

## 大成景利混合型证券投资基金

## 2018年半年度报告摘要

## 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

基金管理人与中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

## § 1 重要提示

基金管理人：大成基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
送出日期：2018年8月29日

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	大成景利混合
基金代码	000895
基金托管方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月01日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金销售机构	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	31,006,995.11份
基金合同的存续	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的保值增值。
投资策略	本基金将利用“自上而下”的资产配置策略，在综合分析宏观经济环境、政策环境、资金面、利率水平、股票市场的估值水平、债券市场的收益率、可转债的条款、行业景气度、公司基本面等多方面因素的基础上，结合对股票、债券、可转债等金融工具的深入研究，进行动态调整，确定资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中债综合全价(总值)指数×40%

风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险收益特征高于货币市场基金，低于股票型基金。
--------	--------------------------------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	赵世先生	周立新
信息披露负责人	赵世先生	周立新
电子邮箱	0755-23106688	zsl@icbc.com.cn
客户服务电话	4000888866	95588
传真	0755-23106688	0755-23070700

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年报正文的管理人互联网网址	http://www.fundinfo.com.cn
基金半年度报告备查地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

项目	报告期1月1日至6月30日
本期实现收益	-1,379,641.74
本期利润	-1,422,511.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0494
期末基金资产净值	-309%
3.1.2 基金份额本期增长率为	报告期(2018年6月30日)
期初基金份额净值	0.1230
期末基金份额净值	36.229,278.10
报告期基金份额净值	1.136

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入后实际收益水平要低于列示数值。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率	份额净值增 长率标准差 (%)	业绩比较基准 收益率	业绩比较基准 收益率标准差 (%)	①-③	②-④
过去一个月	-3.06%	0.33%	0.01%	0.00%	-26.96%	0.36%
过去3个月	0.30%	1.02%	0.01%	-4.17%	0.36%	
过去一年	-2.10%	0.32%	4.21%	0.01%	-6.31%	0.31%
过去三年	16.16%	0.43%	13.92%	0.01%	1.25%	0.42%
自基金合同生 效以来	30.90%	0.07%	17.03%	0.01%	8.86%	0.05%

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



注：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。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及其基金经理的经验

## 4.1.1 基金管理人及其基金经理的经验

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(60%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理、QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2018年6月30日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，5只QDII基金及7只开放式证券投资基金。

## 4.2 基金经理（或基金经理助理）及基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理时间 任期截止日 离任日期

赵世先生 本基金基 金经理 2016年3月26日 - 7月

注：1、赵世先生自2018年7月16日起任本基金基金经理。赵世先生自2018年7月20日起不再担任本基金基金经理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

2、任职日期、离任日期为本公司总经理作出决定之日。

3、证券从业人员年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、基金管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人严格按照本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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的情况

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

理人运用统计方法和工具，对旗下所有投资组合间连续4个季度的内、3日内以及日内股票及债券交易向同交易对手进行分析。

分析结果表明：债券交易向同交易频率较低；股票同向交易溢价率变动主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内变动导致个别投资组合的成交价格存在一定差异，但结合交易价差统计分析，未发现违反公

平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行

为。主动型投资组合间股票交易存在同日反向交易，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，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。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出

投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

注：报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止，基金份

额总额31,006,995.11份。

§ 5 管理人报告

## 5.1 管理人报告期内本基金投资运作情况

5.1.1 投资组合报告

报告期末，本基金投资组合如下：

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债券

投资明细

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股票

投资明细

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基金

投资明细

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其