

# 大成景安短融债券型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 29 日

## 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成景安短融债券		
基金主代码	000128		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 5 月 24 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	3,150,948,014.75 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
下属分级基金的交易代码	000128	000129	002086
报告期末下属分级基金的份额总额	2,126,444,777.64 份	824,588,041.05 份	199,915,196.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持流动性的基础上，主要通过对短期融资券和其他固定收益类证券的积极主动管理，力争超越同期银行定期存款利率、获取绝对回报。
投资策略	本基金主要目标是在努力保持本金稳妥、高流动性特点的同时，通过适当延长基金投资组合的久期、更高比例的短期融资券以及其它期限较短信用债券的投资，争取获取更高的投资收益。
业绩比较基准	中债短融总指数
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金，但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	赵冰	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@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、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	2018 年			2017 年			2016 年		
	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
本期已实现收益	23,856,106.49	18,553,876.53	8,804,114.53	3,234,110.24	2,869,706.66	9,690,529.99	3,925,677.04	17,931,420.14	4,437,356.78
本期利息	26,776,894.16	21,237,286.18	10,920,918.33	3,848,439.38	3,559,373.93	12,545,904.05	2,863,588.74	15,404,170.49	-202,437.72

润									
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0389	0.0489	0.0564	0.0549	0.0497	0.0606	0.0169	0.0270	- 0.0008
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	4.61%	4.92%	4.82%	4.94%	5.24%	5.16%	1.45%	1.82%	1.41%
3. 1. 2 期 末 数	2018 年末			2017 年末			2016 年末		

据和指标									
期末可供分配基金份额利润	0.1632	0.1853	0.1711	0.2250	0.2427	0.2300	0.1775	0.1910	0.1798
期末基金资产净值	2,570,394,571.36	1,015,296,575.02	243,225,883.32	140,160,329.58	53,152,342.06	185,309,103.28	107,701,384.21	40,315,009.05	433,693,328.83
期末基金份额净值	1.2088	1.2313	1.2166	1.2573	1.2752	1.2623	1.1981	1.2117	1.2004

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

大成景安短融债券 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
过去三个月	0.70%	0.02%	1.06%	0.02%	-0.36%	0.00%
过去六个月	1.74%	0.02%	2.51%	0.02%	-0.77%	0.00%
过去一年	4.61%	0.03%	5.08%	0.02%	-0.47%	0.01%
过去三年	11.37%	0.04%	12.99%	0.02%	-1.62%	0.02%
过去五年	28.45%	0.06%	25.79%	0.02%	2.66%	0.04%
自基金合同 生效起至今	31.53%	0.05%	28.48%	0.03%	3.05%	0.02%

## 大成景安短融债券 B

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	0.78%	0.02%	1.06%	0.02%	-0.28%	0.00%
过去六个月	1.89%	0.02%	2.51%	0.02%	-0.62%	0.00%
过去一年	4.92%	0.03%	5.08%	0.02%	-0.16%	0.01%
过去三年	12.43%	0.04%	12.99%	0.02%	-0.56%	0.02%
过去五年	30.66%	0.06%	25.79%	0.02%	4.87%	0.04%
自基金合同 生效起至今	33.79%	0.06%	28.48%	0.03%	5.31%	0.03%

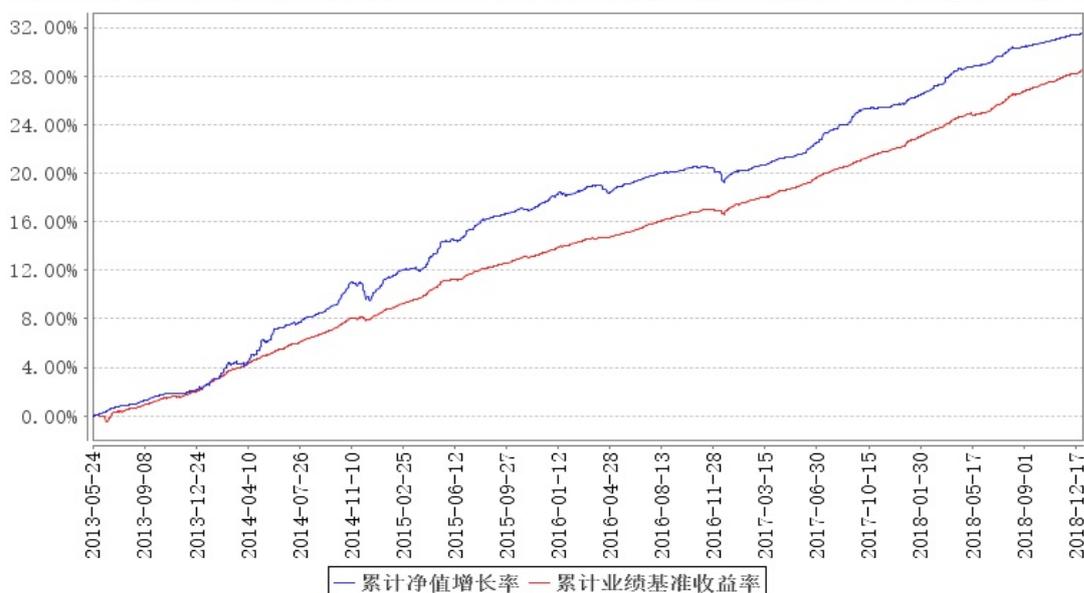
## 大成景安短融债券 E

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	0.75%	0.02%	1.06%	0.02%	-0.31%	0.00%
过去六个月	1.84%	0.02%	2.51%	0.02%	-0.67%	0.00%

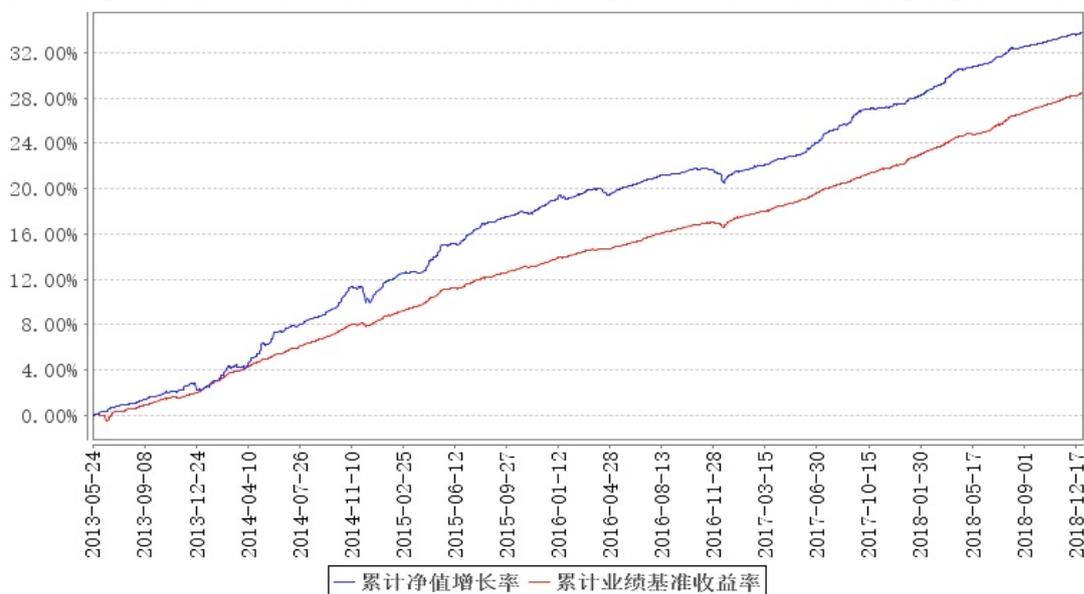
过去一年	4.82%	0.03%	5.08%	0.02%	-0.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	11.78%	0.04%	12.73%	0.02%	-0.95%	0.02%

### 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

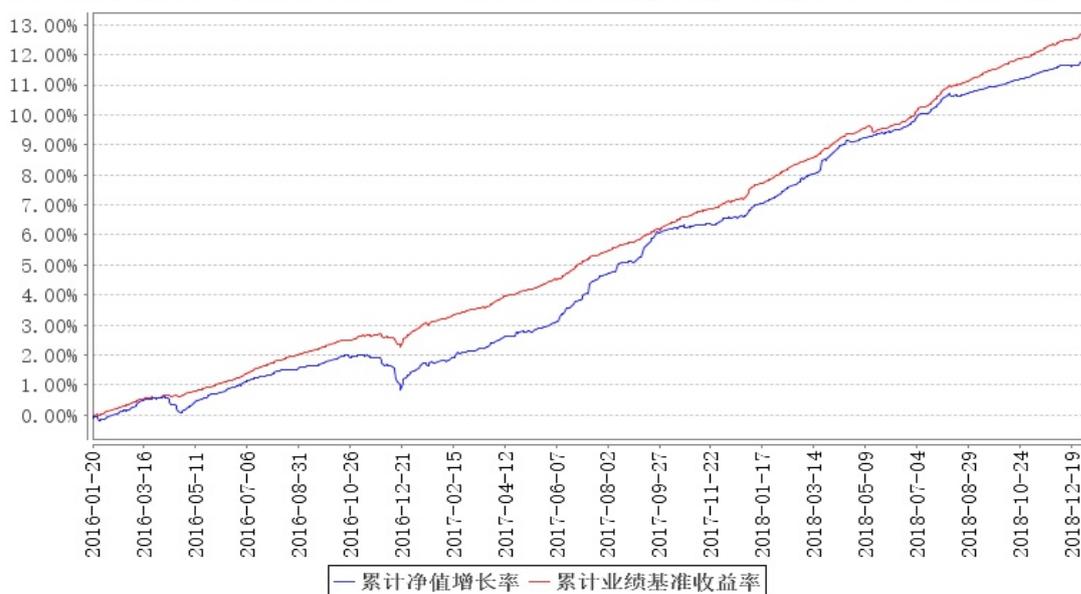
大成景安短融债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成景安短融债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



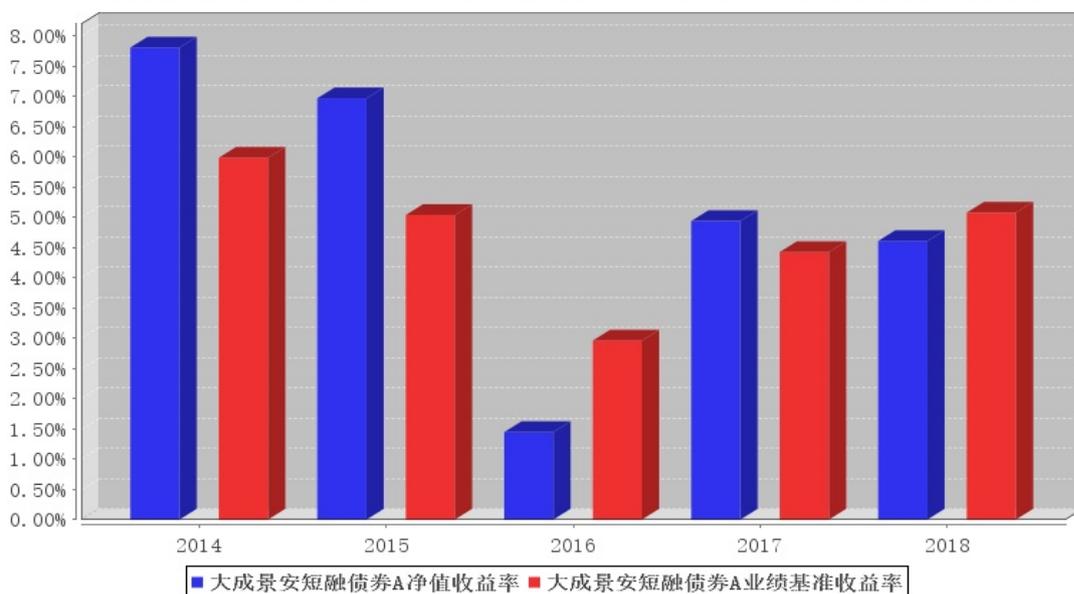
大成景安短融债券E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



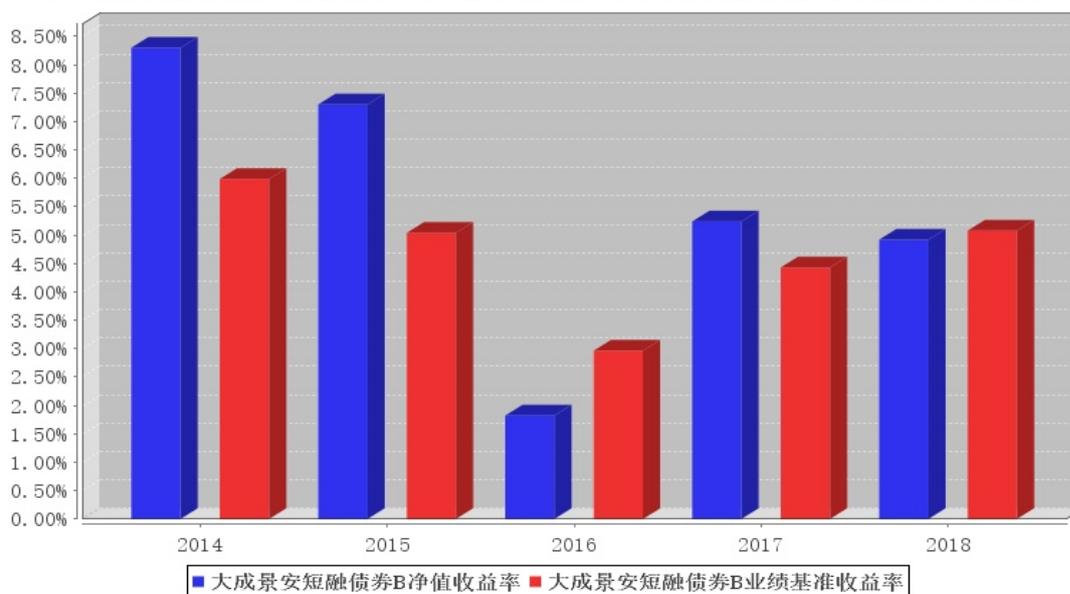
注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 过去五年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

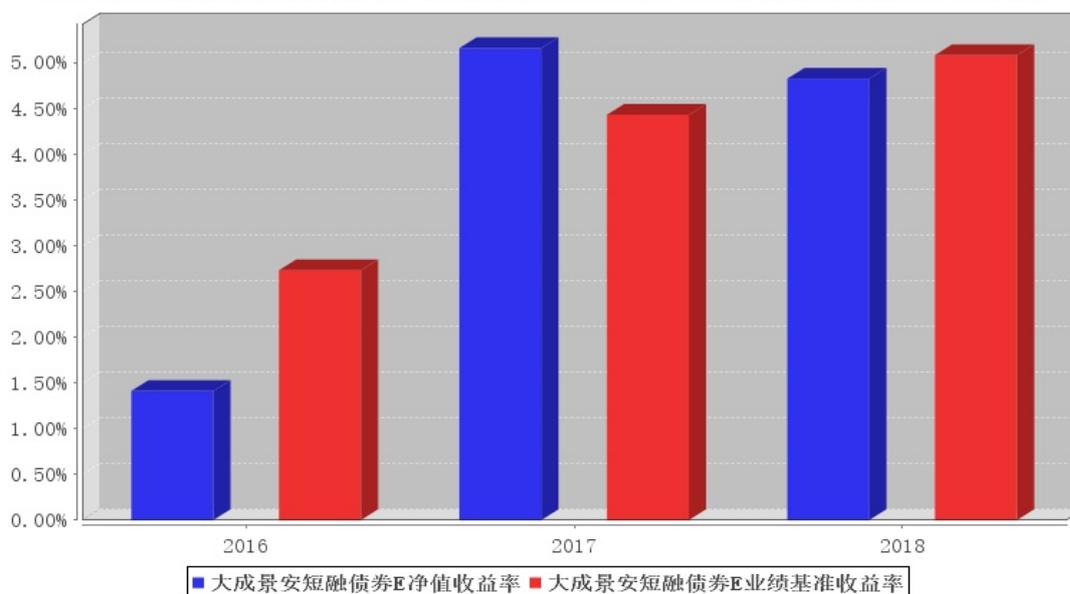
大成景安短融债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成景安短融债券B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成景安短融债券E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

单位：人民币元

大成景安短融债券 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	1.0500	58,979,537.73	13,777,772.85	72,757,310.58	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	1.0500	58,979,537.73	13,777,772.85	72,757,310.58	

大成景安短融债券 B

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2018 年	1.0500	50,061,601.3 9	9,578,029.54	59,639,630.9 3	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	1.0500	50,061,601.3 9	9,578,029.54	59,639,630.9 3	

大成景安短融债券 E

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2018 年	1.0500	14,760,303.1 9	5,688,351.65	20,448,654.8 4	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	1.0500	14,760,303.1 9	5,688,351.65	20,448,654.8 4	

## § 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经二十年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2018 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 81 只。

#### 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	本基金基金经理	2018 年 3 月 14 日	-	9	<p>工商管理硕士。</p> <p>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。</p> <p>2010 年 10 月至 2013 年 5 月任嘉实基金交易部交易员。</p> <p>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，任固定收益总部基金经理。2016 年 8 月 29 日起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。</p> <p>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。</p> <p>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。2018 年 3 月 14 日起任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月 16 日起任大成景禄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</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。
- 3、欧阳亮女士自 2019 年 1 月 25 日起增聘为本基金基金经理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

#### 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、业绩评估等与投资管理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 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 3 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数

据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年国内经济总体运行平稳，全年 GDP 增长 6.6%，增速较 2017 年略有下行。从全年来看，受复杂的外部环境影响，经济下行压力逐渐增大。从需求端来看，全年固定资产投资增速为 5.9%，在四季度有所企稳；消费方面，社会消费品零售总额同比增速逐步下行；出口方面，受中美贸易摩擦影响，出口增速四季度出现了明显的下降。物价方面，CPI 仍然保持在较低水平，PPI 全年上涨 3.5%，较 2017 年大幅回落。经济下行叠加原油等大宗商品价格由上涨转向大幅下跌，市场对通胀的预期由滞涨转向通缩。

从货币政策来看，央行继续实施稳健偏宽松的货币政策，全年进行了四次定向降准以及开展 MLF 操作，提供中长期流动性约 6 万亿，银行间流动性总体保持充裕。但货币政策传导路径不太顺畅，实体经济融资仍然受限，M2 和社融增速继续下滑。受经济基本面走弱和银行间流动性充裕影响，2018 年债券市场表现较好，收益率显著下行，10 年期国债收益率全年下行约 65bp。短端利率下行幅度更为明显，3 个月 Shibor 从年初的 4.91% 附近大幅下行至年底的 3.35% 附近。

2018 年本基金继续采取稳健的投资策略，维持较短的久期，以获取票息收益为主。在信用策略上，主要投资 AAA 短融，规避信用风险。通过灵活的利率债策略，力争获取超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景安短融债券 A 的基金份额净值为 1.2088 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.61%；截至本报告期末大成景安短融债券 B 的基金份额净值为 1.2313 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.92%；截至本报告期末大成景安短融债券 E 的基金份额净值为 1.2166 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.82%；同期业绩比较基准收益率为 5.0800%。

#### 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 2019 年，受复杂多变的外部环境影响，国内经济依然面临较大的下行压力，“宽货币”能否向“宽信用”传导还有待观察，预计货币政策继续保持宽松，财政政策将更加积极，基建投资将继续充当经济的稳定器。经济基本面和货币政策取向依然有利于债券市场，我们对 2019 年的债券市场依然较为乐观。另一方面，由于 2018 年以来债市收益率下行幅度较大，对市场可能的调整我们也时刻保持足够的警惕。在投资策略上，我们将继续采取稳健的投资策略，选择较好的配置时点进行资产配置以获取较高的票息收益，同时通过灵活的久期调整策略，力争为持有人赚取超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、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五名投资组合经理。

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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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。本报告期内大成景安 A 已分配利润 72,757,310.58 元、大成景安 B 已分配利润 59,639,630.93 元、大成景安 E 已分配利润 20,448,654.84 元（A 类每十份基金份额分红 1.050 元，B 类每十份基金份额分红 1.050 元，E 类每十份基金份额分红 1.050 元），符合基金合同规定的分红比例。

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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 审计报告

本基金 2018 年年度财务报表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：大成景安短融债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	5,255,860.01	17,873,518.36
结算备付金	-	1,608,059.30
存出保证金	24,608.59	3,007.30
交易性金融资产	3,979,205,197.70	464,123,887.60
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,979,205,197.70	464,123,887.60
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	10,044,135.07	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	45,719,316.83	6,182,708.76
应收股利	-	-
应收申购款	161,700,980.71	11,341,559.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,201,950,098.91	501,132,740.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	369,788,725.31	117,017,651.47
应付证券清算款	-	1,039,131.03
应付赎回款	-	3,834,121.58
应付管理人报酬	1,167,859.02	128,068.40
应付托管费	408,750.67	44,823.96
应付销售服务费	566,040.06	47,730.07
应付交易费用	45,880.21	18,857.03
应交税费	295,928.71	-
应付利息	499,885.23	120,582.07
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,000.00	260,000.00
负债合计	373,033,069.21	122,510,965.61
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,150,948,014.75	299,960,335.28
未分配利润	677,969,014.95	78,661,439.64
所有者权益合计	3,828,917,029.70	378,621,774.92

负债和所有者权益总计	4,201,950,098.91	501,132,740.53
------------	------------------	----------------

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.2088 元，B 类基金份额净值 1.2313 元，E 类基金份额净值 1.2166 元。基金份额总额 3,150,948,014.75 份，其中 A 类基金份额 2,126,444,777.64 份；B 类基金份额 824,588,041.05 份；E 类基金份额 199,915,196.06 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成景安短融债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	76,538,731.67	26,208,296.90
1. 利息收入	69,461,025.76	19,970,252.76
其中：存款利息收入	72,550.21	551,000.01
债券利息收入	68,214,937.36	18,530,123.23
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,173,538.19	889,129.52
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,057,499.92	2,037,396.72
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,057,499.92	2,037,396.72
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7,721,001.12	4,159,370.47
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	1,414,204.71	41,276.95
减：二、费用	17,603,633.00	6,254,579.54
1. 管理人报酬	6,481,327.66	1,738,095.11
2. 托管费	2,268,464.74	608,333.34
3. 销售服务费	2,810,287.81	524,310.23
4. 交易费用	60,262.68	65,596.61
5. 利息支出	5,312,542.60	2,870,678.56
其中：卖出回购金融资产支出	5,312,542.60	2,870,678.56
6. 税金及附加	213,499.63	-
7. 其他费用	457,247.88	447,565.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填)	58,935,098.67	19,953,717.36

列)		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	58,935,098.67	19,953,717.36

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景安短融债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	299,960,335.28	78,661,439.64	378,621,774.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,935,098.67	58,935,098.67
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）	2,850,987,679.47	693,218,072.99	3,544,205,752.46
其中：1. 基金申购款	9,877,774,811.35	2,319,039,289.00	12,196,814,100.35
2. 基金赎回款	-7,026,787,131.88	-1,625,821,216.01	-8,652,608,347.89
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）	-	-152,845,596.35	-152,845,596.35
五、期末所有者权益（基金净值）	3,150,948,014.75	677,969,014.95	3,828,917,029.70
项目	上年度可比期间 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）	484,466,748.11	97,242,973.98	581,709,722.09

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,953,717.36	19,953,717.36
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）	-184,506,412.83	-38,535,251.70	-223,041,664.53
其中：1. 基金申购款	1,231,368,535.99	278,820,118.82	1,510,188,654.81
2. 基金赎回款	-1,415,874,948.82	-317,355,370.52	-1,733,230,319.34
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）	299,960,335.28	78,661,439.64	378,621,774.92

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

刘亚林

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 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。

#### 7.4.2.2 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业及金融机构在向基金派发的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。

#### 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、基金销售机构、注册登记机构
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: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

##### 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

无。

###### 7.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	25,730,932.20	6.80	100,746,062.20	83.26

###### 7.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	1,843,800,000.00	75.40	6,791,400,000.00	74.59

###### 7.4.4.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,481,327.66	1,738,095.11
其中：支付销售机构的客户维护费	2,236,549.34	583,334.83

注：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0.40%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,268,464.74	608,333.34

注：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0.14%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.14\% / \text{当年天数}$$

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

##### 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 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E	合计

大成基金	33,364.16	42,797.53	108.74	76,270.43
光大证券	91.38	-	-	91.38
中国农业银行	482,971.98	2,289.24	-	485,261.22
合计	516,427.52	45,086.77	108.74	561,623.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E	合计
大成基金	9,582.90	6,103.66	-	15,686.56
光大证券	0.18	-	-	0.18
中国农业银行	155,892.81	2,076.42	-	157,969.23
合计	165,475.89	8,180.08	-	173,655.97

注：本基金分设三级基金份额：A级基金份额、B级基金份额和E类基金份额。本基金对各类基金份额设置不同的销售服务费率。本基金A级基金份额的销售服务年费率为0.30%，B级基金份额的年费率为0.01%，E级基金份额的年费率为0.10%。在通常情况下，某级的销售服务费按前一日该级基金资产净值计提。计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金财产净值

R为该级基金对应的销售服务费年费率

#### 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

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31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	10,011,660.00	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	-	-	-	-	-	-

## 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

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日
	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
基金合同生效日（ 2013年5月24日） 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份 额	-	52,073,004.15	-
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	-	52,073,004.15	-
期末持有的基金份 额 占基金总份额比例	0.0000%	1.6526%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至 2017年12月31日
	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
基金合同生效日（ 2013年5月24日） 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份 额	-	-	-
期间申购/买入总份 额	-	-	-
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	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%	0.0000%

注：(1) 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

(2) 基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 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

无。

#### 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 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国农业银行	5,255,860.01	50,682.71	17,873,518.36	54,893.89

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.5 期末(2018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

无。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

截至本报告期末，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人民币 369,788,725.31 元，是以如下债券作为质押：

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
------	------	-------	------------	-------	--------

011801569	18 中电信 SCP007	2019-01-03	100.18	600,000	60,108,000.00
011802221	18 华能 SCP012	2019-01-03	100.01	1,500,000	150,015,000.00
090003	09 国债 03	2019-01-02	100.08	200,000	20,016,000.00
111817216	18 光大银 行 CD216	2019-01-03	97.52	370,000	36,082,400.00
140202	14 国开 02	2019-01-02	100.14	200,000	20,028,000.00
160009	16 付息国 债 09	2019-01-02	99.93	200,000	19,986,000.00
160208	16 国开 08	2019-01-02	99.99	400,000	39,996,000.00
160402	16 农发 02	2019-01-02	100.00	200,000	20,000,000.00
180216	18 国开 16	2019-01-02	99.84	200,000	19,968,000.00
合计				3,870,000	386,199,400.00

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,979,205,197.70	94.70
	其中：债券	3,979,205,197.70	94.70
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,044,135.07	0.24
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,255,860.01	0.13
8	其他各项资产	207,444,906.13	4.94
9	合计	4,201,950,098.91	100.00

### 8.2 报告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

无。

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 8.5 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	40,002,000.00	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	154,417,680.00	4.03
	其中：政策性金融债	154,417,680.00	4.03
4	企业债券	209,599,917.70	5.47
5	企业短期融资券	2,872,083,800.00	75.01
6	中期票据	127,723,800.00	3.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	575,378,000.00	15.03
9	其他	-	-
10	合计	3,979,205,197.70	103.93

## 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

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	111810521	18 兴业银行 CD521	2,000,000	195,040,000.00	5.09
2	011801767	18 陕延油 SCP008	1,900,000	190,380,000.00	4.97
3	011802221	18 华能 SCP012	1,500,000	150,015,000.00	3.92
4	011801808	18 宁河西	1,400,000	140,252,000.00	3.66

		SCP002			
5	011801569	18 中电信 SCP007	1,200,000	120,216,000.00	3.14

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  
无。

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  
无。

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  
无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
无。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券之一 18 兴业银行 CD521（111810521. IB）的发行主体兴业银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字〔2018〕1 号）。本基金认为，对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

#### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，本基金无备选股票库，无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情形。

#### 8.11.3 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	24,608.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,719,316.83
5	应收申购款	161,700,980.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,444,906.13

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

## 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.11.6 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。

## § 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(%)
大成景安短融债券 A	199,245	10,672.51	82,903,226.87	3.90	2,043,541,550.77	96.10
大成景安短融债券 B	27	30,540,297.82	688,522,396.46	83.50	136,065,644.59	16.50
大成景安短融债券 E	178,385	1,120.70	0.00	0.00	199,915,196.06	100.00
合计	377,657	8,343.41	771,425,623.33	24.48	2,379,522,391.42	75.52

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	大成景安短融债券 A	657,079.77	0.0309
	大成景安短融债券 B	-	0.0000

有本基金			
	合计	661,493.04	0.0210

注：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。

### 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	大成景安短融债券 A	10~50
	大成景安短融债券 B	0
	大成景安短融债券 E	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景安短融债券 A	0
	大成景安短融债券 B	0
	大成景安短融债券 E	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
基金合同生效日（2013 年 5 月 24 日）基金份额总额	2,674,262,264.64	1,780,127,988.33	-
本报告期期初基金份额总额	111,474,506.26	41,681,223.37	146,804,605.65
本报告期基金总申购份额	7,746,845,307.87	1,840,758,754.93	290,170,748.55
减：本报告期基金总赎回份额	5,731,875,036.49	1,057,851,937.25	237,060,158.14
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	2,126,444,777.64	824,588,041.05	199,915,196.06

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 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

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 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 6 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

本报告期内，基金管理人、托管人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	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

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:

- (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专用席位。

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:

本报告期内退租交易单元:英大证券;

本报告期内新增交易单元:无。

### 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
光大证券	25,730,932.20	6.80%	1,843,800,000.00	75.40%	-	-
国泰君安	13,168,586.05	3.48%	601,600,000.00	24.60%	-	-
招商证券	339,262,890.00	89.71%	-	-	-	-

## § 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

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

大成基金管理有限公司

2019 年 03 月 29 日