大成睿景灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
送出日期:2018年8月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人广发证券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06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成睿景灵活配置混合	
基金主代码	001300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月26日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,447,047,640.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码:	001300	001301
报告期末下属分级基金的份额总额	936,952,303.46份	510,095,336.78份

2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济转型期的成长股投资机会,本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,在控制风险前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析,研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段,综合评价各类资产市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+ 中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于货币市场基金与债券型基金,属于风险水平中高的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	崔瑞娟
	联系电话	0755-83183388	020-87555888
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4008885558	95575
传真		0755-83199588	020-87555129

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	71,700.00	-1,512,790.41
本期利润	-104,714,907.10	-57,092,670.71
加权平均基金份额本期利润	-0.1065	-0.1059
本期基金份额净值增长率	-14.00%	-14.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.3282	-0.3469
期末基金资产净值	638,583,297.52	338,773,543.19
期末基金份额净值	0.682	0.664

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成睿景灵活配置混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.91%	1.55%	-5.38%	1.11%	-4.53%	0.44%
过去三个月	-9.19%	1.24%	-8.24%	0.83%	-0.95%	0.41%
过去六个月	-14.00%	1.33%	-8.61%	0.86%	-5.39%	0.47%
过去一年	-7.34%	1.15%	-7.35%	0.73%	0.01%	0.42%
过去三年	-14.54%	1.44%	-21.77%	1.14%	7.23%	0.30%
自基金合同生效起至今	-31.80%	1.49%	-26.89%	1.19%	-4.91%	0.30%

大成睿景灵活配置混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-10.03%	1.54%	-5.38%	1.11%	-4.65%	0.43%
过去三个月	-9.41%	1.24%	-8.24%	0.83%	-1.17%	0.41%
过去六个月	-14.32%	1.33%	-8.61%	0.86%	-5.71%	0.47%
过去一年	-8.16%	1.15%	-7.35%	0.73%	-0.81%	0.42%
过去三年	-16.79%	1.44%	-21.77%	1.14%	4.98%	0.30%
自基金合同生效起至今	-33.60%	1.49%	-26.89%	1.19%	-6.71%	0.30%

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。截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由三家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司 (50%)、光大证券股份有限公司 (25%)、中国银河投资管理有限公司 (25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理,还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展,公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样,构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至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75只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李本刚先生	本基金基金经理,股票投资部总监	2015年9月18日	-	17年	管理学硕士。2001年至2010年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员。2010年8月加入大成基金管理有限公司,历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012年9月4日至2015年7月1日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理,2015年7月2日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理。2014年4月16日至2015年7月2日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理,2015年7月3日起至2015年10月21日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理。2014年5月14日至2015年5月25日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年9月18日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月13日起任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年9月12日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2017年12月20日起担任大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部总监。具有基金从业资格。国籍:中国
谢家乐先生	本基金基金经理助理	2017年2月20日	-	6年	华中科技大学硕士研究生。2012年7月至2014年5月任华泰证券股份有限公司研究所研究员。2014年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究部助理研究员、研究员。自2017年2月20日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍:中国

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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变动导致个别组合间的成交价存在一定差异,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。

4.3.2 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2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年以来,全球复苏依然在持续,但势头有所放缓。从总体数据看,18年初以来,OECD综合领先指标依然继续向上, 显示全球主要经济体景气程度继续向上。从月度数据看,2018 年全球制造业 PMI 整体呈回落趋势, 考虑到 PMI 本身具有环比性质,PMI 数据的回落只表明制造业扩张速度有所放缓, 并不能说明复苏趋势变化。从数据本身看,1—5 月全球制造业 PMI 最低为 53.1,仍在较高景气区间,表明全球复苏趋势没有明显变化,只是扩张势头有所放缓。

同期,国内经济数据表现不一,工业增加值增速高于17年,但需求端增速下行,进出口数据受到美国贸易战影响,不确定性增加。从 1-5 月经济数据表现看,生产端的工业增加值数据表现不错,1-5月同比增长 6.9%,高于 2017 年增速 0.3 个百分点;但需求端的固定资产投资和社会消费品零售总额增速则持续下行,1-5 月分别增长 6.1%和 9.5%,低于 2017 年增速 1.1 和 0.7 个百分点;出口和进口数据依然表现良好,美元计价的出口 1-5 月同比增长 13.3%,进口同比增长 21%,分别较 2017 年增速提升 5.4 和 4.9 个百分点,然而,近期中美贸易摩擦以及全球经济数据表现有所回落则给未来贸易走势增加了不确定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿景灵活配置混合A基金份额净值为0.682元,本报告期基金份额净值增长率为-14.00%;截至本报告期末大成睿景灵活配置混合C基金份额净值为0.664元,本报告期基金份额净值增长率为-14.32%;同期业绩比较基准收益率为-8.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年情况。2季度末,世界主要经济体如欧美的重要经济指标出现一定超预期增长。在此增速基础上,未来的同环比增长趋势需要重点跟踪,这可能是国外货币政策变化的前瞻指标。同时,国内政策也短期出现调整,去杠杆力度有所放缓,但我们判断,整体方向不会出现根本性反转,资管新规等也会继续推进。

在以上国内外经济变化背景下,股票市场在上半年经历较大波动。受汇率波动和棚改政策变化、部分行业补贴政策变化和贸易战的影响,传统经济板块、tmt板块、消费板块部分行业都有一定跌幅。基于对下半年判断,我们将基于对公司内在价值的评估和判断,继续选择能够抵御风险、具备长期价值空间的投资标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会,公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员中包括三名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值调整事项;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本基金托管人在对大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,大成睿景灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成睿景灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	118,694,155.46	118,222,960.65
结算备付金	2,747,937.95	1,124,091.82
存出保证金	1,067,357.90	1,118,118.88
交易性金融资产	859,031,467.50	1,168,848,292.72
其中:股票投资	859,031,467.50	1,168,848,292.72
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	8,771,696.70
应收利息	22,842.99	25,848.31
应收股利	-	-
应收申购款	67,492.83	56,066.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	981,631,254.63	1,298,167,075.66
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	755,606.35	-
应付赎回款	450,130.30	1,551,569.83
应付管理人报酬	1,308,127.90	1,634,081.45
应付托管费	218,021.31	272,346.90
应付销售服务费	241,719.98	305,056.72
应付交易费用	1,085,076.60	896,540.06
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	215,731.48	335,000.00
负债合计	4,274,413.92	4,994,594.96
所有者权益:		
实收基金	1,447,047,640.24	1,644,063,626.35
未分配利润	-469,690,799.53	-350,891,145.65
所有者权益合计	977,356,840.71	1,293,172,480.70
负债和所有者权益总计	981,631,254.63	1,298,167,075.66

注:报告截止日2018年6月30日,大成睿景灵活配置混合A基金份额净值0.682元,大成睿景灵活配置混合C基金份额净值0.664元,基金份额总额1,447,047,640.24份,其中大成睿景灵活配置混合A基金份额936,952,303.46份,大成睿景灵活配置混合C基金份额510,095,336.78份。

6.2 利润表

会计主体:大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-146,445,019.04	32,391,006.30
1.利息收入	540,573.52	1,615,571.85
其中:存款利息收入	540,573.52	1,148,471.78
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	467,100.07
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	13,368,890.91	-14,998,875.85
其中:股票投资收益	10,564,275.52	-30,405,936.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,804,615.39	15,407,061.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-160,366,487.40	45,740,563.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	12,003.93	33,746.42
减:二、费用	15,362,558.77	21,149,798.65
1. 管理人报酬	8,622,559.42	11,913,702.34
2. 托管费	1,437,093.27	1,985,617.08
3. 销售服务费	1,604,367.08	2,019,410.08
4. 交易费用	3,473,468.63	5,014,998.78
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	225,070.37	216,070.37
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	-161,807,577.81	11,241,207.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-161,807,577.81	11,241,207.65

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	1,644,063,626.35	-350,891,145.65	1,293,172,480.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-161,807,577.81	-161,807,577.81
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)	-197,015,986.11	43,007,923.93	-154,008,062.18
其中:1.基金申购款	21,096,685.22	-4,995,191.95	16,101,493.27
2.基金赎回款	-218,112,671.33	48,003,115.88	-170,109,555.45
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)	1,447,047,640.24	-469,690,799.53	977,356,840.71
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	2,387,227,741.97	-658,980,146.68	1,728,247,595.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,241,207.65	11,241,207.65
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)	-339,913,694.94	97,520,739.45	-242,392,955.49
其中:1.基金申购款	28,393,619.26	-8,276,628.56	20,116,990.70
2.基金赎回款	-368,307,314.20	105,797,368.01	-262,509,946.19
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)	2,047,314,047.03	-550,218,199.58	1,497,095,847.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

______罗登攀______ ______周立新______ ____崔伟____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。

(2)对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,股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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,暂减按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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司("大成基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司("广发证券")	基金托管人、基金销售机构
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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
广发证券	2,256,027,510.61	100.00%	3,241,914,320.66	100.00%

6.4.4.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未通过关联方进行债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	-	0.00%	720,000,000.00	100.00%

6.4.4.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未通过关联方进行权证交易。

6.4.4.1.5 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30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
广发证券	2,055,863.16	100.00%	1,085,076.60	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
广发证券	2,954,417.75	100.00%	1,322,347.55	100.00%

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,622,559.42	11,913,702.34
其中:支付销售机构的客户维护费	3,706,704.28	5,075,224.11

注:支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,437,093.27	1,985,617.08

注:支付基金托管人广发证券的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C	合计
大成基金	-	19,140.59	19,140.59
广发证券	-	1,142,674.33	1,142,674.33
光大证券	-	487.21	487.21
合计	-	1,162,302.13	1,162,302.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C	合计
大成基金	-	23,284.06	23,284.06
广发证券	-	1,424,879.12	1,424,879.12
光大证券	-	501.25	501.25
合计	-	1,448,664.43	1,448,664.43

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.8%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给大成基金,再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

] 大成睿景灵活配置混合C日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.80%/ 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	118,694,155.46	518,567.83	297,822,328.17	1,104,598.78

注:本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.5.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2018年5月28日	2019年6月10日	新股流通受限	13.77	16.40	820,245	11,294,773.65	13,452,018.00	-
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

注:1、基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,本基金持有的上市公司非公开发行股份,自股份解除限售之日起12个月内,通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%;采取大宗交易方式的,在任意连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外,本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份, 在受让后6个月内,不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002872	天圣制药	2018年4月3日	临时停牌	31.05	2018年7月3日	27.95	2,003	44,807.11	62,193.15	-
603825	华扬联众	2018年4月17日	临时停牌	25.08	2018年8月17日	22.57	2,209	23,149.26	55,401.72	-
002866	传艺科技	2018年3月13日	临时停牌	27.97	2018年7月4日	25.20	1,488	19,939.20	41,619.36	-
603880	南卫股份	2018年4月10日	临时停牌	18.85	2018年8月15日	20.74	1,043	9,399.44	19,660.55	-

注: 本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§7 投资组合报告

7.1 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	859,031,467.50	87.51
	其中:股票	859,031,467.50	87.51
2	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	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
6	银行存款和结算备付金合计	121,442,093.41	12.37
7	其他各项资产	1,157,693.72	0.12
8	合计	981,631,254.63	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	597,413,499.19	61.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	10,479,375.19	1.07
F	批发和零售业	22,174,833.15	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	188,457,703.08	19.28
H	住宿和餐饮业	18,181,104.37	1.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,401.72	0.01
J	金融业	500,857.85	0.05
K	房地产业	4,390,596.00	0.45
L	租赁和商务服务业	17,225,310.96	1.76
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	81,226.14	0.01
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	859,031,467.50	87.89

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	603008	喜临门	3,892,519	76,994,025.82	7.88
2	600029	南方航空	7,557,041	63,856,996.45	6.53
3	601111	中国国航	6,430,166	57,164,175.74	5.85
4	600115	东方航空	8,543,027	56,554,838.74	5.79
5	600872	中炬高新	1,980,200	55,445,600.00	5.67
6	000858	五 粮 液	604,936	45,975,136.00	4.70
7	000651	格力电器	865,944	40,829,259.60	4.18
8	002430	杭氧股份	2,785,967	39,922,907.11	4.08
9	000960	锡业股份	2,948,709	35,413,995.09	3.62
10	002669	康达新材	1,630,889	34,525,920.13	3.53

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(http://www.dcfund.com.cn)的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600029	南方航空	94,613,754.93	7.32
2	601111	中国国航	93,628,551.08	7.24
3	601398	工商银行	92,326,603.98	7.14
4	600115	东方航空	76,080,595.78	5.88
5	000960	锡业股份	75,160,343.90	5.81
6	603978	深圳新星	39,876,332.24	3.08
7	601288	农业银行	39,071,247.49	3.02
8	002669	康达新材	34,925,895.69	2.70
9	600028	中国石化	29,723,079.00	2.30
10	300319	麦捷科技	28,911,227.36	2.24
11	300232	洲明科技	22,196,433.12	1.72
12	002024	苏宁易购	21,623,683.99	1.67
13	603008	喜临门	20,855,590.84	1.61
14	601168	西部矿业	18,087,707.00	1.40
15	600887	伊利股份	17,372,649.00	1.34
16	300001	特锐德	17,033,100.61	1.32
17	002468	申通快递	16,311,616.41	1.26
18	600258	首旅酒店	16,310,386.14	1.26
19	601138	工业富联	16,135,383.06	1.25
20	300059	东方财富	14,550,591.00	1.13

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

7.4.2 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	601398	工商银行	84,253,430.76	6.52
2	600477	杭萧钢构	75,427,458.03	5.83
3	601939	建设银行	67,475,672.37	5.22
4	600985	雷鸣科化	56,304,322.49	4.35
5	000786	北新建材	50,654,184.74	3.92
6	601766	中国中车	49,271,382.00	3.81
7	000402	金 融 街	47,452,248.92	3.67
8	002244	滨江集团	45,861,303.92	3.55
9	000651	格力电器	43,820,444.20	3.39
10	601288	农业银行	39,241,605.00	3.03
11	600196	复星医药	34,316,480.49	2.65
12	600584	长电科技	32,821,059.36	2.54
13	000001	平安银行	27,324,537.01	2.11
14	600028	中国石化	26,866,404.25	2.08
15	002517	恺英网络	26,404,202.08	2.04
16	002050	三花智控	25,685,012.33	1.99
17	000960	锡业股份	25,589,491.37	1.98
18	000718	苏宁环球	18,418,107.44	1.42
19	601111	中国国航	17,826,263.94	1.38
20	000858	五 粮 液	16,971,116.39	1.31

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

7.4.3 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	1,057,347,825.36
卖出股票收入(成交)总额	1,217,362,438.70

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	1,067,357.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,842.99
5	应收申购款	67,492.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,157,693.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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 基金份额持有人信息

8.1 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
大成睿景灵活配置混合A	15,054	62,239.42	-	0.00%	936,952,303.46	100.00%
大成睿景灵活配置混合C	8,721	58,490.46	1,272,748.58	0.25%	508,822,588.20	99.75%
合计	23,775	60,864.25	1,272,748.58	0.09%	1,445,774,891.66	99.91%

注:1、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。

2、持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

8.2 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	大成睿景灵活配置混合A	378,913.90	0.0404%
	大成睿景灵活配置混合C	25,106.59	0.0049%
	合计	404,020.49	0.0279%

注:上述占基金总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 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	大成睿景灵活配置混合A	10~50
	大成睿景灵活配置混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成睿景灵活配置混合A	0
	大成睿景灵活配置混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
基金合同生效日(2015年5月26日)基金份额总额	2,702,699,750.93	1,532,807,589.94
本报告期期初基金份额总额	1,059,645,088.22	584,418,538.13
本报告期基金总申购份额	4,381,154.81	16,715,530.41
减:本报告期基金总赎回份额	127,073,939.57	91,038,731.76
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	936,952,303.46	510,095,336.78

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),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。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广发证券	2	2,256,027,510.61	100.00%	2,055,863.16	100.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

(二)经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;

(三)研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

(四)具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;

(五)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

本报告期内,无新增或退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

大成基金管理有限公司

2018年8月29日