# 大成景益平稳收益混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

2016年第1期

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
二〇一六年八月

重 要 提 示

大成景益平稳收益混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2014年6月11日证监许可【2014】586号文核准募集,本基金的基金合同于2014年6月26日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本招募说明书(更新)已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截至日为2016年6月26日(其中人员变动信息以公告日为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2016年3月31日,所列财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例50%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)三家公司。
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖剑

(二)主要人员情况

1. 公司高级管理人员

董事会:

刘卓先生,董事长,工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司;2007年6月,任哈尔滨银行股份有限公司执行董事;2008年8月,任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书;2012年4月,任哈尔滨银行股份有限公司副董事长;2012年11月至今,任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生,副董事长,国际法学硕士。1991年7月至1993年2月,任职于共青团河南省委;1993年3月至12月,任职于深圳市国际经济与法律咨询公司;1994年1月至6月,任职于深圳市蛇口律师事务所;1994年7月至1997年4月,任职于蛇口招商港务股份有限公司;1997年5月至2015年1月,先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部研究员,南方总部机构管理部副总经理,光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理,资产管理总部投资部副总经理(主持工作),法律合规部副总经理,零售交易业务总部副总经理。

罗登攀先生,董事、总经理,耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师,以及SLCG证券诉讼和咨询公司合伙人;2009年至2012年,任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员,机构部创新处负责人,兼任国家“千人计划”专家;2013年2月至2014年10月,任中信并购基金管理有限公司董事总经理,执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2015年3月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。2015年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事总经理。

周雄先生,董事,金融学博士,北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。1987年8月至1993年4月,任厦门大学财经系教师;1993年4月至1996年8月,任华夏证券有限公司厦门分公司经理;1996年8月至1999年2月,任人民日报社事业发展局企业管理处副处长;1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司,历任副总裁、总裁,现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生,董事,博士研究生在读。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司投资二部董事总经理、投资决策委员会委员。2012年6月起,兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士,独立董事,经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师,中国人民大学经济学院院长助理,中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生,独立董事,法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任,博士研究生导师,国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士,独立董事,金融学博士,现任东北财经大学讲师,教研室主任,东北财经大学金融学国家级教学团队成员,东北财经大学开发金融研究中心助理研究员,主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目,并负责撰写项目总结报告,在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生,独立董事,博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授(博士生导师)和北京大学光华管理学院讲席教授(博士生导师),金融系联合系主任,院长助理,北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年,并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会:

陈希先生,监事长,中国人民大学经济学专业研究生,高级经济师。2006年被亚洲风险与危机管理协会授予“企业风险管理师”资格。2007年起任中国银河投资管理有限公司董事,常务副总裁(至2012年7月)、党委委员;2010年7月起,兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事,2012年6月起,兼任镇江银河创业投资有限公司董事长;2012年7月起至今,任中国银河投资管理有限公司总裁。

蒋卫强先生,职工监事,经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司,历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监,现任风险管理部总监。

吴萍女士,职工监事,文学学士。1991年至1992年任中国农业银行深圳分行国际业务部会计。1993年至1998年任日本三和银行深圳分行单证部、信贷部主任。1999年至2009年任普华永道会计师事务所深圳分所审计部经理、高级经理。2010年6月加入大成基金管理有限公司,历任计划财务部高级会计师、总监助理,现任计划财务部副总监。

其他高级管理人员:

杜鹏女士,督察长,研究生学历。1992年－1994年,历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人;1994年－1998年,历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理;1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建;1999年3月起,任大成基金管理有限公司督察长。2009年3月—2015年7月兼任大成国际资产管理有限公司董事。

肖剑先生,副总经理,公共管理硕士。曾任深圳市南山区委(政府)办公室副主任,深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司,任公司副总经理。

温智敏先生,副总经理,哈佛大学法学博士。2000至2002年就职于Hunton & Williams美国及国际律师事务所,2002至2006年任中银国际投行业务副总裁,2006至2009年任香港三山投资公司董事总经理,2009至2014年任标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司,出任首席战略官,2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生,副总经理,大学本科学历。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司,历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理,2015年8月起任公司副总经理。

2、本基金基金经理

(1)现任基金经理

赵世宏先生,经济学硕士,证券从业年限5年。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。自2016年3月26日起担任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成景恒保本混合型证券投资基金、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。具有基金从业资格。国籍:中国

(2)历任基金经理

| 姓名: | 任期起始日 | 任期结束日 |
| --- | --- | --- |
| 王磊 | 2014年6月26日 | 2016年3月25日 |

3、公司投资决策委员会

公司固定收益投资决策委员会由3名成员组成,设固定收益投资决策委员会主席1名,其他委员2名。名单如下:

罗登攀,总经理,固定收益投资决策委员会主席;张翼,固定收益总部总监,固定收益投资决策委员会委员;王立,基金经理,固定收益总部副总监兼公募投资部总监,固定收益投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人:周慕冰
成立日期:2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本:32,479,411.7万元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-66060069
传真:010-68121816
联系人:林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2013年至2015年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”,2015年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

基金托管业务经营情况

截止到2016年6月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共342只。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1. 直销机构

大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:王为开
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线:400-888-5558(免长途固话费)

(1)大成基金深圳投资理财中心:
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
电话: 0755-22223523、0755-22223555、0755-22223556
联系人:肖成卫、白小雪
传真:0755-83195235/83195245/83195232
邮编:518040

2. 场外代销机构

1、中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人:周慕冰
联系人:林葛
联系电话:010-66060069
传真:010-68121816
客服电话:95599
网址:www.abchina.com

2、张家港农村商业银行股份有限公司
注册地址:张家港市杨舍镇人民中路66号
法定代表人:王自忠
客服电话:0512-96065
联系人:施圆圆
电话:0512-56968212
传真:0512-58236370
网址: www.zrcbank.com

3、郑州银行股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路22号
法定代表人:王天宇
客户服务电话:0371-967585
网址:www.zzbank.cn

4、招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客服电话: 95565
联系人:黄婵君
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn

5、中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客服电话:4008-888-888
联系人:宋明
联系电话:010-66568450
传真:010-66568990
网址:www.chinastock.com.cn

6、海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
客服电话:95553、400-888-8001
联系人:李笑鸣
电话:021－23219000
传真:021-63602722
网址:www.htsec.com

7、长城证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:杨光裕
客户服务热线:0755-33680000、400-6666-888
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
网址:www.cgws.com

8、光大证券股份有限公司
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
客服电话:400-888-8788、95525
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com

9、中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人:丁学东
联系人:杨涵宇
电话:010-65051166
网址:www.ciccs.com.cn

10、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
法定代表人:杨懿
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号?？
联系人:张燕
联系电话:010-58325388*1588
网站:www.new-rand.cn
客户服务电话:400-166-1188

11、和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
联系电话:021-20835785
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com

12、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司?
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人:汪静波
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼 ？
联系人:徐诚
联系电话:021-38509639
网站:www.noah-fund.com
客户服务电话:400-821-5399

13、上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64383798
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn

14、上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906
法定代表人: 杨文斌
客服电话: 400-700-9665
联系人: 张茹
联系电话: 021-58870011
传真: 021-68596916
网址: www.ehowbuy.com

15、浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8580?
传真:0571-88911818-8002
客户服务电话:4008-773-772
网站地址 www.5ifund.com

16、北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址: 北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦 (丹棱soho) 1008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
网站:www.qianjing.com
客户服务电话:400-893-6885

17、泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
电话:0411-88891212
传真:0411-84396536
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com

18、上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:4000178000
联系人:葛佳蕊
电话:021-63333319
传真:021-63332523
网址:www.lingxianfund.com

19、武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:杨帆
电话:027-87006003/87006009
网站:www.buyfunds.cn
公司传真:027-87006010
客户服务电话:400-027-9899

20、上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼？？
联系人:宁博宇
网站:www.lufunds.com
客户服务电话:4008219031

21、珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人:黄敏嫦
网站:www.yingmi.cn
客户服务电话:020-89629066

22、奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室@法定代表人: TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客户服务电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn

23、深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址:深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-1102
办公地址:深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
法定代表人:陈姚坚
联系人:张烨
电话:0755-84034499?
传真:0755-84034477?
客服电话:400-950-0888
网址:http://www.jfzinv.com

24、北京蒽次方资产管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
客服电话:010-61840688
联系人:袁永娇
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址:www.ncfjj.com

25、徽商期货有限责任公司
注册地址:合肥市芜湖路258号
法人代表人:吴国华
联系人:蔡芳
传真:0551-62862801
客服电话:4008878707
网址:http://www.hsqh.net

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦33层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:范瑛

(三)律师事务所和经办律师

名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:靳庆军、冯艾
联系人:冯艾

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:薛竞、俞伟敏
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏

四、基金的名称

本基金名称:大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:混合型基金

六、基金的运作方式

本基金运作方式:契约型开放式

七、基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过灵活的资产配置,力求实现基金资产的持续稳健增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为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、货币市场工具、权证、资产支持证券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)。

本基金的投资对象是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)、权证等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例不超过30%,债券、货币市场工具等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于70%,保持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%, 权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

九、基金的投资策略

本基金将有采用“自上而下”的资产配置策略,在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上,通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略,通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断,综合运用多种投资策略,精选个券构建投资组合。

1、大类资产配置策略

本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。

2、债券投资策略

首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。

(1)久期配置策略

本基金将密切关注经济运行趋势,把握领先指标,预测未来走势,深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响,据此预测利率趋势和债券市场对上述变量和政策的反应,并据此对债券组合的平均久期进行调整。

(2)类属配置策略

确定目标久期后,本基金将根据宏观经济、市场利率、债券供求等因素的深入分析,预测各类属资产预期风险及收益情况,确定债券组合资产在利率品种、信用品种等资产之间的分配。

(3)信用债投资策略

①信用风险控制。本基金拟投资的每支信用债券必需经过公司内部债券信用评级系统进行评级,符合基金所对应的内部评级规定的信用债方可进行投资,以事前防范和控制信用风险。

②信用利差策略。伴随经济周期的波动,在经济周期的不同阶段,信用利差通常会缩小或扩大,通过对经济周期前瞻性的判断,把握利差的变动会带来投资机会。同时,本基金将积极关注信用产品发行人资信水平和评级调整带来的利差机会,选择评级有上调可能的信用债,以获取因利差下降带来的价差收益。本基金还将研究各期限信用债利差的历史水平、和相同期限但不同信用评级债券的相对利差水平,发掘偏离均值较多、相对利差可能收窄的债券。

(4)中小企业私募债投资策略

本基金在控制信用风险的基础上,对中小企业私募债投资,主要采取分散投资,控制个债持有比例。同时,紧密跟踪研究发债企业的基本面情况变化,灵活调整投资策略,控制投资风险。

(5)资产支持类证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

3、股票投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下,本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资,以增加基金收益。

(1)新股申购策略

本产品主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面确定参与标的、参与规模和退出时机,并综合考虑新股中签率、股价估值水平等因素,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高的申购收益。

(2)二级市场股票投资策略

本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法,在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。本基通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险,追求股票投资组合的长期稳定增值。

投资方法上重视投资价值与成长潜力的平衡,一方面利用价值投资标准筛选低价股票, 避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险;另一方面,利用成长性投资可分享高成长收益的机会。

4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金将对权证标的证券的基本面进行研究,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行定价。

十、基金的业绩比较基准

3年期银行定期存款利率(税后)+2%

本基金以在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过大类资产配置,力求实现基金资产的持续稳健增值为投资目标,以“3年期银行定期存款利率(税后)+2%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或市场出现更合适、更权威的比较基准,并且更接近本基金风格时,经基金托管人同意,本基金管理人在履行适当程序之后,可选用新的比较基准,并将及时公告。上述变更业绩比较基准不需要基金份额持有人大会通过。

十一、基金的风险收益特征

本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。

十二、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定,于2016年7 月5 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据取自大成景益平稳收益混合型证券投资基金2016年第1季度报告,截止2016年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 权益投资 | 17,026,620.00 | 15.15 |
| | 其中:股票 | 17,026,620.00 | 15.15 |
| 2 | 基金投资 | – | 0.00 |
| 3 | 固定收益投资 | 57,244,207.80 | 50.92 |
| | 其中:债券 | 57,244,207.80 | 50.92 |
| | 资产支持证券 | – | 0.00 |
| 4 | 贵金属投资 | – | 0.00 |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | 0.00 |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | 0.00 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,528,917.43 | 4.92 |
| 8 | 其他资产 | 32,617,798.91 | 29.01 |
| 9 | 合计 | 112,417,544.14 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | – | 0.00 |
| B | 采矿业 | 2,306,510.00 | 3.03 |
| C | 制造业 | 12,181,742.00 | 16.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | 0.00 |
| E | 建筑业 | – | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 757,512.00 | 1.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | – | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | – | 0.00 |
| J | 金融业 | – | 0.00 |
| K | 房地产业 | – | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,780,856.00 | 2.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | – | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | – | 0.00 |
| P | 教育 | – | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | – | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | – | 0.00 |
| S | 综合 | – | 0.00 |
| | 合计 | 17,026,620.00 | 22.39 |

3. 报告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明细

| 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 | 600990 | 四创电子 | 93,000 | 7,392,570.00 | 9.72 |
| 2 | 000796 | 凯撒旅游 | 82,600 | 1,780,856.00 | 2.34 |
| 3 | 002224 | 三 力 士 | 85,500 | 1,556,100.00 | 2.05 |
| 4 | 300038 | 梅泰诺 | 27,500 | 1,290,850.00 | 1.70 |
| 5 | 600216 | 浙江医药 | 59,000 | 787,650.00 | 1.04 |
| 6 | 600547 | 山东黄金 | 29,900 | 786,071.00 | 1.03 |
| 7 | 600497 | 驰宏锌锗 | 68,300 | 762,911.00 | 1.00 |
| 8 | 600259 | 广晟有色 | 17,900 | 757,528.00 | 1.00 |
| 9 | 603939 | 益丰药房 | 25,200 | 757,512.00 | 1.00 |
| 10 | 002260 | 德奥通航 | 25,000 | 745,000.00 | 0.98 |

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 国家债券 | 9,667,735.20 | 12.71 |
| 2 | 央行票据 | – | 0.00 |
| 3 | 金融债券 | – | 0.00 |
| | 其中:政策性金融债 | – | 0.00 |
| 4 | 企业债券 | 39,675,846.20 | 52.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | 0.00 |
| 6 | 中期票据 | – | 0.00 |
| 7 | 可转债 | 7,900,626.40 | 10.39 |
| 8 | 同业存单 | – | 0.00 |
| 9 | 其他 | – | 0.00 |
| 10 | 合计 | 57,244,207.80 | 75.26 |

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 122779 | 11株城发 | 87,330 | 9,780,960.00 | 12.86 |
| 2 | 124159 | 13绍城改 | 100,000 | 8,402,000.00 | 11.05 |
| 3 | 124014 | 12筑住投 | 100,000 | 8,374,000.00 | 11.01 |
| 4 | 010107 | 21国债(7) | 53,090 | 5,774,068.40 | 7.59 |
| 5 | 113009 | 广汽转债 | 32,650 | 3,910,490.50 | 5.14 |

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

(3)基金的其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | 334,280.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 31,440,661.42 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 842,758.62 |
| 5 | 应收申购款 | 98.52 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 32,617,798.91 |

(4)报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 128009 | 歌尔转债 | 126.72 | 0.00 |

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 000796 | 凯撒旅游 | 1,780,856.00 | 2.34 | 重大事项停牌 |
| 2 | 300038 | 梅泰诺 | 1,290,850.00 | 1.70 | 重大事项停牌 |

(6)由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

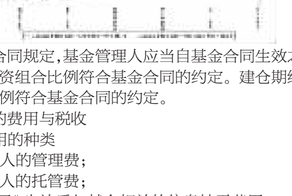
十三、基金的业绩

(一)本报告期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 | 净值增长率① | 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 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2014. 6.26－2014.12.31 | 43.50% | 1.24% | 3.24% | 0.02% | 40.26% | 1.22% |
| 2015.1.1－2015.12.31 | 4.11% | 1.70% | 5.20% | 0.02% | -1.09% | 1.68% |
| 2016.1.1－2016.3.31 | -7.56% | 1.50% | 1.09% | 0.02% | -8.65% | 1.48% |
| 2014. 6.26－2016.3.31 | 38.10% | 1.55% | 9.76% | 0.02% | 28.34% | 1.53% |

(二)自基金合同生效以来基金累计份额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:

大成景益平稳收益混合型证券投资基金累计份额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
(2014年6月26日至2016年3月31日)



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。

十四、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用(包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费);
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的开户费用、账户维护费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.8%
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、上述“一、基金费用的种类中第3-8项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

( 三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金管理费和基金托管费的调整

经基金管理人和基金托管人协商一致,基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动,对2016年2月6日公布的《大成景益平稳收益混合型证券投资基金更新招募说明书(2015年2期)》进行了内容补充和更新,本更新的招募说明书主要更新的内容如下:

1. 根据最新情况,对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
2. 根据最新情况,对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
3. 根据相关公告,对“五、相关服务机构”等相关信息进行了更新。
4. 根据相关财务数据,对“十一、基金的业绩”进行了更新。
5. 根据相关财务数据,对“二十、对基金份额持有人的服务”进行了更新。
6. 根据相关公告,对“二十四、其他应披露的事项”进行了更新,补充了2015年12月27日至2016年6月26日发布的公告。
7. 根据最新情况,更新了“二十五、招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司
二〇一六年八月十日