

大成景禄灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成景禄灵活配置混合	
基金主代码	003373	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	454,546.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成景禄灵活配置混合 A	大成景禄灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	003373	003374
报告期末下属分级基金的份额总额	8,188.44 份	446,357.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	张燕
	联系电话	0755-83183388	0755-83199084
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008885558	95555
传真		0755-83199588	0755-83195201

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	大成景禄灵活配置混合 A	大成景禄灵活配置混合 C	大成景禄灵活配置混合 A	大成景禄灵活配置混合 C
本期已实现收益	153.50	5,102,954.77	65.90	1,872,930.92
本期利润	1,289.76	11,564,303.75	-139.77	-4,589,348.65
加权平均基金份额本期利润	0.0833	0.0363	-0.0055	-0.0057
本期基金份额净值增长率	14.75%	14.82%	-0.55%	-0.57%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0108	0.0112	-0.0055	-0.0057
期末基金资产净值	9,344.82	509,614.29	25,324.12	795,623,023.46
期末基金份额净值	1.1412	1.1417	0.9945	0.9943

注：1、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。

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。

3.2 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

大成景禄灵活配置混合 A

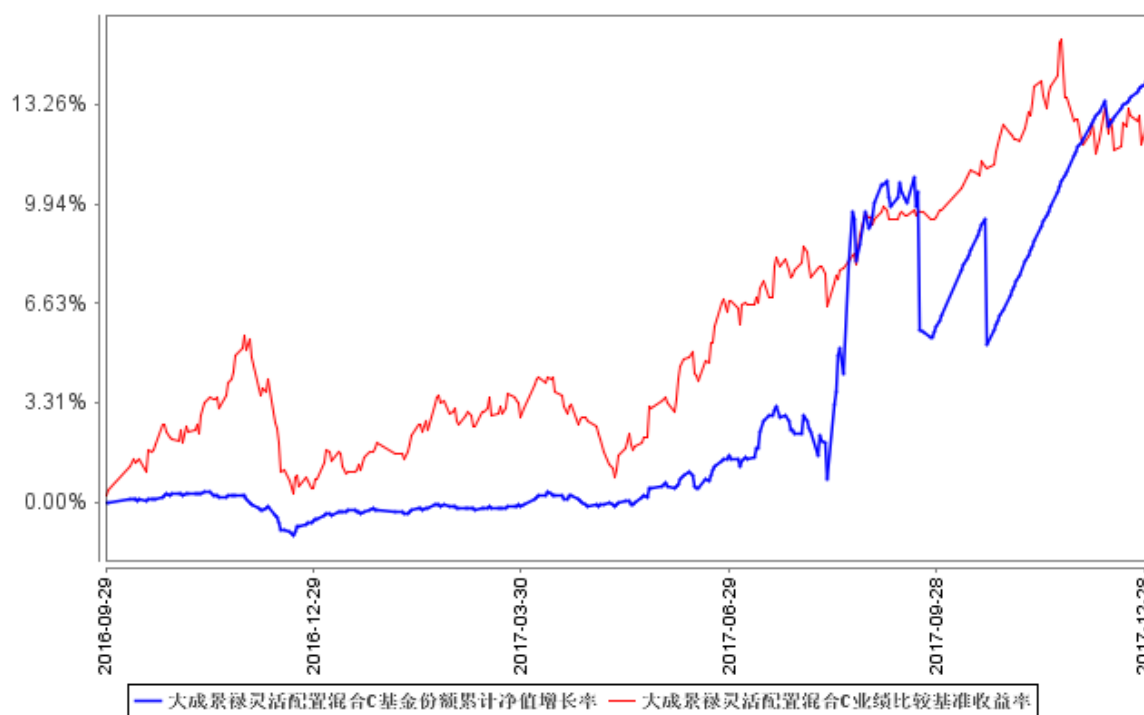
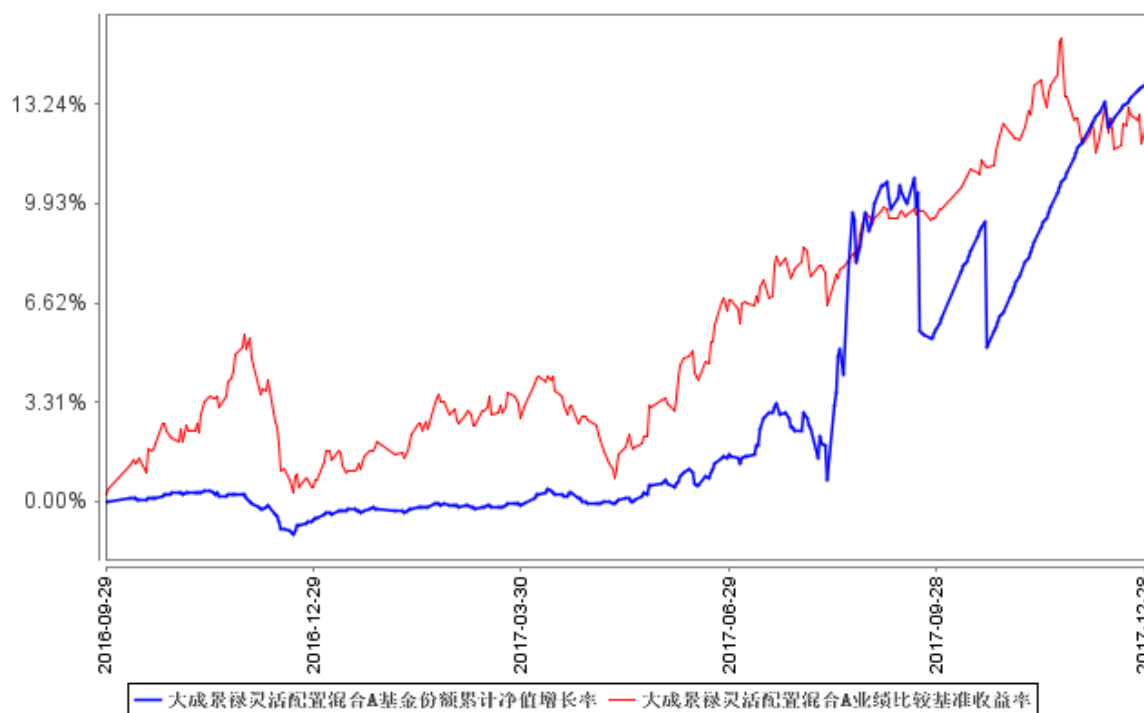
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.54%	0.56%	2.59%	0.45%	4.95%	0.11%
过去六个月	12.40%	0.75%	5.50%	0.39%	6.90%	0.36%
过去一年	14.75%	0.54%	11.72%	0.35%	3.03%	0.19%
自基金合同生效起至今	14.12%	0.49%	12.56%	0.36%	1.56%	0.13%

大成景禄灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.50%	0.56%	2.59%	0.45%	4.91%	0.11%
过去六个月	12.53%	0.75%	5.50%	0.39%	7.03%	0.36%
过去一年	14.82%	0.54%	11.72%	0.35%	3.10%	0.19%

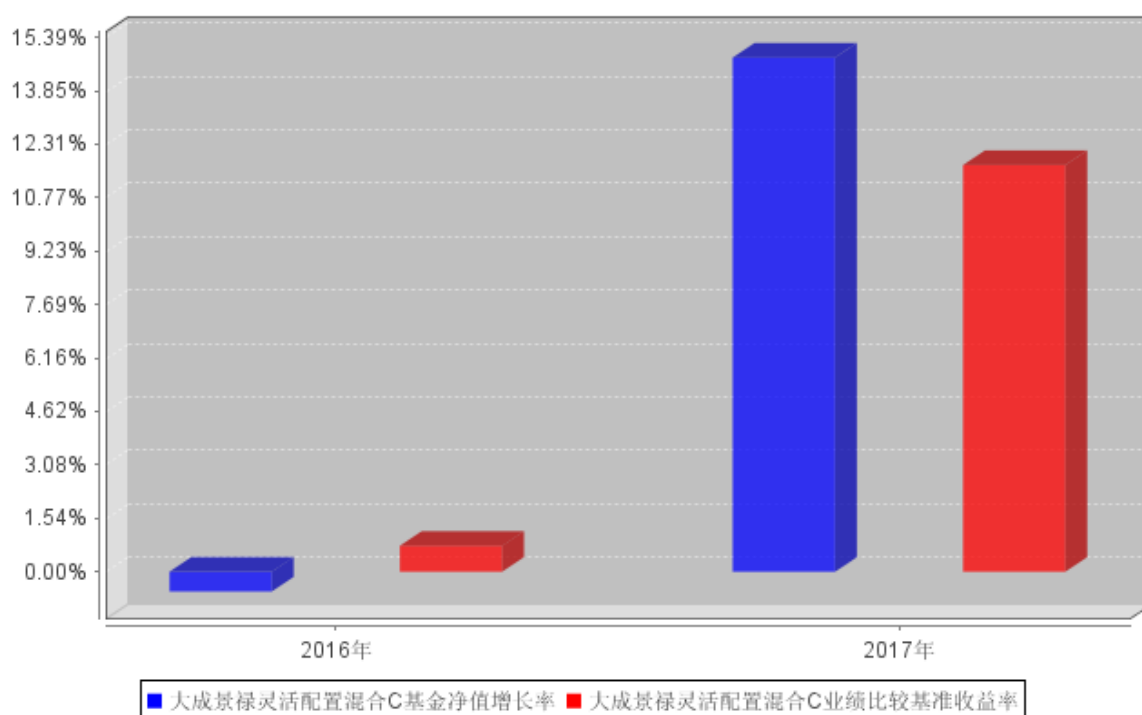
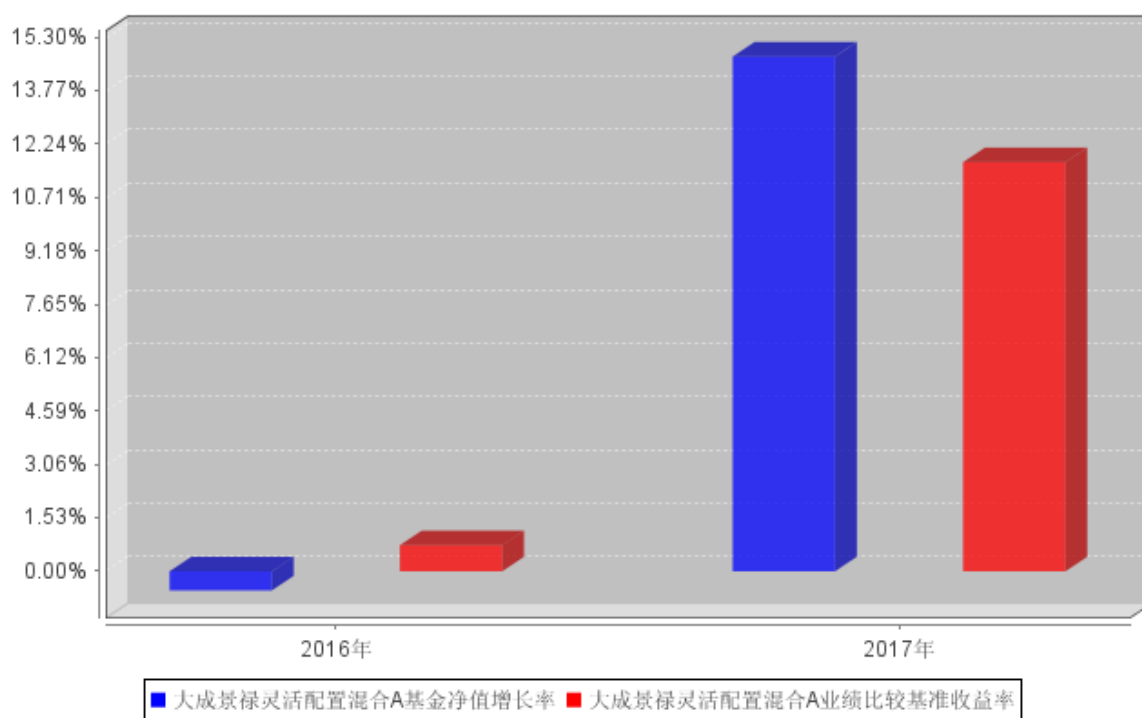
自基金合同生效起至今	14.17%	0.48%	12.56%	0.36%	1.61%	0.12%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

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。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。

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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。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12月31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76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		
黄万青女士	本基金基金经理	2016年9月29日	-	21年	经济学硕士。1999年5月加入大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员，固定收益部高级研究员。2010年4月7日至2013年3月7日任景宏证券投资基金基金经理。2011年7月13日至2013年3月7日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011年3月8日至2011年6月5日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月8日至2011年6月

					<p>5 日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 28 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 11 月 30 日至 2017 年 3 月 18 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 5 月 25 日起任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 6 日起任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2016 年 9 月 20 日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月 29 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月 25 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 18 日起担任大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>具有基金从业资格。 国籍：中国</p>
孙丹女士	本基金基金经理	2017 年 6 月 2 日	-	9 年	<p>2008 年-2012 年就职于景顺长城产品开发部任产品经理；</p> <p>2012 年-2014 年就职于华夏基金机构债券投资部任研究员；</p> <p>2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，历任固定收益部信用策略、宏观利率研究</p>

				<p>员。2016 年 5 月 5 日至 2017 年 5 月 8 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2016 年 5 月 25 日至 2017 年 5 月 8 日任大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理助理。2016 年 6 月 22 日至 2017 年 5 月 8 日任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理助理。2016 年 6 月 22 日至 2017 年 6 月 2 日任大成景秀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基金经理助理。</p> <p>2017 年 5 月 8 日起担任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金及大成景荣保本混合型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 31 日起担任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日起担任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 6 月 6 日起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。自 2018 年 3 月 14 日起</p>
--	--	--	--	---

					担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景沛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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 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 14 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

2017 年 A 股市场表现为震荡上行的格局，上证指数涨 6.56%，中小板综指跌 1.25%，创业板综指跌 15.32%，上证 50 指数最强，全年涨幅达 25.08%，市场风格以大盘蓝筹表现最优。从行业板块来看，食品饮料、家电、银行、钢铁、电子全年获得 20% 以上的收益，而纺织服装、传媒、综合、计算机、国防军工全年跌幅在 17% 以上，行业分化非常明显。本基金在 2017 年前 3 季度基本定制产品，权益仓位保持相对较低的水平运作，2017 年 9 月份巨额赎回之后，变成迷你基金，基本是按绝对收益的思路来操作。本年度本基金收益率 14.75%，达到年初既定的目标。

债券方面，中债综合财富（总值）指数全年仅上涨 0.24%，10 年国开上行 104bp，信用利差小幅扩大，但仍处于历史偏低水平。本基金在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。2017 年纯债部分以短久期和票息策略为主，主要持有中高等评级短久期信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景禄灵活配置混合 A 基金份额净值为 1.1412 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.75%；截至本报告期末大成景禄灵活配置混合 C 基金份额净值为 1.1417 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.82%；同期业绩比较基准收益率为 11.72%。

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 2018 年，我们对全年的股票市场相对乐观，认为 2018 年的股票市场价值和成长股都有不错的表现机会。从经济层面看，2018 年的经济增长速度将保持 2017 年的惯性，继续保持平稳的增长，企业的盈利能力将整体要好于 2017 年。从政策层面看，金融去杠杆还会延续，但大的风险点已经基本释放，金融行业的监管更有利于市场的长远发展。从资金层面看，2017 年的结构性牛市已经有了赚钱效应，更多的资金将开始转向股票市场。从行业层面来看，我们 2018 年更看好金融、地产、大消费、有色、传媒、计算机等行业板块的投资机会，个股将在以上行业中

重点选择。

债券方面，中短期内，由于经济回落幅度不大，中性的货币政策和金融强监管将持续。若无意外的结构性因素冲击，物价预计保持相对温和的上涨，工业品价格涨幅回落。组合策略方面，短期内，组合仍将延续短久期和票息策略。早些时候，积极关注债市趋势性转向的可能性。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成景禄灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	634,245.06	25,269,152.80
结算备付金	-	721,595.22
存出保证金	37,251.80	41,963.08
交易性金融资产	-	577,164,138.97
其中：股票投资	-	40,034,321.37
基金投资	-	-
债券投资	-	537,129,817.60
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	-	209,451,299.18
应收证券清算款	-	-
应收利息	165.01	6,558,517.24
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	671,661.87	819,206,666.49
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	22,610,687.26
应付赎回款	2,414.90	-
应付管理人报酬	203.68	404,530.93
应付托管费	50.95	101,132.73
应付销售服务费	33.23	67,419.68
应付交易费用	-	344,548.31
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,000.00	30,000.00
负债合计	152,702.76	23,558,318.91
所有者权益：		
实收基金	454,546.10	800,237,435.88
未分配利润	64,413.01	-4,589,088.30
所有者权益合计	518,959.11	795,648,347.58
负债和所有者权益总计	671,661.87	819,206,666.49

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，大成景禄灵活配置混合 A 基金份额净值人民币 1.1412 元，大成景禄灵活配置混合 C 基金份额净值人民币 1.1417 元，基金份额总额 454,546.10 份，其中大成景禄灵活配置混合 A 基金份额 8,188.44 份，大成景禄灵活配置混合 C 基金份额 446,357.66 份。

7.2 利润表

会计主体：大成景禄灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 9 月 29 日(基金合 同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	15,446,269.92	-2,183,082.99
1.利息收入	10,738,493.92	5,969,074.81
其中：存款利息收入	2,517,956.18	533,904.28
债券利息收入	6,581,144.34	2,561,581.54
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,639,393.40	2,873,588.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,754,745.92	-1,689,672.56
其中：股票投资收益	5,643,440.88	-1,651,957.71
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,035,326.80	-37,714.85
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	637,140.00	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,462,485.24	-6,462,485.24

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	36.68	-
减：二、费用	3,880,676.41	2,406,405.43
1. 管理人报酬	1,974,274.07	1,219,317.90
2. 托管费	493,568.58	304,829.49
3. 销售服务费	329,029.64	203,213.17
4. 交易费用	672,583.89	567,826.44
5. 利息支出	156,414.86	47,667.07
其中：卖出回购金融资产支出	156,414.86	47,667.07
6. 其他费用	254,805.37	63,551.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	11,565,593.51	-4,589,488.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	11,565,593.51	-4,589,488.42

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景禄灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	800,237,435.88	-4,589,088.30	795,648,347.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,565,593.51	11,565,593.51
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）	-799,782,889.78	-6,912,092.20	-806,694,981.98
其中：1. 基金申购款	395,051.76	44,876.81	439,928.57
2. 基金赎回款	-800,177,941.54	-6,956,969.01	-807,134,910.55
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	454,546.10	64,413.01	518,959.11

项目	上年度可比期间		
	2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
(基金净值)			
一、期初所有者权益 (基金净值)	800,287,447.87	-	800,287,447.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,589,488.42	-4,589,488.42
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)	-50,011.99	400.12	-49,611.87
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-50,011.99	400.12	-49,611.87
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)	800,237,435.88	-4,589,088.30	795,648,347.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 罗登攀 周立新 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

7.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

7.4.2.1 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。

7.4.2.2 增值税、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。

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。

7.4.2.3 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。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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) 根据本基金管理人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。大成基金原股东广东证券股份有限公司自 2016 年 4 月 25 日起不再为本基金关联方。

(2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.4.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.4.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.4.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,974,274.07	1,219,317.90
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：(1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

(2) 于 2017 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 203.68 元。（2016 年 12 月 31 日：人民币 404,530.93 元）。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	493,568.58	304,829.49

注：(1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.15% 年

费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

(2) 于 2017 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 50.95 元。(2016 年 12 月 31 日：人民币 101,132.73 元)。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景禄灵活配置 混合 A	大成景禄灵活配置 混合 C	合计
大成基金	-	329,029.64	329,029.64
合计	-	329,029.64	329,029.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景禄灵活配置 混合 A	大成景禄灵活配置 混合 C	合计
大成基金	-	203,213.17	203,213.17
合计	-	203,213.17	203,213.17

注：1) 基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。基金销售服务费每日计算，按月支付。

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按前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

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

2) 本期末本基金应付大成基金基金销售服务费为人民币 33.23 元。上期末本基金应付大成基金基金销售服务费为人民币 67,419.68 元。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自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均未运用自有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期及上年度可比期间均未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日) 至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	634,245.06	40,137.65	25,269,152.80	253,475.79

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 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均无其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	0.00
	其中：股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	634,245.06	94.43
8	其他各项资产	37,416.81	5.57
9	合计	671,661.87	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金期无境内股票投资。

8.2.2 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港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本报告期末本基金期无境内股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601628	中国人寿	19,002,807.14	2.39
2	601318	中国平安	15,289,449.53	1.92
3	601336	新华保险	11,549,206.70	1.45
4	601601	中国太保	11,400,667.61	1.43
5	600048	保利地产	9,761,369.00	1.23

6	600000	浦发银行	7,710,200.77	0.97
7	601166	兴业银行	7,597,338.00	0.95
8	601989	中国重工	6,322,912.00	0.79
9	601668	中国建筑	5,783,000.00	0.73
10	601211	国泰君安	5,720,319.84	0.72
11	601390	中国中铁	5,562,000.00	0.70
12	600887	伊利股份	5,506,636.00	0.69
13	600518	康美药业	5,392,742.97	0.68
14	600109	国金证券	4,044,457.00	0.51
15	600111	北方稀土	3,889,932.00	0.49
16	000538	云南白药	3,510,736.20	0.44
17	600340	华夏幸福	3,476,599.00	0.44
18	601111	中国国航	3,404,500.00	0.43
19	000423	东阿阿胶	3,285,051.00	0.41
20	601985	中国核电	3,265,500.00	0.41

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601628	中国人寿	21,461,392.02	2.70
2	601318	中国平安	19,799,054.00	2.49
3	601336	新华保险	16,753,468.77	2.11
4	601601	中国太保	13,633,191.88	1.71
5	600048	保利地产	9,840,000.00	1.24
6	601211	国泰君安	8,894,635.00	1.12
7	601166	兴业银行	8,132,779.00	1.02
8	600000	浦发银行	8,041,168.00	1.01
9	601989	中国重工	7,362,370.00	0.93
10	600887	伊利股份	6,359,627.00	0.80
11	600518	康美药业	6,236,717.02	0.78
12	601668	中国建筑	6,082,000.00	0.76
13	601390	中国中铁	5,316,645.23	0.67
14	601985	中国核电	4,337,688.15	0.55
15	600109	国金证券	3,987,462.00	0.50
16	601633	长城汽车	3,741,506.00	0.47
17	600111	北方稀土	3,628,427.98	0.46

18	601111	中国国航	3,605,000.00	0.45
19	000538	云南白药	3,592,999.99	0.45
20	600023	浙能电力	3,486,000.00	0.44

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	191,094,370.39
卖出股票收入（成交）总额	236,705,171.34

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,251.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,416.81

8.12.4 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。

8.12.5 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无流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大成景禄灵活配置混合 A	105	77.99	-	0.00%	8,188.44	100.00%
大成景禄灵活配置混合 C	141	3,165.66	-	0.00%	446,357.66	100.00%
合计	246	1,847.75	-	0.00%	454,546.10	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。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成景禄灵活配置混合 A	4,140.25	50.5621%
	大成景禄灵活配置混合 C	58,058.00	13.0071%
	合计	62,198.25	13.6836%

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	大成景禄灵活配置混合 A	0~10
	大成景禄灵活配置混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景禄灵活配置混合 A	0
	大成景禄灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景禄灵活配置混合 A	大成景禄灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 29 日）基金份额总额	25,464.87	800,261,983.00
本报告期期初基金份额总额	25,463.88	800,211,972.00
本报告期基金总申购份额	2,793.01	392,258.75
减：本报告期基金总赎回份额	20,068.45	800,157,873.09
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	8,188.44	446,357.66

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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。

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。

3、基金管理人于 2017 年 8 月 12 日发布了《大成基金管理有限公司督察长任职公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十七次会议审议通过，赵冰女士自 2017 年 8 月 11 日担任公司督察长，总经理罗登攀不再代为履行督察长职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 3 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内公司收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）

《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改行政监管措施的决定》，责令公司在三个月内对货币基金单一持有人持有比例过高的情况进行整改，并对相关责任人采取行政监管措施。截止目前，公司已经制定并落实相关整改措施，并向深圳证监局提交整改报告。

2、报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	1400,714,216.63	93.68%	365,172.44	93.68%	-
国信证券	1	27,035,512.39	6.32%	24,638.31	6.32%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本基金本报告期内租用交易单元未发生变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
招商证券	31,381,436.02	71.68%	995,600,000.00	96.43%	-	0.00%

国信证券	12,399,459.84	28.32%	36,900,000.00	3.57%	-	0.00%
------	---------------	--------	---------------	-------	---	-------

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20170101-20170926	800,000,000.00	-	800,000,000.00	-	0.00%
个人	1	20170927-20171128	-	46,274.88	-	46,274.88	10.18%
	2	20170927-20171128	-	46,274.87	-	46,274.87	10.18%
	3	20170927-20171128	-	45,678.79	-	45,678.79	10.05%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司

2018年3月31日