72	64,405.70	1,314,702.42
2. 基金赎回款	-1,145,333,424.92	-60,616,897.69	-1,205,950,322.61
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）	74,054,279.06	4,654,798.46	78,709,077.52
项目	上年度可比期间 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）	360,049,649.04	80,206,168.51	440,255,817.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,463,017.92	10,463,017.92
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）	858,087,758.22	35,576,326.18	893,664,084.40
其中：1.基金申购款	1,163,198,531.16	46,853,046.56	1,210,051,577.72
2.基金赎回款	-305,110,772.94	-11,276,720.38	-316,387,493.32
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）	-	-67,834,547.18	-67,834,547.18
五、期末所有者权益（基金净值）	1,218,137,407.26	58,410,965.43	1,276,548,372.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀	周立新	崔伟
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

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

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一致。

6.4.2 税项

6.4.6.1 营业税、增值税、企业所得税

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、债券的差价收入，免征营业税。

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免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

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。

7.4.6.2 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。

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 2017年6月30日
活期存款	646,638.48
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	646,638.48

注：其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	38,442,922.74	37,651,315.49
	银行间市场	66,826,081.42	66,913,000.00
	合计	105,269,004.16	104,564,315.49
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	105,269,004.16	104,564,315.49	-704,688.67

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本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

本基金本期末无买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	246.86
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	1,108.80
应收债券利息	1,698,357.27
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	7.56
合计	1,699,720.49

6.4.3.6 其他资产

本基金本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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	11,298.85	18,789.83
合计	11,298.85	18,789.83

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017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	173,560.90
预提审计费	-
预提信息披露费	-
合计	173,560.90

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成信用增利一年债券 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	706,806,460.33	706,806,460.33
本期申购	293,867.48	293,867.48
本期赎回(以“-”号填列)	-661,974,607.67	-661,974,607.67
- 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	45,125,720.14	45,125,720.14

金额单位：人民币元

大成信用增利一年债券 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	511,330,946.93	511,330,946.93
本期申购	956,429.24	956,429.24
本期赎回(以“-”号填列)	-483,358,817.25	-483,358,817.25
- 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	28,928,558.92	28,928,558.92

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

大成信用增利一年债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,168,255.33	196,084.92	36,364,340.25
本期利润	-2,397,406.34	5,550,965.25	3,153,558.91
本期基金份额交易产生的变动数	-31,898,306.57	-4,617,699.45	-36,516,006.02
其中：基金申购款	12,706.34	3,878.10	16,584.44
基金赎回款	-31,911,012.91	-4,621,577.55	-36,532,590.46

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,872,542.42	1,129,350.72	3,001,893.14

单位：人民币元

大成信用增利一年债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,823,647.08	165,954.76	23,989,601.84
本期利润	-2,329,573.85	4,029,363.30	1,699,789.45
本期基金份额交易	-20,561,084.84	-3,475,401.13	-24,036,485.97
其中：基金申购款	28,174.25	19,647.01	47,821.26
基金赎回款	-20,589,259.09	-3,495,048.14	-24,084,307.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	932,988.39	719,916.93	1,652,905.32

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	54,503.26
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	62,668.32
其他	1,053,489.17
合计	1,170,660.75

注：其他存款利息收入为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款产生的利息收入。

6.4.3.12 股票投资收益

本基金报告期内无股票投资收益。

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,635,563,083.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,628,482,376.81
减：应收利息总额	19,290,293.38

买卖债券差价收入	-12,209,586.95
----------	----------------

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本基金报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	9,580,328.55
——股票投资	-
——债券投资	9,580,328.55
——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	-
合计	9,580,328.55

6.4.3.18 其他收入

本基金报告期内无其他收入。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	470.07

银行间市场交易费用	14,097.50
合计	14,567.57

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
其他	600.00
银行划款手续费	12,038.10
债券账户维护费	18,000.00
合计	204,199.00

6.4.3.21 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需披露分部报告。

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，本基金无需披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、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
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：（1） 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,564,324.43	2,892,900.48
其中：支付销售机构的客户维护费	341,690.58	610,681.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	521,441.49	964,300.23

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成信用增利一年 债券 A	大成信用增利一年 债券 C	合计
大成基金	-	62,907.24	62,907.24
中国农业银行	-	246,033.60	246,033.60
合计	-	308,940.84	308,940.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成信用增利一年 债券 A	大成信用增利一年 债券 C	合计
大成基金	-	506,886.90	506,886.90
中国农业银行	-	110,310.24	110,310.24
光大证券		-	-
合计	-	617,197.14	617,197.14

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.5.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日					
	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	-	97,440,173.97	-	-	-	-
上年度可比期间 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	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金份额。

6.4.5.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	646,638.48	54,503.26	919,685.25	123,149.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.6 利润分配情况

无。

6.4.7 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,699,877.65，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111709115	17 浦发银行 CD115	2017-7-3	97.79	50,000	4,889,500.00
合计	-	-	-	50,000	4,889,500.00

6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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人民币 27,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；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 2017 年 6 月 30 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 132.85%。(2016 年 6 月 30 日：100.85%)

6.4.8.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上期末 2016 年 12 月 31 日
A-1	6,988,800.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	59,910,917.09	662,089,000.00
合计	66,899,717.09	662,089,000.00

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在一年以内的超短融券和同业存单。

3. 债券投资以净价列示。

6.4.8.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上期末 2016 年 12 月 31 日
AAA	28,462,040.70	245,620,283.66
AAA 以下	9,202,557.70	278,396,209.90
未评级	-	-
合计	37,664,598.40	524,016,493.56

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 债券投资以净价列示。

6.4.8.3 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而带来的变现困难。本基金持有的大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。于本期末，所持证券均能及时变现。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投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日大部分为一个月以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.8.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.8.4 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。

6.4.8.4.1 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。

本基金持有的大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。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	646,638.48	-	-	-	646,638.48
结算备付金	2,737,782.41	-	-	-	2,737,782.41
存出保证金	18,709.84	-	-	-	18,709.84
交易性金融资产	77,335,713.50	21,173,401.99	6,055,200.00	-	104,564,315.49
应收证券清算款	-	-	-	980,980.85	980,980.85
应收利息	-	-	-	1,699,720.49	1,699,720.49
资产总计	80,738,844.23	21,173,401.99	6,055,200.00	2,680,701.34	110,648,147.56
负债					
卖出回购金融资产款	31,699,877.65	-	-	-	31,699,877.65
应付管理人报酬	-	-	-	38,688.27	38,688.27
应付托管费	-	-	-	12,896.09	12,896.09
应付销售服务费	-	-	-	10,022.29	10,022.29
应付交易费	-	-	-	11,298.85	11,298.85
应付利息	-	-	-	-7,274.01	-7,274.01
其他负债	-	-	-	173,560.90	173,560.90
负债总计	31,699,877.65	-	-	239,192.39	31,939,070.04
利率敏感度	49,038,966.58	21,173,401.99	6,055,200.00	2,441,508.95	78,709,077.52
上年度末 2016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	46,342,610.71	-	-	-	46,342,610.71
结算备付金	21,259,981.23	-	-	-	21,259,981.23
存出保证金	32,983.22	-	-	-	32,983.22
交易性金融资产	821,414,235.50	341,634,811.56	23,056,446.50	-	1,186,105,493.56
买入返售金融资产	149,500,464.25	-	-	-	149,500,464.25
应收利息	-	-	-	16,496,592.57	16,496,592.57
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,038,550,274.91	341,634,811.56	23,056,446.50	16,496,592.57	1,419,738,125.54
负债					
卖出回购金融资产款	140,000,000.00	-	-	-	140,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	650,008.71	650,008.71
应付托管费	-	-	-	216,669.54	216,669.54
应付销售服务费	-	-	-	181,463.09	181,463.09
应付交易费	-	-	-	18,789.83	18,789.83
应付利息	-	-	-	29,845.02	29,845.02
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	140,000,000.00	-	-	1,246,776.19	141,246,776.19

利率敏感度	898,550,274.91	341,634,811.56	23,056,446.50	15,249,816.38	1,278,491,349.35
-------	----------------	----------------	---------------	---------------	------------------

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

6.4.8.4.1.2 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 2017年6月30日	上期末 2016年12月31日
	利率上升25个基点	-190,000.00	-3,290,539.92
	利率下降25个基点	190,000.00	3,311,180.29

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.4.3 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。

基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%；开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

于2017年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资（2016年12月31日：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（2016年12月31日：同）。

6.4.9 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

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	104,564,315.49	94.50
	其中：债券	104,564,315.49	94.50
	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	-	0.00
	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	3,384,420.89	3.06
7	其他各项资产	2,699,411.18	2.44
8	合计	110,648,147.56	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	37,651,315.49	47.84
5	企业短期融资券	28,021,000.00	35.60
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	-	0.00
8	同业存单	38,892,000.00	49.41
9	其他	-	0.00
10	合计	104,564,315.49	132.85

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（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	111710281	17 兴业银行 CD281	100,000	9,889,000.00	12.56
2	111709115	17 浦发银行 CD115	100,000	9,779,000.00	12.42
3	111794346	17 广州农村商业银行 CD056	100,000	9,667,000.00	12.28
4	111780352	17 南京银行 CD127	100,000	9,557,000.00	12.14
5	136133	16 国电 01	78,000	7,684,560.00	9.76

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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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	18,709.84
2	应收证券清算款	980,980.85
3	应收股利	-
4	应收利息	1,699,720.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,699,411.18

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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。

§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
大成信用增利一年债券 A	1,427	31,622.79	-	0.00%	45,125,720.14	100.00%
大成信用增利一年债券 C	1,073	26,960.45	-	0.00%	28,928,558.92	100.00%
合计	2,500	29,621.71	-	0.00%	74,054,279.06	100.00%

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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	大成信用增利一年债券 A	0
	大成信用增利一年债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成信用增利一年债券 A	0
	大成信用增利一年债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成信用增利一年债券 A	大成信用增利一年债券 C
基金合同生效日（2014 年 1 月 28 日）基金份额总额	227,174,756.69	67,684,635.08
本报告期期初基金份额总额	706,806,460.33	511,330,946.93
本报告期基金总申购份额	293,867.48	956,429.24
减：本报告期基金总赎回份额	661,974,607.67	483,358,817.25
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	45,125,720.14	28,928,558.92

§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

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

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

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。

10.6 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	
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%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
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%	-
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%	-
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%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	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、本基金本报告期内新增席位：西藏东财证券、天风证券，瑞银证券。本报告期内本基金退租席位：长城证券。

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
国泰君安	15,029,501.15	8.69%	85,000,000.00	1.72%	-	0.00%
招商证券	119,081,540.89	68.83%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	38,887,507.55	22.48%	4,863,800,000.00	98.28%	-	0.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜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	2017年6月28日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得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	2017年6月27日
3	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017年6月21日
4	大成基金关于旗下部分基金	中国证监会指定报	2017年6月16日

	增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	刊及本公司网站	
5	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信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	2017 年 6 月 14 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
10	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 24 日
11	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 17 日
12	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海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	2017 年 5 月 12 日
13	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
14	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点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	2017 年 5 月 6 日
15	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
16	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日
17	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日

	票的公告		
18	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
19	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
20	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
21	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
22	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
23	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
24	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
25	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正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	2017 年 4 月 11 日
26	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
27	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜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	2017 年 3 月 31 日
28	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
29	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
30	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
31	关于增加北京恒天明泽基金	中国证监会指定报	2017 年 3 月 25 日

	销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	刊及本公司网站	
32	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
33	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 15 日
34	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 15 日
35	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
36	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙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	2017 年 3 月 7 日
37	大成信用增利一年定期开放基金开放申购赎回的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 22 日
38	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
39	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
40	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
41	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
42	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口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	2017 年 2 月 15 日
43	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
44	大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 21 日

	第 4 季度报告		
45	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
46	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任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	2017 年 1 月 17 日
47	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
48	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州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	2017 年 1 月 11 日
49	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
50	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
51	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170309-20170313	48,029,779.06	-	48,029,779.06	-	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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信用增利一年定期开放债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 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办公住所。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日