

大成景恒混合型证券投资基金(原大成景 恒保本混合型证券投资基金转型) 2018 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 29 日

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。

大成景恒混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）为根据《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型而来。大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期为3年，第一个保本周期自2012年6月15日至2015年6月15日，第二个保本周期自2015年6月24日至2018年6月25日（2018年6月24日为非工作日）。大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期于2018年6月25日到期，由于在第二个保本周期到期后不再符合保本基金存续条件，按照《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的股票型基金，基金名称相应变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”。按照《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，变更后的大成景恒稳健增长股票型证券投资基金中“股票资产占基金资产的比例为60%—95%”，而根据中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于基金类别的规定，“股票资产占基金资产的比例为60%—95%”的基金应为混合基金，经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型的基金名称由“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”修改为“大成景恒混合型证券投资基金”，此修改仅为对转型后的基金名称的修改，《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》中其他关于转型后的基金的约定，包括但不限于投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等条款均不因此改变。

大成景恒保本混合型证券投资基金的第二个保本周期到期期间为保本周期到期日，即2018年6月25日。自2018年6月26日起，大成景恒保本混合型证券投资基金正式转型为大成景恒混合型证券投资基金，转型后的《大成景恒混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

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。

自 2018 年 6 月 26 日原大成景恒保本混合型证券投资基金名称变更为大成景恒混合型证券投资基金。原大成景恒保本混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 25 日止，大成景恒混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	4
§ 2 基金简介	7
2.1 基金基本情况（转型后）.....	7
2.1 基金基本情况（转型前）.....	7
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.2 基金产品说明（转型前）.....	8
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后).....	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前).....	10
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	13
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	15
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
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.....	22
§ 5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
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.....	23
§ 6 审计报告（转型后）	23
§ 6 审计报告（转型前）	25
§ 7 年度财务报表（转型后）	27
7.1 资产负债表.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29

7.4 报表附注.....	30
§7 年度财务报表(转型前)	52
7.1 资产负债表.....	52
7.2 利润表.....	54
7.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	55
7.4 报表附注.....	56
§8 投资组合报告(转型后)	81
8.1 期末基金资产组合情况.....	81
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	82
8.3 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.....	82
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	87
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.....	87
8.7 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.....	87
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.....	87
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.....	87
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	87
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	88
8.12 投资组合报告附注.....	88
§8 投资组合报告(转型前)	89
8.1 期末基金资产组合情况.....	89
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	89
8.3 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.....	90
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	91
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.....	92
8.7 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.....	92
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.....	92
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.....	92
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	92
8.12 投资组合报告附注.....	92
§9 基金份额持有人信息(转型后)	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	94
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.....	94
§9 基金份额持有人信息(转型前)	94
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	94
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	95
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.....	95
§10 开放式基金份额变动(转型后)	95

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）	95
§ 11 重大事件揭示	96
11.1 基金份额持有人大会决议	96
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	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4 基金投资策略的改变	96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	96
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	96
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)	99
11.8 其他重大事件（转型后）	101
11.8 其他重大事件（转型前）	103
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）	104
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	104
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	104
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）	105
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	105
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	105
§ 13 备查文件目录	105
13.1 备查文件目录	105
13.2 存放地点	105
13.3 查阅方式	106

基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	大成景恒混合型证券投资基金	
基金简称	大成景恒混合	
基金主代码	090019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月26日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	55,984,987.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成景恒混合 A	大成景恒混合 C
下属分级基金的交易代码	090019	006038
报告期末下属分级基金的份额总额	41,583,807.60份	14,401,180.10份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	大成景恒保本混合型证券投资基金
基金简称	大成景恒保本混合
基金主代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,277,687.33份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本混合型基金将秉承价值投资的基本理念，依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期，自上而下稳健配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，力争实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金以经风险调整后的收益最大化为目标，在合理运用金融工程技术的基础上，因时制宜，把握宏观经济和投资市场的长期变化趋势，根据经济周期和市场预期动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，谋求基金资产长期稳定的增长。
业绩比较基准	基金业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用 VPPI 可变组合保险策略（Variable Proportion Portfolio Insurance）。VPPI 策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制，将基金资产动态优化分配在保本资产和风险资产上；并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重，在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上，积极参与分享市场可能出现的风险收益，从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产，其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具；风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率（按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位，单位为百分数）计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
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、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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年06月26日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
	大成景恒混合 A	大成景恒混合 C
本期已实现收益	1,158,021.36	285,599.93
本期利润	-2,010,468.03	-990,091.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0863	-0.2423
本期加权平均净值利润率	-8.61%	-23.06%
本期基金份额净值增长率	-3.45%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	
期末可供分配利润	9,644,715.03	173,449.85
期末可供分配基金份额利润	0.2319	0.0120
期末基金资产净值	40,705,619.78	14,574,629.95
期末基金份额净值	0.979	1.012
3.1.3 累计期末指标	2018年末	
基金份额累计净值增长率	-3.45%	0.40%

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、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)。

3、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。

4、根据我司2018年6月19日《关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设C类基金份额的公告》，自2018年6

月26日起,大成景恒混合型证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年01月01日- 2018年06月25日 (基金转型前一日)	2017年	2016年
本期已实现收益	235,531.99	-1,126,645.60	1,609,531.23
本期利润	289,581.21	735,597.42	-6,847,705.80
加权平均基金份额本期利润	0.0117	0.0077	-0.0197
本期加权平均净值利润率	1.16%	0.76%	-1.95%
本期基金份额净值增长率	1.20%	0.10%	-1.57%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月25日(基 金转型前一日)	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	5,890,186.62	7,060,611.53	38,624,497.58
期末可供分配基金份额利润	0.2644	0.2541	0.2540
期末基金资产净值	22,581,762.85	27,829,864.02	152,206,314.72
期末基金份额净值	1.014	1.0020	1.001
3.1.3 累计期末指标	2018年6月25日(基 金转型前一日)	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	35.74%	34.14%	34.01%

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、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)。

3、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(转型后)

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

大成景恒混合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	-3.17%	1.78%	-9.51%	1.31%	6.34%	0.47%
过去六个月	-3.45%	1.32%	-10.68%	1.20%	7.23%	0.12%

自基金合同 生效起至今	-3.45%	1.30%	-11.62%	1.20%	8.17%	0.10%
----------------	--------	-------	---------	-------	-------	-------

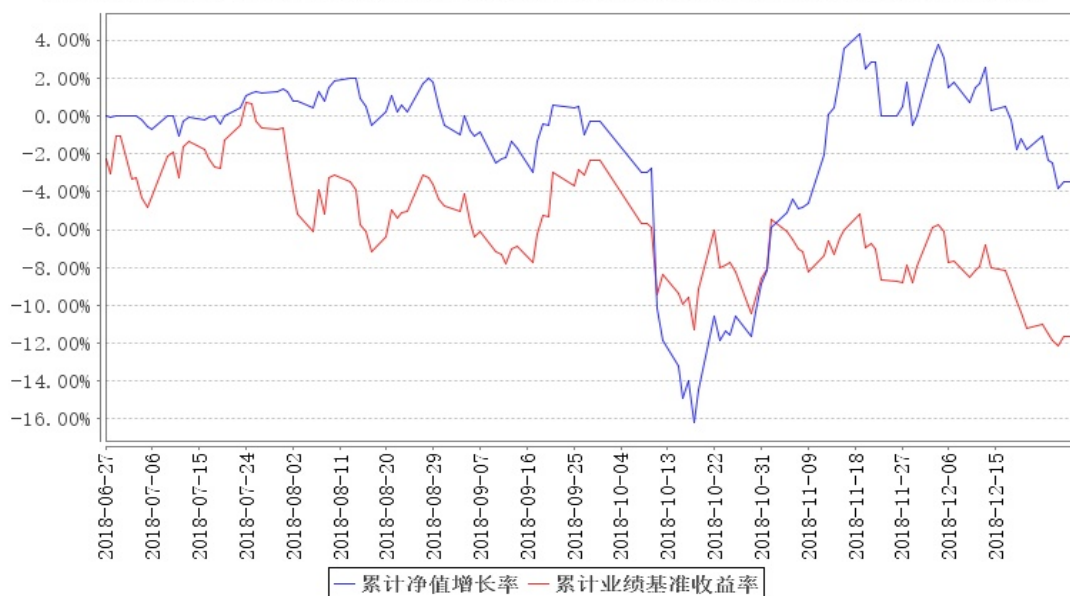
大成景恒混合 C

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	-3.34%	1.77%	-9.51%	1.31%	6.17%	0.46%
过去六个月	0.40%	1.40%	-7.63%	1.19%	8.03%	0.21%
自基金合同 生效起至今	0.40%	1.40%	-7.63%	1.19%	8.03%	0.21%

注:本基金合同生效日为2018年6月26日。

3.2.2 自基金转型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

大成景恒混合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



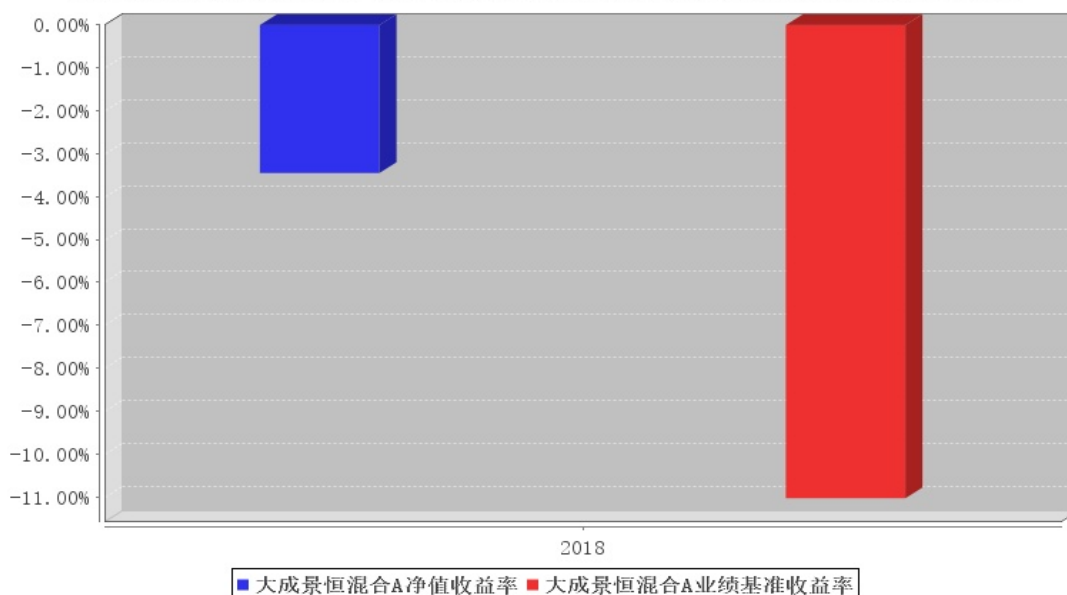
大成景恒混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



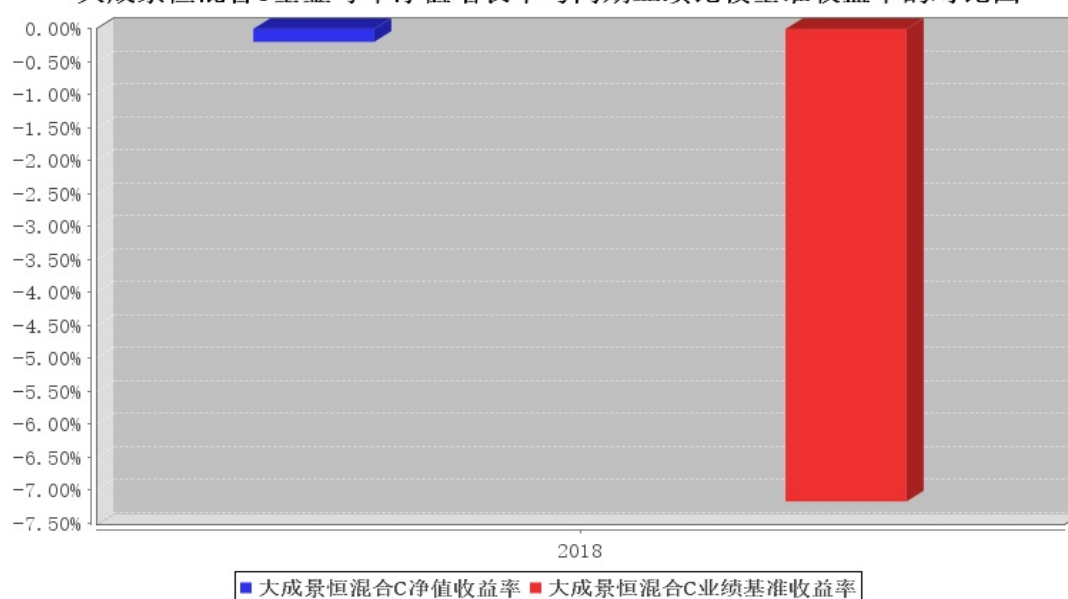
- 注：1. 本基金自 2018 年 6 月 26 日起，由景恒保本混合转换为景恒混合，基金名称变更为“大成景恒混合型证券投资基金”，截至报告期末本基金转型未满一年。
2. 本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金转型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

大成景恒混合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



大成景恒混合C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。

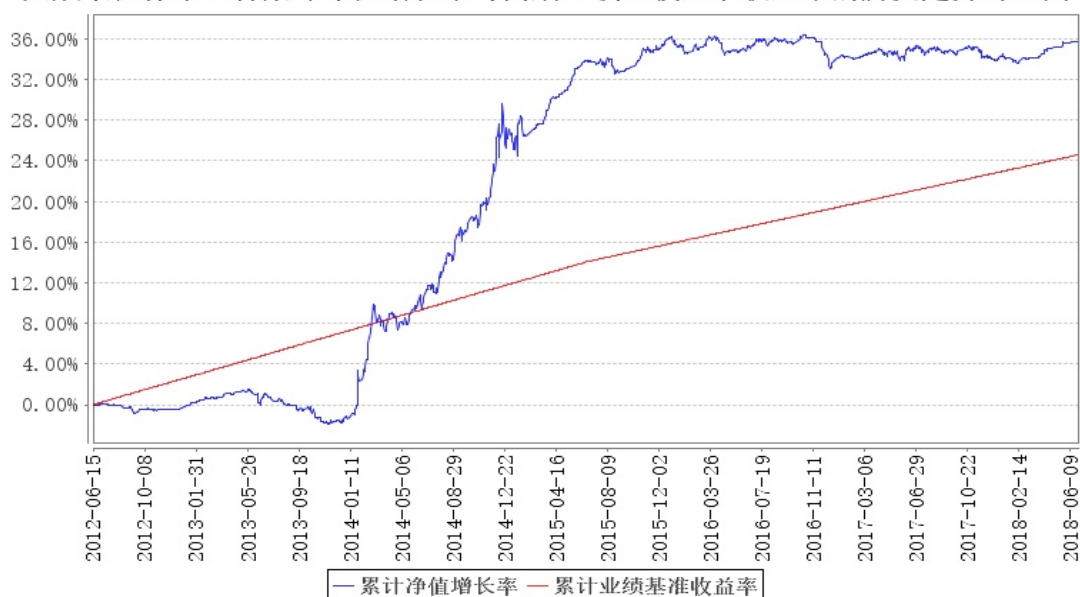
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.10%	0.06%	0.67%	0.01%	0.43%	0.05%
过去六个月	1.20%	0.07%	1.37%	0.01%	-0.17%	0.06%
过去一年	0.30%	0.09%	2.85%	0.01%	-2.55%	0.08%
过去三年	1.40%	0.11%	9.16%	0.01%	-7.76%	0.10%
过去五年	34.79%	0.26%	18.82%	0.01%	15.97%	0.25%
自基金合同生效起至2018年6月25日	35.74%	0.23%	24.58%	0.01%	11.16%	0.22%

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

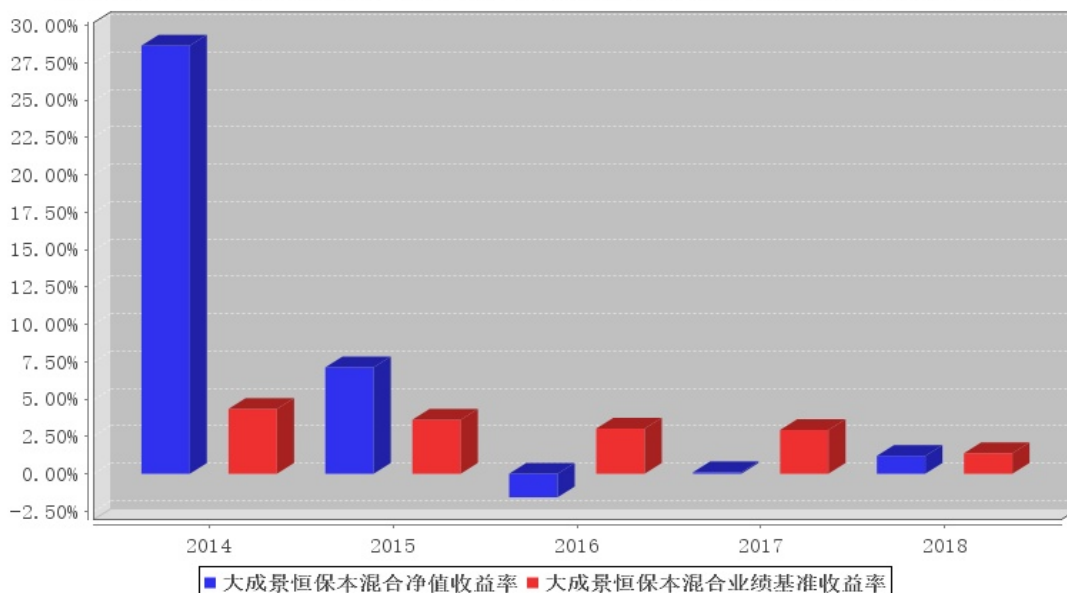
大成景恒保本混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

大成景恒保本混合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



3.3 过去三年基金的利润分配情况(转型后)

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

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%)。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（转型后）

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		
苏秉毅	本基金基金经理，数量与指数投资部副总监	2018年6月26日	-	14	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理助理，现任数量与指数投资部副总监。

					<p>2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。</p> <p>2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 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基金经理。</p> <p>2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。</p> <p>2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证</p>
--	--	--	--	--	---

					券投资基金基金经理。2018年6月26日起任大成景恒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
--	--	--	--	--	--

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵世宏	本基金基金经理	2016年03月26日	2018年06月25日	7	经济学硕士。2011年3月至2012年9月任中银基金管理有限公司研究员。2012年9月至2015年9月任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2015年9月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2016年3月26日至2018年7月20日起担任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景利混合型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金和大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年3月26日至2018年6月25日担任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2016年11月8日至2018年7月20日担任大成景

					盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 2 月 16 日至 2018 年 7 月 20 日任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 18 日至 2018 年 7 月 20 日担任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 15 日至 2018 年 7 月 20 日担任大成惠裕定期开放纯债债券型基金经理。2017 年 6 月 6 日至 2018 年 7 月 20 日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。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

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 年度，整体宏观经济环境出现了较大的变化，在多方面因素的共同作用下，宏观经济下行压力贯穿全年。外部环境方面，中美贸易摩擦是全年影响最大的外生变量，全球政治、经济环境发生剧变，外需拉动作用大大减弱；在国内方面，内在运行机制存在弊端，叠加年初的去杠杆政策，造成民间信用扩张意愿极低。尽管面对剧烈冲击，宏观政策及时调整，去杠杆、金融整肃趋于温和，货币环境保持宽松，财政政策也更加积极，但政策生效尚需时日，货币传导也不甚通畅，流动性并未有效流入实体经济。

在基本面和流动性的双重挤压下，股市 2018 年度表现较差。年初，大盘蓝筹股延续之前趋势强劲上涨，走出逼空式行情，但行情过度透支，交易极其拥挤，最终由外围股市下跌引发剧烈调整，并单边下行至四季度。在十月上旬暴跌过后，股市企稳反弹，之后又再缓步下行至年底。全年市场基准沪深 300 指数下跌 25.31%。各行业指数均有较大幅度的下跌，从全年来看，休闲服务、银行、食品饮料等行业较为抗跌，大市值的蓝筹股在熊市中表现出了良好的避险属性；而中

小盘股票则是下跌的重灾区，表征中小市值股票走势的中证 1000 指数下跌 36.87%，大幅落后于基准。

本基金在六月底转型为偏股型混合基金。在建仓期，本基金秉持稳健审慎的原则，根据量化模型，选择前期调整较为充分，具有一定安全边际的优质股票，逐步进行建仓，以期获得良好的回报风险比。

基于对四季度反弹行情的预判，本基金在八、九月份仓位上升幅度较大，截至三季度末，基金已基本完成建仓。然而，十月初股市遭遇系统性风险，本基金仓位较重，在下跌中有较大损失。在阶段性出清后，市场猛烈反弹，由于基金持仓超配小市值、反转因子，选取的股票普遍具有超跌的特征，在反弹行情中也呈现出较高的弹性，涨幅较大。

基金在后续操作中也保持较高仓位和偏成长的风格。整体来看，基金净值走势和表征中小盘股票的指数较为接近。在转型后，基金 A 类份额净值下跌 3.45%，跌幅小于市场基准指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，大成景恒混合 A 的份额资产净值为 0.979，大成景恒混合 C 的份额资产净值为 1.012。本报告期转型前（2018.1.1-2018.6.25）大成景恒保本的基金份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；转型后（2018.6.26-2018.12.31）大成景恒混合 A 的份额净值增长率为-3.45%，同期业绩比较基准收益率为-11.62%，大成景恒混合 C 的份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为-7.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的年度，宏观经济面临较大的挑战。愈演愈烈的中美摩擦是最显而易见的外在影响因素，中美双方在诸多问题上存在较深层次的分歧，短时间内解决争端的可能性极小，这将长时间影响我国经济发展。同时，国内自身也存在税费负担、资源分配等问题，导致民间信心不足，信用扩张意愿极弱，叠加经济下行周期，形势更为严峻。尽管为刺激经济发展，宏观政策已经转向宽松的货币政策和积极的财政政策，但信用传导仍然不畅，政策作用尚不明显。此外，外汇因素将持续对货币政策宽松空间构成制约，非洲猪瘟的蔓延也有可能导致通胀的意外上升。若经济迟迟不见起色，而刺激工具有限，宏观经济环境很有可能走向类似滞涨的局面。

对于明年股市，我们认为将较去年有一定程度的好转，有可能走出先反弹再探底的行情。尽管经济形势非常严峻，但很大程度上已经反映在股票价格中，未来市场的主要矛盾将主要体现为下行现实和刺激预期的对冲。贸易摩擦等利空因素在较长的时间范围内压制经济复苏，而经济刺激政策则可以在短时间内改变投资者的预期和情绪。宏观去杠杆已逐渐演化为稳杠杆，而且一个健

康向上的股市符合各方面的诉求，资金面和政策面都对股市较为友好。从估值水平来看，经过去年的下跌，相当多股票处于估值低位，存在估值修复的内在动力。

基于以上判断，上半年的总体操作思路仍是保持较高仓位，精选前期被错杀的超跌个股，重点配置小市值、反转因子，博取反弹行情中的高弹性。在因子暴露水平较高的同时，投资组合将继续保持较高的行业、个股分散度。若股市发展符合预期，再综合考虑各方因素，视情况调整投资策略，降低仓位或转向防御性投资风格。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基

金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

配事项。

4.9 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成景恒混合证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告（转型后）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成景恒混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了大成景恒混合型证券投资基金的财务报表（以下简称“大成景恒混合基金”），包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 6 月 26 日（合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的大成景恒混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成景恒混合型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 26 日（合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日的经营成

	果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成景恒混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	大成景恒混合型证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估大成景恒混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督大成景恒混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作（续）：

	<p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对大成景恒混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致大成景恒混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	吴翠蓉 叶锦明
会计师事务所的地址	中国北京
审计报告日期	2019 年 3 月 28 日

§ 6 审计报告(转型前)

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成景恒保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	<p>我们审计了大成景恒保本混合型证券投资基金的财务报表(以下简称“大成景恒保本混合基金”),包括 2018 年 6 月 25 日(基金转型前一日)的资产负债表,自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日(基金转型前一日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的大成景恒保本混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了大成景恒保本混合基金 2018 年 06 月 25 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日(基金转型前一日)止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于大成景恒保本混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>大成景恒保本混合型证券投资基金管理层(以下简称“管理层”)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p>

	<p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成景恒保本混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督大成景恒保本混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成景恒保本混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成景恒保本混合基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现</p>

	等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	叶锦明
会计师事务所的地址	中国北京	
审计报告日期	2019年3月28日	

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：大成景恒混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	4,000,393.41
结算备付金		795,607.83
存出保证金		278,260.52
交易性金融资产	7.4.7.2	50,678,781.00
其中：股票投资		50,678,781.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		276,575.95
应收利息	7.4.7.5	975.85
应收股利		-
应收申购款		49,913.67
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		56,080,508.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-

应付赎回款		346,324.82
应付管理人报酬		74,825.48
应付托管费		12,470.92
应付销售服务费		8,520.74
应付交易费用	7.4.7.7	64,736.39
应交税费		188,252.80
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	105,127.35
负债合计		800,258.50
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	45,462,084.85
未分配利润	7.4.7.10	9,818,164.88
所有者权益合计		55,280,249.73
负债和所有者权益总计		56,080,508.23

注:1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日,大成景恒混合 A 类基金份额净值 0.979 元,大成景恒混合 C 类基金份额净值 1.012 元,基金份额总额 55,984,987.70 份,其中大成景恒混合 A 类基金份额 41,583,807.60 份,大成景恒混合 C 类基金份额 14,401,180.10 份。

2. 本基金合同于 2018 年 6 月 26 日起生效,实际报告期间为 2018 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日,因此无需披露比较数据。

7.2 利润表

会计主体:大成景恒混合型证券投资基金

本报告期:2018 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 6 月 26 日(基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-2,507,066.83
1. 利息收入		49,649.36
其中:存款利息收入	7.4.7.11	23,642.02
债券利息收入		1,450.68
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		24,556.66
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		1,777,646.34
其中:股票投资收益	7.4.7.12	1,783,361.44
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-13,304.50

资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-27,634.56
股利收益	7.4.7.16	35,223.96
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-4,444,180.76
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	109,818.23
减: 二、费用		493,492.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	211,596.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	35,266.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	12,406.69
4. 交易费用	7.4.7.19	135,358.89
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		124.15
7. 其他费用	7.4.7.20	98,740.11
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,000,559.47
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,000,559.47

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成景恒混合型证券投资基金

本报告期: 2018年6月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2018年6月26日(基金合同生效日)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)	16,641,518.38	5,940,244.47	22,581,762.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,000,559.47	-3,000,559.47
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)	28,820,566.47	6,878,479.88	35,699,046.35
其中: 1. 基金申	48,334,838.26	10,784,071.88	59,118,910.14

购款			
2. 基金赎回款	-19,514,271.79	-3,905,592.00	-23,419,863.79
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)	45,462,084.85	9,818,164.88	55,280,249.73

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 基金基本情况

大成景恒混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由原大成景恒保本混合型证券投资基金转型而来。根据《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，原大成景恒保本混合型证券投资基金的保本周期为每三年一个周期，第二个保本周期于 2018 年 6 月 25 日到期，由于在第二个保本周期到期后不再符合保本基金存续条件，按照《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本基金，经基金管理人与基金托管人协商一致并报证监会备案，基金名称相应变更为“大成景恒混合型证券投资基金”。本基金合同于 2018 年 6 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期转型及增设 C 类基金份额的第一次提示性公告》。本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。即 2018 年 6 月 26 日起，对大成景恒混合型证券投资基金增如收取销售服务费的 C 类份额并对本基金的基金合同作出相应修改。原持有大成景恒保本混合型证券投资基金基金份额的投资人若在保本周期到期期间选择继续持有变更后的“大成景恒混合型证券投资基金”的基金份额的，对应持有的份额类别为 A 类基金份额。

根据《大成景恒混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要》，本基金投资范围限于具有良

好流动性的金融工具，包括国内上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的 5%—40%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为 $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中证综合指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 26 日（合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际编制期间 2018 年 6 月 26 日（合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际

编制期间 2018 年 6 月 26 日（合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值

技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因级别调整而引起的A、C级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账

面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额收取销售服务费, 各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权;

(3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益分配每年至多 12 次; 每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。

(5) 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法, 保留到小数点后 2 位, 由此误差产生的损失由基金财产承担, 产生的收益归基金财产所有;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
活期存款	4,000,393.41
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	4,000,393.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	55,047,213.26	50,678,781.00	-4,368,432.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	55,047,213.26	50,678,781.00	-4,368,432.26

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	1,741,320.00	-	-	
其他衍生	-	-	-	

工具			
合计	1,741,320.00	-	-

注：1) 于本期末，本基金投资的股指期货持仓数量为2手，合约市值为人民币1,652,400.00元，公允价值变动为人民币-88,920.00元。

2) 衍生金融资产项下的股指期货投资净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	800.45
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	161.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	13.70
合计	975.85

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	64,736.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	64,736.39

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	127.35
预提费用	105,000.00
合计	105,127.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景恒混合 A

项目	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	22,277,687.33	16,641,518.38
2018年6月26日基金份额折算调整	-	-
2018年6月26日未领取红利份额折算调整	-	-
2018年6月26日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2018年6月26日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	32,028,124.85	23,923,253.60
本期赎回（以“-”号填列）	-12,722,004.58	-9,503,867.23
本期末	41,583,807.60	31,060,904.75

大成景恒混合 C

项目	本期	
	2018年6月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
2018年6月26日基金份额折算调整	-	-
2018年6月26日未领取红利份额折算调整	-	-
2018年6月26日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2018年6月26日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	24,411,584.66	24,411,584.66
本期赎回(以“-”号填列)	-10,010,404.56	-10,010,404.56
本期末	14,401,180.10	14,401,180.10

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)、级别调整入份额(如有)份额；赎回含转换出份额(如有)、级别调整出份额(如有)。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大成景恒混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	5,890,186.62	50,057.85	5,940,244.47
本期利润	1,158,021.36	-3,168,489.39	-2,010,468.03
本期基金份额交易产生的变动数	5,822,066.26	-107,127.67	5,714,938.59
其中：基金申购款	9,519,580.86	-360,509.61	9,159,071.25
基金赎回款	-3,697,514.60	253,381.94	-3,444,132.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,870,274.24	-3,225,559.21	9,644,715.03
大成景恒混合 C			

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	285,599.93	-1,275,691.37	-990,091.44
本期基金份额交易产生的变动数	1,044,596.70	118,944.59	1,163,541.29
其中：基金申购款	1,883,032.45	-258,031.82	1,625,000.63
基金赎回款	-838,435.75	376,976.41	-461,459.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,330,196.63	-1,156,746.78	173,449.85

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
活期存款利息收入	21,572.16
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	1,963.26
其他	106.60
合计	23,642.02

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	27,288,036.05
减：卖出股票成本总额	25,504,674.61
买卖股票差价收入	1,783,361.44

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,535,300.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,399,571.50
减：应收利息总额	149,033.00
买卖债券差价收入	-13,304.50

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股指期货-投资收益	-27,634.56

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,223.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	35,223.96

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,355,260.76
股票投资	-4,368,432.26
债券投资	13,171.50
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-88,920.00
权证投资	-
期货	-88,920.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,444,180.76

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日

基金赎回费收入	108,048.55
基金转换费收入	1,769.68
合计	109,818.23

注:1) 本基金的赎回费率按持有期间递减, 不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2) 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成, 其中不低于赎回费总额的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2018年6月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	135,358.89
银行间市场交易费用	-
合计	135,358.89

7.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2018年6月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	30,534.56
信息披露费	46,603.68
账户维护费	18,000.00
银行费用	3,001.87
其他	600.00
合计	98,740.11

7.4.7.21 分部报告

截至本期末, 本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务, 因此, 无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	211,596.74
其中：支付销售机构的客户维护费	70,840.87

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1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

7.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	35,266.06

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0.25%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.1.3 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6月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成景恒混合A	大成景恒混合C	合计
大成基金	-	708.00	708.00
合计	-	708.00	708.00

注:销售服务费每日计提,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率为0.60%,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0.60%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金财产净值

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.3.2 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。

7.4.10.4 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6月26日（基金合同生效日）至2018年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,000,393.41	21,572.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行约定利率计息。

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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。

于本期末，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 0.00%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过15%，且本基金组合资产中7个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	4,000,393.41	-	-	-	4,000,393.41
结算备付金	795,607.83	-	-	-	795,607.83
存出保证金	30,400.52	-	-	247,860.00	278,260.52
交易性金融资产	-	-	-	50,678,781.00	50,678,781.00
应收利息	-	-	-	975.85	975.85
应收申购款	-	-	-	49,913.67	49,913.67
应收证券清算款	-	-	-	276,575.95	276,575.95
资产总计	4,826,401.76	-	-	51,254,106.47	56,080,508.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	346,324.82	346,324.82
应付管理人报酬	-	-	-	74,825.48	74,825.48
应付托管费	-	-	-	12,470.92	12,470.92
应付销售服务费	-	-	-	8,520.74	8,520.74
应付交易费用	-	-	-	64,736.39	64,736.39
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	105,127.35	105,127.35
负债总计	-	-	-	800,258.50	800,258.50
利率敏感度缺口	4,826,401.76	-	-	50,453,847.97	55,280,249.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的5%—40%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	50,678,781.00	91.68
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	50,678,781.00	91.68

注：衍生金融资产为股指期货 / 国债期货投资，于本期末，本基金投资的股指期货持仓数量为2手，合约市值为人民币1,652,400.00元，公允价值变动为人民币-88,920.00元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指 / 国债期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货 / 国

债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	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（2018 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	1,220,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-1,220,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

无。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次余额为 50,678,781.00，无划分为第二层次的余额，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准本财务报表已于 2019 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月25日（基金转型前一日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月25日（基 金转型前一日）	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	17,364,256.54	1,116,452.62
结算备付金		138,265.05	136,847.59
存出保证金		7,390.07	14,701.79
交易性金融资产	7.4.7.2	5,386,400.00	15,156,436.40
其中：股票投资		-	684,089.00
基金投资		-	-
债券投资		5,386,400.00	14,472,347.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	11,500,000.00
应收证券清算款		-	90,143.73
应收利息	7.4.7.5	148,784.61	311,727.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	209.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		23,045,096.27	28,326,519.74
负债和所有者权益		本期末	上年度末
	附注号	2018年6月25日（基	2017年12月31日
		金转型前一日）	
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		189,774.06	3,942.46
应付管理人报酬		19,147.89	29,346.21
应付托管费		3,191.30	4,891.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,092.40	10,217.18

应交税费		188,252.80	188,252.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	57,874.97	260,006.01
负债合计		463,333.42	496,655.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	16,641,518.38	20,757,040.35
未分配利润	7.4.7.10	5,940,244.47	7,072,823.67
所有者权益合计		22,581,762.85	27,829,864.02
负债和所有者权益总计		23,045,096.27	28,326,519.74

注：报告截止日2018年6月25日（基金转型前一日），基金份额净值1.014元，基金份额总额22,277,687.33份。

7.2 利润表

会计主体：大成景恒保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月25日（基金转型前一日）

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年6月25日（基金转型 前一日）	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
一、收入		556,070.81	2,618,330.78
1. 利息收入		412,270.78	3,465,250.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	8,404.22	425,154.60
债券利息收入		321,404.65	2,823,104.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		82,461.91	216,992.15
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		89,511.94	-2,710,836.80
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-132,353.61	-478,922.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	222,026.55	-2,339,931.19
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-161.00	108,017.04
3. 公允价值变动收益(损失以	7.4.7.17	54,049.22	1,862,243.02

“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	238.87	1,673.60
减: 二、费用		266,489.60	1,882,733.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	143,887.81	1,171,787.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	23,981.32	195,297.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	17,635.75	104,201.62
5. 利息支出		-	5,234.81
其中: 卖出回购金融资产支出		-	5,234.81
6. 税金及附加		0.35	-
7. 其他费用	7.4.7.20	80,984.37	406,211.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		289,581.21	735,597.42
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		289,581.21	735,597.42

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成景恒保本混合型证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月25日

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月25日(基金转型前一日)		
	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)	20,757,040.35	7,072,823.67	27,829,864.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	289,581.21	289,581.21
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)	-4,115,521.97	-1,422,160.41	-5,537,682.38
其中: 1. 基金申购款	160,847.90	55,828.99	216,676.89

2. 基金赎回款	-4, 276, 369. 87	-1, 477, 989. 40	-5, 754, 359. 27
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)	16, 641, 518. 38	5, 940, 244. 47	22, 581, 762. 85
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)	113, 581, 817. 14	38, 624, 497. 58	152, 206, 314. 72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	735, 597. 42	735, 597. 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)	-92, 824, 776. 79	-32, 287, 271. 33	-125, 112, 048. 12
其中：1. 基金申购款	1, 079, 834. 02	373, 434. 17	1, 453, 268. 19
2. 基金赎回款	-93, 904, 610. 81	-32, 660, 705. 50	-126, 565, 316. 31
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)	20, 757, 040. 35	7, 072, 823. 67	27, 829, 864. 02

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 基金基本情况

大成景恒保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]567号文“关于核准大成景恒保本混合型证券投资基金募集的批复”的核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第60469430_H01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年6月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间为2012年5月10日至2012年6月13日，首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币1,071,429,531.92元，折合1,071,429,531.92份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币297,260.10元，折合297,260.10份基金份额；以上收到的资金共计人民币1,071,726,792.02元，折合1,071,726,792.02份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》，本基金第一个保本周期自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金的第一个保本周期到期日为2015年6月15日，鉴于本基金管理人已与深圳市高新投集团有限公司（以下简称“高新投”）就本基金第二个保本周期的保本事宜达成一致，由高新投为本基金进入第二个保本周期的运作提供保本保证，并签订了《保证合同》，本基金符合《基金合同》规定的保本基金存续的条件，本基金转入第二个保本周期。

基金份额折算日的下一个工作日为第二个保本周期的起始日，保本周期三年，第二个保本周期自2015年6月24日起2018年6月25日（2018年6月24日为非工作日）。本基金第二个保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额，由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人或保本义务人将该差额支付给基金份额持有人，由基金管理人将该差额支付给基金份额持有人的，当期有效的保证合同的担保人对此按照相关约定提供担

保。

本基金管理人于2018年6月19日发布的《关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设C类基金份额的公告》，在本基金第二个保本周期到期日次日，即2018年6月26日起，大成景恒保本混合型证券投资基金正式转型为大成景恒混合型证券投资基金。

根据《大成景恒保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为3年期银行定期存款利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年6月25日，本基金出现连续60

个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 25 日（基金转型前一日）的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日（基金转型前一日）止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际编制期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日（基金转型前一日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 保本周期内本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；
- (2) 基金转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”后，基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；
- (3) 每一基金份额享有同等分配权；
- (4) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。
- (6) 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有；
- (7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2018 年 6 月 25 日（基金转型前一日）	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	17,364,256.54	1,116,452.62
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	17,364,256.54	1,116,452.62

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2018 年 6 月 25 日（基金转型前一日）		
	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	-	-	-
	银行间市场	5,399,571.50	5,386,400.00	-13,171.50
	合计	5,399,571.50	5,386,400.00	-13,171.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,399,571.50	5,386,400.00	-13,171.50
项目	上年度末 2017年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		741,708.00	684,089.00	-57,619.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	13,483,445.12	13,477,147.40	-6,297.72
	银行间市场	998,504.00	995,200.00	-3,304.00
	合计	14,481,949.12	14,472,347.40	-9,601.72
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		15,223,657.12	15,156,436.40	-67,220.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月25日(基金转型前一日)	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	11,500,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月25日(基金转型前一日)	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	1,176.09	262.40
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	24.88	61.60
应收债券利息	147,582.32	294,915.05
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	16,482.21
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.32	6.60
合计	148,784.61	311,727.86

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月25日(基金转型前一日)	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	217.70	10,217.18
银行间市场应付交易费用	4,874.70	-
合计	5,092.40	10,217.18

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月25日(基金转型前一日)	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	13.21	6.01
预提费用	57,861.76	260,000.00

合计	57,874.97	260,006.01
----	-----------	------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月25日（基金转型前一日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,787,237.12	20,757,040.35
本期申购	215,331.63	160,847.90
本期赎回（以“-”号填列）	-5,724,881.42	-4,276,369.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,277,687.33	16,641,518.38

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、赎回含转换出份额（如有）。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,060,611.53	12,212.14	7,072,823.67
本期利润	235,531.99	54,049.22	289,581.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,405,956.90	-16,203.51	-1,422,160.41
其中：基金申购款	55,106.11	722.88	55,828.99
基金赎回款	-1,461,063.01	-16,926.39	-1,477,989.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,890,186.62	50,057.85	5,940,244.47

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月25日 (基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
	活期存款利息收入	6,967.79
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	374,888.89
结算备付金利息收入	1,375.07	8,335.31
其他	61.36	209.81
合计	8,404.22	425,154.60

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。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月25日 (基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	4,962,935.65	32,344,670.77
减：卖出股票成本总额	5,095,289.26	32,823,593.42
买卖股票差价收入	-132,353.61	-478,922.65

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月25日 (基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	94,417,486.87	321,906,514.73
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	92,757,308.29	317,500,806.80
减：应收利息总额	1,438,152.03	6,745,639.12
买卖债券差价收入	222,026.55	-2,339,931.19

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月25日 (基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	-161.00	108,017.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-161.00	108,017.04

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年 6月25日(基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
1. 交易性金融资产	54,049.22	1,862,243.02
股票投资	57,619.00	-13,826.30
债券投资	-3,569.78	1,876,069.32
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	54,049.22	1,862,243.02

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 25日(基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
基金赎回费收入	227.17	1,454.27
基金转换费收入	11.70	219.33
合计	238.87	1,673.60

注：1) 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2) 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中赎回费总额的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 25日(基金转型前一日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	14,752.75	97,036.62
银行间市场交易费用	2,883.00	7,165.00
合计	17,635.75	104,201.62

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 25 日 (基金转型前一日)	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	14,465.44	60,000.00
信息披露费	43,396.32	300,000.00
账户维护费	18,000.00	36,000.00
银行费用	4,522.61	9,011.77
其他	600.00	1,200.00
合计	80,984.37	406,211.77

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设 C 类基金份额的公告》，本基金将于第二个保本周期到期日次日，即 2018 年 6 月 26 日起转型为大成景恒混合型证券投资基金。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月25日 (基金转型前一日)		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	4,547,418.63	48.81	33,963,104.46	52.59

7.4.10.1.2 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6月25日 (基金转型前一日)		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	11,337,056.05	34.39	73,215,280.83	86.37

7.4.10.1.3 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6月25日 (基金转型前一日)		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	115,300,000.00	86.37	757,300,000.00	82.02

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月25日（基金转型前一日）			
	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	4,143.83	48.79	-	-
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 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	30,952.46	52.59	5,891.02	57.66

注：1) 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月25日（基金转型前一日）	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	143,887.81
其中：支付销售机构的客户维护 费	56,721.03	178,345.96

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年1月1日至2018年6月25日(基金转型前一日)	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	23,981.32	195,297.90

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0.20%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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6月25日(基金转型前一日)		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
中国银行	17,364,256.54	6,967.79	1,116,452.62	41,720.59

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2018年06月25日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月25日（基金转型 前一日）	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	999,800.00	10,846,235.40
合计	999,800.00	10,846,235.40

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为一年及一年以内的国债和政策性金融债。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月25日（基金转型前 一日）	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,386,600.00	-
合计	4,386,600.00	-

注：1. 同业存单投资评级取自第三方评级机构的主体评级。

2. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月25日（基金转 型前一日）	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	3,626,112.00
合计	-	3,626,112.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 上年度未评级债券为债券期限大于一年的国债。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过15%，且本基金组合资产中7个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月25日 (基金转型前一日)	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,364,256.54	-	-	-	17,364,256.54
结算备付金	138,265.05	-	-	-	138,265.05
存出保证金	7,390.07	-	-	-	7,390.07
交易性金融资产	5,386,400.00	-	-	-	5,386,400.00
应收利息	-	-	-	148,784.61	148,784.61
资产总计	22,896,311.66	-	-	148,784.61	23,045,096.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	189,774.06	189,774.06
应付管理人报酬	-	-	-	19,147.89	19,147.89
应付托管费	-	-	-	3,191.30	3,191.30
应付交易费用	-	-	-	5,092.40	5,092.40
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	57,874.97	57,874.97
负债总计	-	-	-	463,333.42	463,333.42
利率敏感度缺口	22,896,311.66	-	-	-314,548.81	22,581,762.85
上年度末 2017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	1,116,452.62	-	-	-	1,116,452.62
结算备付金	136,847.59	-	-	-	136,847.59
存出保证金	14,701.79	-	-	-	14,701.79
交易性金融资产	14,472,347.40	-	-	684,089.00	15,156,436.40
买入返售金融资产	11,500,000.00	-	-	-	11,500,000.00
应收利息	-	-	-	311,727.86	311,727.86
应收申购款	-	-	-	209.75	209.75
应收证券清算款	-	-	-	90,143.73	90,143.73
资产总计	27,240,349.40	-	-	1,086,170.34	28,326,519.74
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,942.46	3,942.46
应付管理人报酬	-	-	-	29,346.21	29,346.21
应付托管费	-	-	-	4,891.06	4,891.06
应付交易费用	-	-	-	10,217.18	10,217.18
应交税费	-	-	-	188,252.80	188,252.80
其他负债	-	-	-	260,006.01	260,006.01
负债总计	-	-	-	496,655.72	496,655.72
利率敏感度缺口	27,240,349.40	-	-	589,514.62	27,829,864.02

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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(2018年6月25日)	上年度末(2017年12月31日)
	利率上升25个基点	-100.00	-12,600.23
利率下降25个基点	100.00	12,622.39	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%。于2018年6月25日（基金转型前一日），本基金未持有交易性权益类投资（于2017年12月31日，本基金持有的交易性权益投资占基金净资产的比例仅为2.46%）。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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2018年6月25日（基金转型前一日），本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无划分为第一层次的余额，划分为第二层次的余额为人民币5,386,400.00元，无划分为第三层次余额。（2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无划分为第一层次余额，划分为第二层次的余额为人民币15,156,436.40元，无划分为第三层次余额。）

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月28日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告（转型后）

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	50,678,781.00	90.37
	其中：股票	50,678,781.00	90.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	4,796,001.24	8.55
8	其他各项资产	605,725.99	1.08
9	合计	56,080,508.23	100.00

注：金融衍生品投资项下的股指期货投资净额为0，在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,087,140.00	3.78
B	采矿业	-	-

C	制造业	29,351,903.00	53.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	883,198.00	1.60
E	建筑业	1,492,752.00	2.70
F	批发和零售业	3,696,364.00	6.69
G	交通运输、仓储和邮政业	2,698,846.00	4.88
H	住宿和餐饮业	445,857.00	0.81
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,920,689.00	7.09
J	金融业	1,357,160.00	2.46
K	房地产业	2,095,596.00	3.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,302,310.00	2.36
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,036,502.00	1.87
S	综合	310,464.00	0.56
	合计	50,678,781.00	91.68

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600602	云赛智联	226,200	1,126,476.00	2.04
2	603025	大豪科技	99,200	1,106,080.00	2.00
3	002321	华英农业	211,400	1,090,824.00	1.97
4	600963	岳阳林纸	271,000	1,086,710.00	1.97
5	000759	中百集团	205,800	1,086,624.00	1.97
6	002246	北化股份	164,000	1,084,040.00	1.96
7	300212	易华录	52,200	1,081,584.00	1.96
8	600195	中牧股份	98,400	1,046,976.00	1.89
9	601900	南方传媒	123,100	1,036,502.00	1.87
10	000553	沙隆达A	110,800	1,011,604.00	1.83
11	600773	西藏城投	165,800	994,800.00	1.80
12	002353	杰瑞股份	66,200	993,000.00	1.80

13	002385	大北农	300,800	962,560.00	1.74
14	601717	郑煤机	169,200	935,676.00	1.69
15	600428	中远海特	280,500	911,625.00	1.65
16	000969	安泰科技	196,200	892,710.00	1.61
17	002254	泰和新材	79,200	858,528.00	1.55
18	600958	东方证券	100,800	803,376.00	1.45
19	000851	高鸿股份	157,200	748,272.00	1.35
20	603515	欧普照明	23,700	660,519.00	1.19
21	600787	中储股份	130,800	654,000.00	1.18
22	603637	镇海股份	42,600	629,628.00	1.14
23	600328	兰太实业	89,300	611,705.00	1.11
24	300446	乐凯新材	39,600	607,464.00	1.10
25	600096	云天化	119,200	597,192.00	1.08
26	002189	利达光电	47,200	587,640.00	1.06
27	600420	现代制药	64,100	585,874.00	1.06
28	600677	航天通信	61,200	579,564.00	1.05
29	600990	四创电子	16,900	579,501.00	1.05
30	600463	空港股份	80,400	575,664.00	1.04
31	600458	时代新材	84,400	572,232.00	1.04
32	300245	天玑科技	66,400	569,712.00	1.03
33	002777	久远银海	23,800	561,204.00	1.02
34	600061	国投资本	61,600	553,784.00	1.00
35	603860	中公高科	22,600	543,982.00	0.98
36	600251	冠农股份	110,000	543,400.00	0.98
37	600156	华升股份	130,800	534,972.00	0.97
38	300703	创源文化	36,200	530,692.00	0.96
39	000779	三毛派神	60,800	527,136.00	0.95
40	600035	楚天高速	174,600	515,070.00	0.93
41	002255	海陆重工	130,800	511,428.00	0.93
42	300511	雪榕生物	84,800	506,256.00	0.92
43	000736	中交地产	67,600	502,268.00	0.91
44	603299	井神股份	96,200	493,506.00	0.89
45	600475	华光股份	59,800	490,360.00	0.89
46	000713	丰乐种业	107,000	490,060.00	0.89
47	000881	中广核技	70,000	470,400.00	0.85
48	002799	环球印务	38,700	465,561.00	0.84
49	600101	明星电力	70,000	465,500.00	0.84
50	300680	隆盛科技	27,300	464,646.00	0.84
51	000757	浩物股份	87,200	458,672.00	0.83
52	000657	中钨高新	85,200	453,264.00	0.82
53	603069	海汽集团	67,200	442,176.00	0.80
54	000731	四川美丰	87,200	437,744.00	0.79

55	600894	广日股份	79,700	434,365.00	0.79
56	000903	云内动力	180,200	432,480.00	0.78
57	600791	京能置业	118,700	432,068.00	0.78
58	600203	福日电子	98,600	428,910.00	0.78
59	002101	广东鸿图	53,000	428,770.00	0.78
60	600960	渤海汽车	121,600	428,032.00	0.77
61	000599	青岛双星	114,600	424,020.00	0.77
62	000993	闽东电力	91,400	417,698.00	0.76
63	002386	天原集团	75,100	401,785.00	0.73
64	002586	围海股份	87,200	394,144.00	0.71
65	002884	凌霄泵业	18,300	379,359.00	0.69
66	002406	远东传动	70,000	370,300.00	0.67
67	002095	生意宝	18,200	358,176.00	0.65
68	002443	金洲管道	67,200	356,832.00	0.65
69	300089	文化长城	67,200	356,832.00	0.65
70	000753	漳州发展	117,400	345,156.00	0.62
71	600480	凌云股份	45,100	344,113.00	0.62
72	002046	轴研科技	53,600	340,360.00	0.62
73	600502	安徽水利	94,800	337,488.00	0.61
74	000850	华茂股份	104,800	335,360.00	0.61
75	600783	鲁信创投	19,800	310,464.00	0.56
76	002282	博深工具	35,600	297,616.00	0.54
77	600549	厦门钨业	23,600	285,088.00	0.52
78	000632	三木集团	69,500	268,270.00	0.49
79	000524	岭南控股	37,600	259,440.00	0.47
80	300334	津膜科技	33,900	259,335.00	0.47
81	002066	瑞泰科技	33,600	243,600.00	0.44
82	600058	五矿发展	36,800	239,568.00	0.43
83	002632	道明光学	33,800	234,234.00	0.42
84	600831	广电网络	31,900	215,963.00	0.39
85	002297	博云新材	33,600	200,256.00	0.36
86	002394	联发股份	19,000	191,520.00	0.35
87	600742	一汽富维	18,900	188,622.00	0.34
88	601007	金陵饭店	23,100	186,417.00	0.34
89	600853	龙建股份	53,600	185,456.00	0.34
90	000589	黔轮胎A	53,600	179,560.00	0.32
91	300120	经纬辉开	29,500	179,065.00	0.32
92	002084	海鸥住工	45,900	178,551.00	0.32
93	000523	广州浪奇	44,320	175,064.00	0.32
94	600731	湖南海利	40,000	168,800.00	0.31
95	002682	龙洲股份	39,000	167,700.00	0.30
96	002363	隆基机械	35,000	166,600.00	0.30

97	002314	南山控股	58,000	166,460.00	0.30
98	000698	沈阳化工	45,500	165,620.00	0.30
99	603060	国检集团	6,600	128,700.00	0.23
100	002579	中京电子	1,100	9,449.00	0.02
101	300217	东方电热	4,000	9,320.00	0.02
102	300599	雄塑科技	900	9,099.00	0.02
103	600893	航发动力	400	8,688.00	0.02
104	603056	德邦股份	500	8,275.00	0.01
105	002544	杰赛科技	700	7,574.00	0.01
106	002536	西泵股份	800	7,416.00	0.01

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600773	西藏城投	2,322,979.00	4.20
2	600061	国投资本	1,777,541.00	3.22
3	600428	中远海特	1,751,813.99	3.17
4	002321	华英农业	1,597,916.00	2.89
5	600958	东方证券	1,472,972.00	2.66
6	002352	顺丰控股	1,404,460.00	2.54
7	300334	津膜科技	1,390,882.00	2.52
8	603025	大豪科技	1,293,038.00	2.34
9	002246	北化股份	1,260,933.00	2.28
10	601900	南方传媒	1,245,999.00	2.25
11	600602	云赛智联	1,239,630.00	2.24
12	603515	欧普照明	1,230,065.00	2.23
13	300212	易华录	1,224,026.00	2.21
14	600963	岳阳林纸	1,216,184.00	2.20
15	000759	中百集团	1,192,878.00	2.16
16	600096	云天化	1,178,345.00	2.13
17	002353	杰瑞股份	1,164,514.00	2.11
18	002254	泰和新材	1,147,205.00	2.08
19	600195	中牧股份	1,143,321.22	2.07
20	000553	沙隆达A	1,114,300.00	2.02

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002352	顺丰控股	1,400,934.00	2.53

2	600061	国投资本	1,260,542.00	2.28
3	600773	西藏城投	1,257,365.00	2.27
4	300334	津膜科技	1,207,479.00	2.18
5	000703	恒逸石化	1,134,336.00	2.05
6	300732	设研院	1,094,337.00	1.98
7	002563	森马服饰	1,080,584.00	1.95
8	603833	欧派家居	1,070,492.00	1.94
9	601138	工业富联	1,068,636.00	1.93
10	600748	上实发展	1,007,658.00	1.82
11	601669	中国电建	924,841.66	1.67
12	000058	深赛格	916,234.00	1.66
13	603026	石大胜华	805,202.00	1.46
14	600428	中远海特	803,555.00	1.45
15	002061	浙江交科	728,420.00	1.32
16	600783	鲁信创投	670,028.64	1.21
17	600133	东湖高新	637,165.00	1.15
18	000993	闽东电力	604,482.00	1.09
19	002406	远东传动	585,049.00	1.06
20	600096	云天化	584,357.00	1.06

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	80,551,887.87
卖出股票收入(成交)总额	27,288,036.05

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

无。

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

无。

8.7 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

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1901	IC1901	2	1,652,400.00	-88,920.00	-
公允价值变动总额合计					-88,920.00
股指期货投资本期收益					-27,634.56
股指期货投资本期公允价值变动					-88,920.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示,单位为手。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能,改变投资组合的 beta,以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此,套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求,需要在未来买入现货股票,为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作;空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险,控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成,决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中,基金管理人通过对股票组合的结构分析,分离组合的系统性风险(beta)及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合 beta 值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰,通过大量数据分析与量化建模,确立最优套保比率。

在套期保值过程中,基金管理人将不断精细和不断修正套保策略,动态管理套期保值组合。主要工作包括,基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理;对投资组合 beta 系数的实时监控,全程评估套期保值的效果和基差风险,当组合 beta 值超过事先设定的 beta 容忍度时,需要

对套期保值组合进行及时调整；进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

无。

8.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	278,260.52
2	应收证券清算款	276,575.95
3	应收股利	-
4	应收利息	975.85
5	应收申购款	49,913.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	605,725.99

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	5,386,400.00	23.37
	其中：债券	5,386,400.00	23.37
	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	-	-
	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	17,502,521.59	75.95
8	其他各项资产	156,174.68	0.68
9	合计	23,045,096.27	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所有股票投资明细

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

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	600183	生益科技	417,705.00	1.50
2	000012	南玻A	405,504.00	1.46
3	601636	旗滨集团	388,863.00	1.40
4	603708	家家悦	302,249.00	1.09
5	002353	杰瑞股份	276,565.00	0.99
6	601808	中海油服	276,339.00	0.99
7	000910	大亚圣象	265,382.00	0.95
8	002340	格林美	264,707.00	0.95
9	601939	建设银行	256,551.00	0.92
10	000759	中百集团	224,971.00	0.81
11	002271	东方雨虹	138,336.00	0.50
12	600486	扬农化工	137,483.00	0.49
13	600048	保利地产	128,354.26	0.46
14	000725	京东方A	128,148.00	0.46
15	601336	新华保险	127,774.00	0.46
16	600585	海螺水泥	126,693.00	0.46
17	603799	华友钴业	125,255.00	0.45
18	300595	欧普康视	124,809.00	0.45
19	000960	锡业股份	120,969.00	0.43
20	002179	中航光电	116,924.00	0.42

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	300109	新开源	677,455.00	2.43
2	000012	南玻A	392,496.28	1.41
3	600183	生益科技	383,395.40	1.38
4	601636	旗滨集团	380,693.90	1.37
5	603708	家家悦	293,694.02	1.06
6	002353	杰瑞股份	283,790.00	1.02
7	601808	中海油服	269,895.00	0.97
8	601939	建设银行	265,595.05	0.95
9	002340	格林美	258,458.00	0.93
10	000910	大亚圣象	245,449.00	0.88
11	000759	中百集团	209,222.00	0.75

12	603799	华友钴业	142,987.00	0.51
13	002271	东方雨虹	137,247.00	0.49
14	600486	扬农化工	132,925.00	0.48
15	000725	京东方A	132,584.00	0.48
16	600048	保利地产	131,965.00	0.47
17	600585	海螺水泥	130,962.00	0.47
18	601336	新华保险	128,040.00	0.46
19	300595	欧普康视	127,224.00	0.46
20	000960	锡业股份	120,418.00	0.43

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	4,353,581.26
卖出股票收入(成交)总额	4,962,935.65

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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	999,800.00	4.43
	其中:政策性金融债	999,800.00	4.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	4,386,600.00	19.43
9	其他	-	-
10	合计	5,386,400.00	23.85

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	111710677	17 兴业银行 CD677	45,000	4,386,600.00	19.43

2	170207	17 国开 07	10,000	999,800.00	4.43
---	--------	----------	--------	------------	------

8.7 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

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股指期货交易情况说明

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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 17 兴业银行 CD677（111710677）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。

8.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	7,390.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,784.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,174.68

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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（转型后）

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(%)
大成景恒混合A	3621	11,484.07	0.00	0.00	41,583,807.60	100.00
大成景恒混	1596	9,023.30	0.00	0.00	14,401,180.10	100.00

合 C						
合计	5217	10,731.26	0.00	0.00	55,984,987.70	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	大成景恒混合 A	114310.38	0.2749
	大成景恒混合 C	-	0.0000
	合计	114310.38	0.2065

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	大成景恒混合 A	0
	大成景恒混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景恒混合 A	10~50
	大成景恒混合 C	0
	合计	10~50

§9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
748	29,783.00	-	-	22,277,687.33	100.00

注: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	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	2,651.47	0.0133

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	大成景恒混合 A	大成景恒混合 C
基金合同生效日 (2018 年 6 月 26 日) 基金份额总额	22,277,687.33	-
本报告期期初基金份额总额	-	-
本报告期基金总申购份额	32,028,124.85	24,411,584.66
减：本报告期基金总赎回份额	12,722,004.58	10,010,404.56
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	41,583,807.60	14,401,180.10

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2012 年 6 月 15 日） 基金份额总额	1,071,726,792.02
本报告期期初基金份额总额	27,787,237.12
本报告期基金总申购份额	215,331.63
减：本报告期基金总赎回份额	5,724,881.42
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	22,277,687.33

§ 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、基金托管人的重大人事变动

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

大成景恒混合型证券投资基金是根据原大成景恒保本混合型证券投资基金《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由大成景恒保本混合型证券投资基金转型而来。转型前基金投资策略见 2.2 基金产品说明（转型前）；转型后基金投资策略见 2.2 基金产品说明（转型后）。

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有限公司，本年度应支付的审计费用为 4.5 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(转型后)

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	
中信建投	1	43,878,032.41	40.69%	39,985.84	40.69%	-
长江证券	2	42,064,558.85	39.01%	38,333.79	39.01%	-
东方证券	1	8,629,517.00	8.00%	7,863.99	8.00%	-
中金公司	2	7,225,126.00	6.70%	6,584.14	6.70%	-
招商证券	2	5,275,038.66	4.89%	4,807.25	4.89%	-
国泰君安	1	762,016.00	0.71%	694.51	0.71%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注:1. 本报告期内本基金退租交易单元: 无; 新增交易单元: 长江证券。

2. 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。

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
长江证券	-	-	163,100,000.00	100.00%	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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	
光大证券	2	4,547,418.63	48.81%	4,143.83	48.79%	-
中信建投	1	3,550,202.00	38.11%	3,237.84	38.13%	-
长城证券	1	1,218,896.28	13.08%	1,110.71	13.08%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注:1. 本报告期内本基金退租交易单元: 无; 新增交易单元: 太平洋证券。

2. 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。

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
长城证券	3,079,376.24	9.34%	-	-	-	-
长江证券	118,141.50	0.36%	18,200,000.00	13.63%	-	-
光大证券	11,337,056.05	34.39%	115,300,000.00	86.37%	-	-
中信建投	18,432,942.03	55.91%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰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	2018-12-18
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京百度百盈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	2018-12-18
3	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-12-04
4	大成基金管理有限公司关于撤销沈阳分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-11-08

5	大成景恒混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-10-25
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货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	2018-09-19
7	大成景恒混合型证券投资基金（原大成景恒保本混合型证券投资基金转型）2018 年半年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-08-29
8	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加爱建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	2018-08-21
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富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	2018-08-16
10	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加上海中正达广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	2018-08-15
11	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加安信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	2018-08-14
12	大成景恒混合型证券投资基金（原大成景恒保本混合型证券投资基金转型）2018 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-07-20
13	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加东海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	2018-06-30
14	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加兴业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	2018-06-30
15	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加长江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	2018-06-30
16	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-06-30
17	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加中国银河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	2018-06-29
18	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加广州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	2018-06-28
19	关于大成景恒混合型证券投资基金 C 类份额增加部分销售机构的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-06-28
20	关于大成景恒混合型证券投资基金 C	中国证监会指定报刊及	2018-06-26

	类份额增加国都证券股份有限公司为销售机构的公告	本公司网站	
21	关于大成景恒保本混合型证券投资基金到期转型后变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-26
22	关于大成景恒混合型证券投资基金C类份额增加南京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	2018-06-26
23	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-22

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期转型及增设C类基金份额的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-21
2	关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期转型及增设C类基金份额的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-20
3	大成景恒混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-19
4	大成景恒混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-19
5	关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设C类基金份额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-19
6	大成景恒混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-19
7	大成景恒混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-19
8	大成景恒混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-06-19
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏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	2018-06-16
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财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	2018-06-09
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府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	2018-05-17
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为销	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018-05-04

	售机构的公告		
13	大成景恒保本混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-04-20
14	大成景恒保本混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-04-20
15	关于大成基金管理有限公司南京分公司 办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-04-03
16	大成景恒保本混合型证券投资基金 2017 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-31
17	《大成景恒保本混合型证券投资基金 基金合同》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-27
18	大成景恒保本混合型证券投资基金基 金合同	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-27
19	大成景恒保本混合型证券投资基金托 管协议	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-27
20	关于调整公司旗下证券投资基金赎回 费的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-27
21	关于修订公司旗下证券投资基金基金 合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-27
22	大成基金管理有限公司关于旗下部分 基金开通直销平台基金转换业务的公 告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-03-10
23	大成景恒保本混合型证券投资基金更 新招募说明书-摘要 (2017 年 2 期)	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-01-30
24	大成景恒保本混合型证券投资基金更 新招募说明书 (2017 年 2 期)	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-01-30
25	大成景恒保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-01-20
26	关于再次提请投资者及时更新已过期 身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2018-01-05

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

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

无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

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

1、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。

2、基金管理人于 2018 年 6 月 19 日发布了《关于大成景恒保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为大成景恒混合型证券投资基金后相关业务规则及增设 C 类基金份额的公告》，大成景恒保本混合型证券投资基金第二个保本周期于 2018 年 6 月 25 日到期，随后转型为大成景恒混合型证券投资基金，并增加收取销售服务费的 C 类份额，《大成景恒混合型证券投资基金基金合同》及《大成景恒混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 6 月 26 日起生效，具体详见相关公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成景恒混合型证券投资基金的文件；
- 2、中国证监会批准设立大成景恒保本混合型证券投资基金的文件；
- 3、《大成景恒混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《大成景恒混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、《大成景恒保本混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 7、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 8、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 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。

大成基金管理有限公司

2019年03月29日